

Asset Management

# Goldman Sachs Funds SICAV

Informe anual

Estados financieros auditados

R.C.S. Luxemburgo B41 751



1121

## Goldman Sachs Funds Índice

	Página
Consejeros y otra información	1
Informe del Asesor de inversiones	3
Informe de auditoría (en relación con las normas internacionales de auditoría)	7
Informe del Auditor independiente (en relación con los principios de contabilidad generalmente aceptados de EE. UU.)	10
Balance de situación	12
Cuenta de pérdidas y ganancias	19
Estado de variaciones patrimoniales	26
Información estadística	33
Notas a los Estados financieros	56
Estado de las inversiones	122
GOLDMAN SACHS FUNDS—CARTERAS DE RENTA VARIABLE	
Goldman Sachs Funds—Carteras de renta variable global y regional	
Goldman Sachs Funds—Asia Equity Portfolio	122
Goldman Sachs Funds—All China Equity Portfolio	124
Goldman Sachs Funds—Emerging Markets Equity ESG Portfolio	126
Goldman Sachs Funds—Emerging Markets Equity Portfolio	128
Goldman Sachs Funds—Global Environmental Impact Equity Portfolio	131
Goldman Sachs Funds—Global Equity Income Portfolio	133
Goldman Sachs Funds—Global Equity Partners ESG Portfolio	135
Goldman Sachs Funds—Global Equity Partners Portfolio	136
Goldman Sachs Funds—Global Future Health Care Equity Portfolio	138
Goldman Sachs Funds—Global Future Technology Leaders Equity Portfolio	140
Goldman Sachs Funds—Global Millennials Equity Portfolio	142
Goldman Sachs Funds—India Equity Portfolio	144
Goldman Sachs Funds—Japan Equity Partners Portfolio	146
Goldman Sachs Funds—Japan Equity Portfolio	147
Goldman Sachs Funds—US Equity Portfolio	149
Goldman Sachs Funds—US Focused Growth Equity Portfolio	151
Goldman Sachs Funds—US Small Cap Equity Portfolio	152
Goldman Sachs Funds—US Technology Opportunities Equity Portfolio	154
Goldman Sachs Funds—Carteras de renta variable por sectores	
Goldman Sachs Funds—Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	155
Goldman Sachs Funds—Global Infrastructure Equity Portfolio	156
Goldman Sachs Funds—Global Real Estate Equity Portfolio	158
Goldman Sachs Funds—North America Energy & Energy Infrastructure Equity Portfolio	160
Goldman Sachs Funds—Carteras de renta variable mundial y regional CORE®	
Goldman Sachs Funds—Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	161
Goldman Sachs Funds—Europe CORE® Equity Portfolio	166
Goldman Sachs Funds—Eurozone CORE® Equity Portfolio	169
Goldman Sachs Funds—Global CORE® Equity Portfolio	171
Goldman Sachs Funds—Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	175
Goldman Sachs Funds—US CORE® Equity Portfolio	181
Goldman Sachs Funds—US Small Cap CORE® Equity Portfolio	183

## Goldman Sachs Funds Índice

GOLDMAN SACHS FUNDS—CARTERAS DE RENTA FIJA	
Goldman Sachs Funds—Asia High Yield Bond Portfolio	188
Goldman Sachs Funds—Emerging Markets Corporate Bond Portfolio	195
Goldman Sachs Funds—Emerging Markets Debt Blend Portfolio	207
Goldman Sachs Funds—Emerging Markets Debt Local Portfolio	226
Goldman Sachs Funds—Emerging Markets Debt Portfolio	237
Goldman Sachs Funds—ESG-Enhanced Emerging Markets Short Duration Bond Portfolio	254
Goldman Sachs Funds—ESG-Enhanced Euro Short Duration Bond Plus Portfolio	259
Goldman Sachs Funds—ESG-Enhanced Europe High Yield Bond Portfolio	267
Goldman Sachs Funds—ESG-Enhanced Global Income Bond Portfolio	276
Goldman Sachs Funds—ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio	285
Goldman Sachs Funds—Global Credit Portfolio (Hedged)	293
Goldman Sachs Funds—Global Fixed Income Portfolio	309
Goldman Sachs Funds—Global Fixed Income Portfolio (Hedged)	324
Goldman Sachs Funds—Global High Yield Portfolio	342
Goldman Sachs Funds—Global Sovereign Bond Portfolio	357
Goldman Sachs Funds—Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio	368
Goldman Sachs Funds—US Dollar Short Duration Bond Portfolio	376
Goldman Sachs Funds—US Fixed Income Portfolio	386
Goldman Sachs Funds—US Mortgage Backed Securities Portfolio	400
GOLDMAN SACHS FUNDS—CARTERAS FLEXIBLES	
Goldman Sachs Funds—Emerging Markets Multi-Asset Portfolio	414
Goldman Sachs Funds—ESG-Enhanced Global Multi-Asset Balanced Portfolio	423
Goldman Sachs Funds—Global Multi-Asset Conservative Portfolio	436
Goldman Sachs Funds—Global Multi-Asset Growth Portfolio	439
Goldman Sachs Funds—Global Multi-Asset Income Portfolio	443
Goldman Sachs Funds—US Real Estate Balanced Portfolio	459
GOLDMAN SACHS FUNDS—CARTERAS ESPECIALIZADAS	
Goldman Sachs Funds—Emerging Markets Total Return Bond Portfolio	464
Goldman Sachs Funds—Global Absolute Return Portfolio	476
Goldman Sachs Funds—Global Dynamic Bond Portfolio	495
Goldman Sachs Funds—Global Dynamic Bond Plus Portfolio	510
Goldman Sachs Funds—Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)	529
Goldman Sachs Funds—Global Strategic Macro Bond Portfolio	551
Goldman Sachs Funds—Strategic Absolute Return Bond II Portfolio	560
GOLDMAN SACHS FUNDS—CARTERAS DE ESTRATEGIAS DE LOS GESTORES MUNDIALES	
Goldman Sachs Funds—Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio	573
GOLDMAN SACHS FUNDS—CARTERAS SELECTAS	
Goldman Sachs Funds—Global Corporate Portfolio (Hedged)	576
GOLDMAN SACHS FUNDS—CARTERAS ALTERNATIVAS	
Goldman Sachs Funds—Absolute Return Tracker Portfolio	590
Goldman Sachs Funds—Alternative Trend Portfolio	612

# Goldman Sachs Funds Índice

ANEXOS	
Anexo I—Divulgación de información con arreglo al Reglamento sobre divulgación de finanzas sostenibles ("SFDR", por sus siglas en inglés) (sin auditar)	616
Anexo II—Porcentajes de la comisión de asesoramiento, Límites de gastos y Ratios de gastos netos totales (sin auditar)	630
Anexo III—Lanzamientos, cierres y fusiones de Carteras y Clases de acciones (sin auditar)	648
Anexo IV—Concentración de accionistas (sin auditar)	651
Anexo V—Método de cálculo de la exposición global empleado (sin auditar)	656
Anexo VI—Enunciados del Informe anual de la sociedad gestora (sin auditar)	660
Anexo VII—Enunciados del Reglamento sobre las operaciones de financiación de valores ("SFTR", por sus siglas en inglés) (sin auditar)	662
Notas adicionales (sin auditar)	671

### **Goldman Sachs Funds** Conseieros y otra información

#### **GOLDMAN SACHS FUNDS SICAV**

#### Société d'Investissement à Capital Variable

Organismo de inversión colectiva organizado con arreglo a las leyes del Gran Ducado de Luxemburgo

Consejo de Administración Doña Grainne Alexander (irlandesa)¹ Don Jonathan Beinner (estadounidense)<sup>2</sup> Don Frank Ennis (irlandés)1 Don Glenn Thorpe (británico/australiano)<sup>2</sup> Doña Katherine Uniacke (estadounidense)2

#### Sociedad Gestora

Goldman Sachs Asset Management Fund Services Limited<sup>3</sup> 47-49 St. Stephen's Green Dublín 2 Irlanda

#### Auditor

PricewaterhouseCoopers, Société Coopérative 2, rue Gerhard Mercator B.P. 1443 L-1014 Luxemburgo Gran Ducado de Luxemburgo

# Depositario, Agente de domiciliaciones y de cotizaciones,

Administrador y Agente de pagos en Luxemburgo State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch 49, avenue J.F. Kennedy L-1855 Luxemburgo Gran Ducado de Luxemburgo

#### Distribuidor

Goldman Sachs Asset Management Fund Services Limited<sup>3</sup> 47-49 St. Stephen's Green Dublín 2

### Asesor de inversiones

Goldman Sachs Asset Management International<sup>3</sup> Plumtree Court 25 Shoe Lane Londres, EC4A 4AU Reino Unido

#### Subasesores de inversión4

Goldman Sachs Asset Management, L.P.3 200 West Street 10282 Nueva York Estados Unidos

Goldman Sachs Asset Management (Hong Kong) Ltd.3 68th Floor Cheung Kong Center 2 Queen's Road Central Hong Kong

Goldman Sachs Asset Management (Singapore) Pte. Ltd.3 1 Raffles Link #07-01 South Lobby Singapur 039393

Goldman Sachs Asset Management Co., Ltd.3 Roppongi Hills Mori Tower 10-1, Roppongi 6-chome Minato-Ku, Tokyo 106-6147, Japón

Goldman Sachs Hedge Fund Strategies, LLC<sup>3</sup> 1 New York Plaza 10004 Nueva York Estados Unidos

Goldman Sachs International<sup>3</sup> Plumtree Court 25 Shoe Lane Londres, EC4A 4AU Reino Unido

GS Investment Strategies, LLC3 200 West Street 10282 Nueva York Estados Unidos

### Asesor jurídico

Arendt & Medernach S.A. 41A, avenue J.F. Kennedy L-2082 Luxemburgo Gran Ducado de Luxemburgo

#### Domicilio social

c/o State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch 49, avenue J.F. Kennedy L-1855 Luxemburgo R.C.S. Luxemburgo B41 751 Gran Ducado de Luxemburgo

# Registrador y Agente de transferencias RBC Investor Services Bank S.A.

14, Porte de France L-4360 Esch-sur Alzette Gran Ducado de Luxemburgo

### **Goldman Sachs Funds** Conseieros y otra información

#### Agentes de pagos:

#### Agente de información y pagos en Austria

Raiffeisen Bank International AG Am Stadtpark 9 1030 Viena, Austria

#### Agente de información y pagos en Bélgica

RBC Investor Services Belgium S.A. 37 Boulevard du Roi Albert 1030 Schaerbeek, Bélgica

Agente de pagos en Chipre Eurobank EFG Cyprus Ltd. Banking Institution 41, Arch. Makarios Ave 1065 Nicosia Chipre

#### Representante en Dinamarca

StockRate Asset Management A/S 18D, sdr. Jernbanevej 3400 Hillerod, Dinamarca

Agente de información y pagos en Francia RBC Investor Services Bank France S.A. 105, rue Réaumur 75002 París, Francia

#### Agente de información y pagos en Alemania

State Street Bank GmbH Brienner Strasse 59 80333 Múnich, Alemania

Agente de pagos en Grecia Piraeus Asset Management Mutual Funds Management S.A. 87 Synarou Ave GR-11745 Atenas, Grecia

Citibank International Plc. 3, Achaias Street, Nea Kifissia GR-14564 Atenas, Grecia

Eurobank EFG Ergasias S.A. Stadiou 10, 3rd Floor, GR-10564 Atenas, Grecia

#### Agentes de pagos en Italia

Société Générale Securities Services S.p.A. Maciachini Center MAC 2 Via Benigno Crespi 19/A 20159 Milán, Italia

AllFunds Bank S.A. Milan Branch Via Santa Margherita 7 20121 Milán, Italia

#### Agentes de pagos en Italia (continuación)

RBC Dexia Investor Services Bank S.A. Milan Branch Cia Vittor Pisani 26 20154 Milán, Italia

State Street Bank S.p.A. Via Ferrante Aporti 10 20125 Milán, Italia

BNP Paribas Securities Services - Succursale di Milano Via Ansperto 5 20121 Milán, Italia

Banca Sella Holdings S.p.A. Piazza Gaudenzio Sella 1 I-13900 Biella, Italia

Banca Monte Dei Paschi Di Siena S.p.A. Via Sassetti 4 50123 Florencia, Italia

#### Agente de pagos en Liechtenstein

LGT Bank AG Herrengasse 12 FL-9490 Vaduz, Liechtenstein

#### Agente de pagos en Polonia

Bank Polska Kasa Opieki Spolka Akcyjna Grzybowska 53/57 00-950 Varsovia, Polonia

#### Agente de transferencias delegado en Polonia

Pekao Financial Services Sp. z o.o. Postepu Street no 21 02-676 Varsovia, Polonia

#### Representante en España

AllFunds Bank S.A. La Moraleja, Calle Estafeta 6 28109 Alcobendas, España

**Agente de pagos en Suiza** Goldman Sachs Bank AG<sup>3</sup> Claridenstrasse 25 8002 Zúrich, Suiza

#### Representante en Suiza

First Independent Fund Services AG Klausstrasse 33 8008 Zúrich, Suiza

El Folleto del Fondo con sus Suplementos, los Documentos de datos fundamentales para el inversor, los Estatutos, el Informe anual y semestral del Fondo y el listado de todas las transacciones llevadas a cabo por el Asesor de inversiones durante el ejercicio se encuentran disponibles de forma gratuita en las oficinas de los Agentes de pagos e información locales y el Representante en Suiza.

<sup>&</sup>lt;sup>1</sup> Consejeros independientes.

<sup>&</sup>lt;sup>2</sup> Consejero del Fondo empleado de Goldman Sachs Group, Inc. o de su filial directa o indirecta.

<sup>&</sup>lt;sup>3</sup> Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

<sup>&</sup>lt;sup>4</sup> Consulte la Nota 6 relativa a los Subasesores no afiliados.

#### Estimado/a accionista:

Adjuntamos el informe correspondiente al ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021.

#### Análisis del mercado<sup>1</sup>

Tras una acusada crisis debida a la pandemia de COVID-19, la economía mundial repuntó durante el período objeto de análisis. No obstante, las nuevas variantes del virus han sembrado dudas con respecto a la resistencia de la recuperación en algunas partes del mundo. En sus *Perspectivas de la Economía Mundial* de octubre de 2021, el Fondo Monetario Internacional ("FMI") declaró: "La recuperación mundial continúa, pero ha perdido ímpetu, obstaculizada por la pandemia. Impulsado por la sumamente contagiosa variante delta, el número de muertes por COVID-19 documentadas a escala mundial roza ya los 5 millones y abundan los riesgos para la salud, lo cual impide volver a la plena normalidad. Los brotes pandémicos en vínculos esenciales de las cadenas mundiales de suministro han provocado demoras imprevistas en el abastecimiento, estimulando todavía más la inflación en muchos países. En general, los riesgos para las perspectivas económicas han aumentado y las disyuntivas en materia de políticas son ahora más complejas". Desde una perspectiva regional, el FMI prevé que el PIB estadounidense crezca un 6,0 % en 2021, en comparación con la contracción del 3,4 % registrada en 2020. Por otra parte, el FMI prevé que el crecimiento del PIB en la zona euro, el Reino Unido y Japón en 2021 será del 5,0 %, 6,8 % y 2,4 %, respectivamente. A efectos de comparación, el PIB de estas economías fue del -6,3 %, -9,8 % y -4,6 %, respectivamente, en 2020.

A pesar de los periodos de volatilidad, la renta variable de los mercados desarrollados generó resultados favorables. El mercado se vio favorecido por el lanzamiento de la vacuna contra la COVID-19, unas políticas monetarias y fiscales contundentes y unos beneficios empresariales que, con frecuencia, superaron las expectativas. Aunque hubo periodos de debilidad, estos fueron breves y, en general, la demanda de renta variable por parte de los inversores fue sólida. Durante el ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021, el índice S&P 500 avanzó un 27,37 % y alcanzó varios nuevos máximos históricos antes de ceder parte de las ganancias a finales del período analizado. Al margen de EE. UU., la renta variable internacional de los países desarrollados arrojó una rentabilidad del 10,77 %, según el índice MSCI EAFE (dividendos netos). Por el contrario, la renta variable de los mercados emergentes, medida por el índice MSCI Emerging Markets (dividendos netos), generó un modesto rendimiento del 2,70 %.\*

Los mercados globales de renta fija generaron resultados mediocres durante el periodo objeto de análisis. Los bancos centrales de todo el mundo, entre ellos la Reserva Federal de Estados Unidos, el Banco Central Europeo, el Banco de Inglaterra y el Banco de Japón, mantuvieron en gran medida sus políticas monetarias acomodaticias. Sin embargo, hubo indicios de que en 2022 podría producirse un endurecimiento de las políticas. Con la mejora del crecimiento mundial y el aumento pronunciado de la inflación, los rendimientos del Tesoro estadounidense a corto y largo plazo subieron. Los rendimientos estatales a largo plazo en otros países desarrollados por lo general también aumentaron. Durante el ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021, los índices Bloomberg U.S Aggregate Bond Index y Bloomberg Global Aggregate Bond Index registraron un rendimiento del -1,15 % y del -3,29 %, respectivamente. Los valores de renta fija de mayor riesgo, por otra parte, arrojaron resultados heterogéneos. El mercado de bonos de alto rendimiento de EE. UU., medido por el índice Bloomberg U.S. Corporate High Yield — 2 % Issuer Cap, avanzó un 5,26 %, mientras que la clase de activos de deuda de mercados emergentes, medida por el índice JPMorgan EMBI Global, arrojó un rendimiento del -1,31 % durante el ejercicio finalizado el 30 de noviembre de 2021.\*

### B. Descripción general del rendimiento (a 30 de noviembre de 2021)<sup>2</sup>

		Fecha de	1 año	3 años	5 años	Desde su creación
	Divisa	lanzamiento	(%)	(%)	(%)	(%)
Asia Equity Portfolio (Clase de acciones denominada en la divisa de referencia)	USD	31-may-94	(6,29)	12,39	11,64	5,19
MSCI AC Asia ex Japan Index (Total Return Net)	USD	31-may-94	0,39	10,54	10,54	4,58
All China Equity Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	26-ago-09	(7,10)	14,08	13,57	7,32
MSCI China All Shares Index (Total Return Net)	USD	26-ago-09	(7,84)	9,80	11,65	6,09
Emerging Markets Equity ESG Portfolio (Clase de acciones de acumulación lenominada en la divisa de referencia)	USD	27-sep-18	4,75	15,54	_	12,51
MSCI Emerging Markets Index (Total Return Net)	USD	27-sep-18	2,70	9,26	_	6,90
Emerging Markets Equity Portfolio (Clase de acciones denominada en la divisa de referencia)	USD	15-dic-97	5,06	14,94	12,30	7,46
ISCI Emerging Markets Index (Total Return Net)	USD	15-dic-97	2,70	9,26	9,51	7,47
Global Environmental Impact Equity Portfolio (Clase de acciones de acumulación lenominada en la divisa de referencia)	USD	14-feb-20	22,26	_	_	34,27
//SCI ACWI (Total Return Net)	USD	14-feb-20	19,27	_	_	15,22
Global Equity Income Portfolio (Clase de acciones denominada en la divisa de referencia)	USD	4-dic-92	13,42	10,42	9,79	5,81
MSCI World Index (Total Return Net)	USD	4-dic-92	21,78	16,88	14,61	8,27
Global Equity Partners ESG Portfolio (Clase de acciones de acumulación	USD	16-sep-08	22,60	19,91	15,81	7,73
lenominada en la divisa de referencia)	USD	16-sep-08	21,78	16,88	14,61	8,90
/ISCI World Index (Total Return Net)  Slobal Equity Partners Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada		-				
en la divisa de referencia)	USD	23-feb-06	20,49	20,00	15,69	6,98
/ISCI World Index (Total Return Net)	USD	23-feb-06	21,78	16,88	14,61	7,72
Global Future Health Care Equity Portfolio (Clase de acciones de acumulación lenominada en la divisa de referencia)	USD	30-sep-20	11,87	_	_	17,80
ISCI ACWI Health Care Index (Total Return Net) (USD)	USD	30-sep-20	13,91	_	_	15,43
Blobal Future Technology Leaders Equity Portfolio (Clase de acciones de acumulación	USD	•				
lenominada en la divisa de referencia)  ASCI ACWI Select Information Technology + Communication Services + Internet & Direct		25-feb-20	23,23	_	_	44,73
farketing Retail Index (Total Return Net)	USD	25-feb-20	13,40			18,05
llobal Millennials Equity Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada n la divisa de referencia)	USD	19-sep-12	13,44	27,70	21,63	13,50
ISCI ACWI Growth Index (Total Return Net)	USD	19-sep-12	20,82	23,77	19,73	13,46
idia Equity Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	26-mar-08	41,26	18,07	15,07	8,97
ISCI India Investable Market Index (Total Return Net)	USD	26-mar-08	37,45	15,39	14,29	5,27
apan Equity Partners Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada n la divisa de referencia)	JPY JPY	27-may-15	13,72	16,98	15,34	10,55
OPIX (Total Return Net)  apan Equity Portfolio (Clase de acciones denominada en la divisa de referencia)	JPY	27-may-15 30-abr-96	11,85 <b>14,78</b>	7,07 <b>12,34</b>	7,62 <b>10,46</b>	4,25 3,10
OPIX (Total Return Net)	JPY	30-abr-96	11,85	7,07	7,62	1,81
S Equity Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	3-feb-06	26,04	18,99	15,61	8,82
&P 500 (Total Return Net)	USD	3-feb-06	27,37	19,73	17,24	9,97
S Focused Growth Equity Portfolio (Clase de acciones denominada en la divisa de referencia)	USD	15-nov-99	28,27	29,80	23,57	6,45
tussell 1000 Growth Index (Total Return Net)	USD	15-nov-99	30,41	28,80	24,66	7,58
IS Small Cap Equity Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en a divisa de referencia)	USD	15-jun-18	22,87	15,54	_	10,85
tussell 2000 Index (Total Return Net)	USD	15-jun-18	16,92	13,68	_	9,61
IS Technology Opportunities Equity Portfolio (Clase de acciones de acumulación lenominada en la divisa de referencia)	USD	30-oct-20	25,25	_	_	35,13
ASDAQ Composite Index (Total Return Net) (USD)	USD	30-oct-20	27,93	_	_	39,39
Blobal Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio (Clase de acciones de acumulación	USD	19-oct-21	_			(0,80)
lenominada en la divisa de referencia) <sup>3</sup>						
ISCI ACWI (Total Return Net)  Slobal Infrastructure Equity Portfolio (Clase de acciones de acumulación	USD	19-oct-21				(1,59)
enominada en la divisa de referencia)	USD	2-dic-16	8,19	9,32	_	7,37
ow Jones Brookfield Global Infrastructure Index (Total Return Net)	USD	2-dic-16	11,16	8,27		7,96
Hobal Real Estate Equity Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la ivisa de referencia)	USD	2-dic-16	18,51	2,68	_	3,10
TSE EPRA Nareit Developed Index (Total Return Net)	USD	2-dic-16	23,06	7,68	_	7,43
orth America Energy & Energy Infrastructure Equity Portfolio (Clase de acciones de	USD	14-abr-14	42,51	2,79	(0,34)	(4,67)
cumulación denominada en la divisa de referencia) 0 % Alerian Midstream Energy Select Index (Total Return Gross)/ 50 % Energy Select						
ector Index (Total Return Net)	USD	14-abr-14	47,14	2,08	(0,01)	(2,54)
merging Markets CORE® Equity Portfolio (Clase de acciones de acumulación al cierre enominada en la divisa de referencia)	USD	10-ago-09	4,56	8,64	8,98	5,78
SCI Emerging Markets Index (Total Return Net)	USD	10-ago-09	2,70	9,26	9,51	5,31
urope CORE® Equity Portfolio (Clase de acciones denominada en la divisa de referencia)	EUR	1-oct-99	23,83	10,32	8,17	4,81
SCI Europe Index (Total Return Net)	EUR	1-oct-99	21,39	10,92	8,56	26,72
urozone CORE® Equity Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada n la divisa de referencia)³	EUR	15-jul-21	_	_	_	1,90
SCI EMU Index (Total Return Net)	EUR	15-jul-21	_	_	_	0,88
lobal CORE® Equity Portfolio (Clase de acciones puntuales denominada en la divisa de referencia)	USD	14-oct-04	21,47	14,01	12,56	8,29
ISCI World Index (Total Return Net)	USD	14-oct-04	21,78	16,88	14,61	8,6
lobal Small Cap CORE® Equity Portfolio (Clase de acciones puntuales	USD	3-ago-06	23,33	12,16	10,76	7,3
enominada en la divisa de referencia) &P Developed SmallCap (Total Return Net)	USD	3-ago-06	18,34	13,33	11,61	7,80
S CORE® Equity Portfolio (Clase de acciones puntuales denominada en la divisa de referencia)	USD	3-ago-06 18-nov-96	27,49	18,01	15,92	7,80
S&P 500 (Total Return Net)	USD	18-nov-96	27,37	19,73	17,24	9,04

		F	Rendimient	o neto anual	izado medio	<b>)</b>
	Divisa	Fecha de lanzamiento	1 año (%)	3 años (%)	5 años (%)	Desde su creación (%)
US Small Cap CORE® Equity Portfolio (Clase de acciones puntuales de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	5-dic-05	27,55	12,56	10,64	7,86
Russell 2000 Index (Total Return Net)	USD	5-dic-05	21,68	13,79	11,72	8,57
Asia High Yield Bond Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	13-ago-20	(4,18)	_	_	(0,87)
ICE3 BofA Asian Dollar High Yield Corporate Sector & Issuer Constrained Index (Total Return Gross)	USD	13-ago-20	(3,25)			(0,12)
Emerging Markets Corporate Bond Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	17-may-11	0,66	6,57	4,81	5,06
J.P. Morgan Corporate Emerging Markets Bond Index Broad Diversified (Total Return Gross)	USD	17-may-11	1,98	7,03	5,43	5,17
Emerging Markets Debt Blend Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	8-may-13	(3,24)	4,67	3,85	0,54
50 % J.P. Morgan Government Bond Emerging Market Index Global Diversified (Total Return Gross) / 25 % J.P. Morgan Emerging Market Bond Index Global Diversified (Total Return Gross) / 25 % J.P. Morgan Corporate Emerging Markets Bond Index – Broad Diversified	USD	8-may-13	(3,38)	4,26	4,01	1,36
Emerging Markets Debt Local Portfolio (Clase de acciones denominada en la divisa de referencia)	USD	29-jun-07	(7,20)	1,44	1,87	0,64
J.P. Morgan Government Bond Index - Emerging Markets Global Diversified (Total Return Gross)	USD	29-jun-07	(7,02)	1,98	2,88	
Emerging Markets Debt Portfolio (Clase de acciones denominada en la divisa de referencia)	USD	3-may-00	(2,39)	5,27	3,30	8,06
J.P. Morgan Emerging Market Bond Index Global Diversified (Total Return Gross)	USD	3-may-00	(1,31)	5,92	4,58	8,13
ESG-Enhanced Emerging Markets Short Duration Bond Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia) LIBOR a 3 meses	USD USD	8-ene-19 8-ene-19	0,97	_	_	2,94
ESG-Enhanced Euro Short Duration Bond Plus Portfolio (Clase de acciones de acumulación			0,17			1,08
denominada en la divisa de referencia) Bloomberg Euro Aggregate 500mm 1-3 yrs (Total Return Gross)	EUR EUR	<b>15-ene-14</b> 15-ene-14	(0,97) (0,40)	<b>0,23</b> 0,13	<b>0,00</b> 0,02	<b>0,33</b> 0,35
ESG-Enhanced Europe High Yield Bond Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	EUR	17-jun-14	2,90	5,11	3,87	3,46
ICE BofA European Currency High Yield Constrained Index (Total Return Gross) (EUR - Hedged)	EUR	17-jun-14	3,31	5,31	4,25	3,96
ESG-Enhanced Global Income Bond Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	16-sep-20	0,47	_	_	3,37
Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return Gross) (USD Hedged) <sup>1</sup>	USD	16-sep-20	(0,69)			(0,11)
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio (Clase de acciones denominada en la divisa de referencia)	GBP	18-dic-08	(1,27)	5,88	4,01	6,41
Iboxx Sterling Non-Gilts Index (Total Return Gross)	GBP USD	18-dic-08 26-ene-06	(0,45) (0,92)	5,27 <b>8,03</b>	3,88 <b>5,17</b>	6,15 3,85
en la divisa de referencia) Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (Total Return Gross) (USD-Hedged)	USD	26-ene-06	(0,24)	6,94	4,97	4,91
Global Fixed Income Portfolio (Clase de acciones denominada en la divisa de referencia)	USD	26-feb-93	(4,53)	5,04	3,36	4,05
Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return Gross)	USD	26-feb-93	(3,29)	4,33	3,29	4,86
Global Fixed Income Portfolio (Hedged) (Clase de acciones denominada en la divisa de referencia)	EUR	17-dic-01	(3,33)	3,72	1,62	2,90
Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return Gross) (EUR-hedged)	EUR	17-dic-01	(1,51)	2,88	1,51	3,65
Global High Yield Portfolio (Clase de acciones denominada en la divisa de referencia)  Bloomberg US Corporate High Yield Bond Index – 2 % Issuer Cap (Total Return Gross)	USD USD	<b>27-ene-98</b> 27-ene-98	<b>2,98</b> 5,26	<b>6,00</b> 7,35	<b>4,81</b> 6,27	<b>5,60</b> 6,51
Global Sovereign Bond Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	22-may-15	(6,44)	3,37	3,14	1,52
60 % Bloomberg Emerging Market Local Currency Government (Cap) (Unhedged) (Total Return Gross) ex CNY / 40 % Bloomberg Global Treasury (Cap) (USD Hedged) (Total Return Gross)	USD	22-may-15	(5,03)	4,09	3,95	2,44
Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	4-abr-12	2,07	4,59	3,69	3,37
BofA Merrill Lynch USD LIBOR 1 Month Constant Maturity	USD	4-abr-12	0,10	1,09	1,23	0,75
US Dollar Short Duration Bond Portfolio (Clase de acciones de acumulación "P")	USD	6-jun-16	(0,63)	2,47	1,88	1,72
Bloomberg 1-3 Yr Government/Credit Bond Index (Total Return Gross)	USD	6-jun-16	(0,23)	2,59	1,90	1,73
US Fixed Income Portfolio (Clase de acciones denominada en la divisa de referencia)  Bloomberg US Aggregate Bond Index (Total Return Gross)	USD USD	<b>27-jul-98</b> 27-jul-98	<b>(2,16)</b> (1,15)	<b>5,41</b> 5,51	<b>3,16</b> 3,58	<b>3,93</b> 4,71
US Mortgage Backed Securities Portfolio (Clase de acciones denominada en la divisa de referencia)	USD	30-sep-02	(1,15)	3,57	2,12	3,40
Bloomberg US Securitised Index (Total Return Gross)	USD	30-sep-02	(0,70)	3,78	2,55	3,76
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	14-dic-17	(0,37)	8,01	-	2,42
30 % J.P. Morgan Government Bond Index - Emerging Markets Global Diversified (Total Return Gross) / 15 % J.P. Morgan Emerging Market Bond Index Global Diversified (Total Return Gross) / 15 % J.P. Morgan Corporate Emerging Markets Bond Index Broad Diversified	USD	14-dic-17	(0,87)	6,42	_	3,15
ESG-Enhanced Global Multi-Asset Balanced Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	30-jun-14	11,35	10,29	7,70	5,20
50 % Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return Gross) (USDHedged) / 50 % MSCI World Index (Total Return Net) (50 % USD Hedged)	USD	30-jun-14	10,60	11,17	9,39	7,06
Global Multi-Asset Conservative Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	30-jun-14	4,25	7,71	5,42	3,83
70 % Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return Gross) (USDHedged) / 30 % MSCI World Index (Total Return Net) (50 % USD Hedged)	USD	30-jun-14	5,98	8,64	6,95	5,61
Global Multi-Asset Growth Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	30-jun-14	15,34	11,32	9,00	6,02
30 % Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return Gross) (USD Hedged) / 70 % MSCI World Index (Total Return Net) (50 % USD Hedged)	USD	30-jun-14	15,36	13,63	11,52	8,35
Global Multi-Asset Income Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	18-mar-14	8,11	8,52	7,12	4,98
40 % ICE BofA US High Yield BB-B Constrained Index (USD Hedged) (Total Return Gross) / 40 % MSCI World Index (USD Hedged) (Total Return Net) / 20 % Bloomberg Global Aggregate – Corporate Index (USD Hedged) (Total Return Gross)	USD	18-mar-14	10,83	10,83	9,90	7,52

		F	Rendimient	o neto anual	izado medio	0
	Divisa	Fecha de lanzamiento	1 año (%)	3 años (%)	5 años (%)	Desde su creación (%)
US Real Estate Balanced Portfolio (Clase de acciones de acumulación)	USD	2-oct-12	13,88	10,76	8,03	7,55
Emerging Markets Total Return Bond Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	21-nov-17	0,83	5,47	_	2,81
LIBOR (USD) a 3 meses	USD	21-nov-17	0,17	1,14	_	1,42
Global Absolute Return Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	27-ago-15	5,17	3,29	1,86	1,21
LIBOR (USD) a 3 meses	USD	27-ago-15	0,17	1,14	1,38	1,23
Global Dynamic Bond Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	28-jun-06	(2,13)	2,02	1,58	1,31
LIBOR (USD) a 3 meses	USD	28-jun-06	0,17	1,14	1,38	1,39
Global Dynamic Bond Plus Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	28-mar-11	(3,57)	3,05	1,65	1,96
LIBOR (USD) a 3 meses	USD	28-mar-11	0,17	1,14	1,38	0,85
Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged) (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	EUR	25-ene-06	(3,51)	3,48	1,33	2,88
Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return Gross) (EUR-hedged)	EUR	25-ene-06	(1,51)	2,88	1,51	3,17
Global Strategic Macro Bond Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	22-oct-14	(3,59)	1,40	0,72	0,99
LIBOR (USD) a 3 meses	USD	22-oct-14	0,17	1,14	1,38	1,12
Strategic Absolute Return Bond II Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	28-jun-06	(5,04)	1,79	1,05	1,59
LIBOR (USD) a 3 meses	USD	28-jun-06	0,17	1,14	1,38	1,39
Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio (Clase de acciones denominada en la divisa de referencia)	USD	15-mar-06	21,88	16,07	13,68	8,63
MSCI World Index (Total Return Net)	USD	15-mar-06	21,78	16,88	14,61	7,64
Global Corporate Portfolio (Hedged) (Clase de acciones de acumulación "I")	NOK	31-dic-07	(1,11)	5,98	3,91	5,53
Bloomberg Global Aggregate Credit SRI Index (Total Return) (NOK Hedged)	NOK	31-dic-07	(0,42)	5,61	3,75	5,45
Absolute Return Tracker Portfolio (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia)	USD	13-ene-15	5,73	4,37	3,81	0,97
LIBOR (USD) a 3 meses	USD	13-ene-15	0,17	1,14	1,38	0,97
Alternative Trend Portfolio (Clase de acciones de acumulación "I")	USD	20-ene-15	5,13	4,85	3,64	0,75
LIBOR (USD) a 3 meses	USD	20-ene-15	0,17	1,14	1,38	0,83

Goldman Sachs Asset Management International

#### Diciembre de 2021

Todos los rendimientos de los índices se muestran con reinversión de ingresos y, a diferencia de las Clases de acciones, sin deducir gastos ni comisiones. Los rendimientos de las Clases de acciones se muestran netos de gastos y comisiones, y tras la reinversión de dividendos, cuando corresponda, usando los valores liquidativos de fin del mes. En el caso de las Clases de acciones cuya rentabilidad se compara con el índice, la utilización de dicho índice tiene una finalidad exclusivamente comparativa. La referencia a estos índices no implica que las Clases de acciones vayan a registrar un rendimiento, una volatilidad u otros resultados similares a los del índice.

La información contenida en este informe analiza la actividad general de los mercados, las tendencias industriales o sectoriales, u otras situaciones generales de índole económica, bursátil o política. Los puntos de vista, las opiniones y cualquier previsión económica y sobre el mercado expresados en este documento son válidos solo a partir de la fecha de esta publicación; y podrían variar. Este material no debería interpretarse como un análisis o un asesoramiento de inversión.

Aunque se ha obtenido cierta información de fuentes supuestamente fiables, no podemos garantizar su exactitud, exhaustividad o imparcialidad. Hemos tomado al pie de la letra y asumido sin una verificación independiente la exactitud y exhaustividad de toda la información disponible de fuentes públicas.

Las previsiones económicas y sobre el mercado que aquí se ofrecen tienen fines informativos a fecha de este informe. No se puede garantizar que se alcanzarán las previsiones.

Véase el apartado "Información adicional" de la página 671.

- <sup>2</sup> El rendimiento pasado no es garantía de futuros beneficios, los cuales pueden variar. Las rentabilidades se indican netas de gastos, incluidos los dividendos, cuando corresponda.
- <sup>3</sup> Rentabilidad neta acumulada.

<sup>\*</sup> Todas las rentabilidades se expresan en dólares estadounidenses.

¹ Cualquier referencia a una decisión de inversión solo pretende ilustrar nuestro enfoque o estrategia de inversión y no es indicativa del rendimiento de nuestra estrategia en su conjunto. Cualquiera de esos ejemplos no son necesariamente representativos de otras decisiones de inversión.



#### Informe de auditoría

A los accionistas de Goldman Sachs Funds

#### **Nuestro dictamen**

A nuestro juicio, los estados financieros adjuntos ofrecen una imagen fiel y objetiva de la situación financiera de Goldman Sachs Funds (el "Fondo") y de cada uno de sus subfondos a 30 de noviembre de 2021, así como de los resultados de sus operaciones y de las variaciones en su patrimonio neto correspondientes al ejercicio cerrado en dicha fecha, de conformidad con los requisitos legales y normativos de Luxemburgo en materia de elaboración y presentación de estados financieros.

#### Lo que hemos auditado

Los estados financieros del Fondo comprenden:

- el balance de situación a 30 de noviembre de 2021;
- el estado de las inversiones a 30 de noviembre de 2021;
- la cuenta de pérdidas y ganancias del ejercicio cerrado a dicha fecha;
- el estado de las variaciones patrimoniales del ejercicio cerrado a dicha fecha; y
- las notas sobre los estados financieros, que incluyen un resumen de las políticas contables significativas.

#### Criterios para el dictamen de auditoría

Hemos llevado a cabo nuestra auditoría de conformidad con la Ley de 23 de julio de 2016 sobre la profesión de la auditoría (Ley de 23 de julio de 2016) y con las normas internacionales de auditoría (NIA) adoptadas para Luxemburgo por la Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF). Nuestras responsabilidades previstas en la Ley de 23 de julio de 2016 y las NIA adoptadas para Luxemburgo por la CSSF se describen con más detalle en el apartado "Responsabilidades del Auditor autorizado en relación con la auditoría de los estados financieros" de nuestro informe.

Creemos que los datos de auditoría que hemos obtenido son suficientes y adecuados para poder formular nuestro dictamen.

Somos independientes del Fondo de conformidad con el Código Internacional de Ética para Profesionales de la Contabilidad, incluidas las Normas Internacionales de Independencia, emitido por el Consejo de Normas Internacionales de Ética para Contables (Código IESBA), adoptado en Luxemburgo por la CSSF, y de conformidad con los requisitos éticos pertinentes para llevar a cabo nuestra auditoría de los estados financieros. Hemos cumplido con nuestros otros deberes éticos de acuerdo con dichos requisitos éticos.

### Información adicional

El Consejo de Administración del Fondo es responsable de la información adicional. La información adicional comprende la información indicada en el informe anual, pero no contiene ni los estados financieros ni nuestro informe de auditoría.

Nuestro dictamen sobre los estados financieros no cubre la información adicional y no expresamos ninguna forma de conclusión de garantía en el mismo.



En relación con nuestra auditoría sobre los estados financieros, nuestra obligación es leer la información adicional identificada anteriormente y considerar si dicha información adicional difiere significativamente de los estados financieros o de nuestros conocimientos obtenidos en la auditoría, o si parece contener errores sustanciales de otro tipo. En caso de que, basándonos en el trabajo que hemos llevado a cabo, lleguemos a la conclusión de que la información adicional contiene errores sustanciales, estamos obligados a informar de tal hecho. En ese sentido, no tenemos nada de lo que informar.

# Responsabilidades del Consejo de Administración del Fondo en relación con los estados financieros

El Consejo de Administración del Fondo es responsable de la elaboración y presentación objetiva de los estados financieros con arreglo a los requisitos legales y normativos de Luxemburgo en materia de elaboración y presentación de estados financieros, así como de cuantos controles internos estime necesario implantar el Consejo de Administración del Fondo para permitir que los estados financieros se elaboren sin errores sustanciales, ya se deban a fraude o a equívoco.

A la hora de elaborar los estados financieros, el Consejo de Administración del Fondo es responsable de valorar la capacidad de continuidad del Fondo y de cada uno de sus subfondos, informando, si procede, de las cuestiones relacionadas con su capacidad para continuar. Además, usará el principio contable de empresa en funcionamiento, salvo que el Consejo de Administración del Fondo pretenda liquidar el Fondo, cerrar cualquiera de sus subfondos o cesar su actividad, o bien no exista otra alternativa más realista que proceder de una de estas formas.

#### Responsabilidades del Auditor autorizado en relación con la auditoría de los estados financieros

Los objetivos de nuestra auditoría son obtener una garantía razonable de que los estados financieros en su conjunto no incluyan errores sustanciales, ya se deban a fraude o a equívoco, y expedir un informe de auditoría con nuestro dictamen. Una garantía razonable representa un nivel elevado de garantía, aunque no garantiza que una auditoría llevada a cabo de conformidad con la Ley de 23 de julio de 2016 y con las NIA adoptadas para Luxemburgo por la CSSF siempre detecte los errores sustanciales en caso de haberlos. Los errores pueden deberse a fraude o a equívoco, y se consideran sustanciales si, ya sea individualmente o en conjunto, se espera razonablemente que puedan influir en las decisiones financieras tomadas por los usuarios basándose en estos estados financieros.

En el marco de una auditoría de conformidad con la Ley de 23 de julio de 2016 y las NIA adoptadas para Luxemburgo por la CSSF, ejercemos nuestro juicio profesional y adoptamos un escepticismo profesional durante toda la auditoría. Asimismo:

- identificamos y valoramos el riesgo de que existan errores sustanciales en los estados financieros, ya se deban a fraude o a equívoco; diseñamos y llevamos a cabo procedimientos de auditoría en respuesta a esos riesgos, y obtenemos datos de auditoría suficientes y adecuados para poder formular un dictamen de auditoría. El riesgo de no detectar un error sustancial debido a fraude es mayor que el riesgo de no detectar un error debido a equívoco, ya que el fraude puede implicar colusión, falsificación, omisión deliberada, información falsa o la invalidación de los controles internos;
- nos familiarizamos con los controles internos pertinentes para la auditoría con vistas a diseñar procedimientos de auditoría adecuados a las circunstancias, pero no para expresar una opinión sobre la eficacia de dichos controles del Fondo;
- evaluamos la idoneidad de las políticas contables empleadas, determinando hasta qué punto las estimaciones contables e informaciones relacionadas elaboradas por el Consejo de Administración del Fondo son razonables;



- extraemos conclusiones sobre la idoneidad del uso que el Consejo de Administración del Fondo hace del principio contable de empresa en funcionamiento y, basándonos en los datos de auditoría obtenidos, sobre si existen incertidumbres sustanciales relacionadas con sucesos o condiciones que puedan generar dudas significativas sobre la capacidad de continuidad del Fondo o de cada uno de sus subfondos. Si concluimos que existen incertidumbres sustanciales, estamos obligados a señalar en nuestro informe de auditoría las informaciones relacionadas contenidas en los estados financieros o, si dichas informaciones son inadecuadas, a modificar nuestro dictamen. Nuestras conclusiones están basadas en los datos de auditoría obtenidos hasta la fecha de elaboración de nuestro informe de auditoría. Sin embargo, sucesos y condiciones en el futuro pueden impedir la continuidad del Fondo o de cualquiera de sus subfondos (excepto en lo que se refiere a Goldman Sachs Emerging Markets Multi-Asset Portfolio, que pretende liquidarse);
- evaluamos la presentación general, la estructura y el contenido de los estados financieros, incluidas las informaciones, y si los estados financieros representan o no las transacciones y los eventos subyacentes de forma tal que conformen una presentación objetiva.

Nos comunicamos con los encargados de la gobernanza en lo relativo, entre otros asuntos, al alcance y al calendario previstos de la auditoría, así como a las conclusiones significativas de la auditoría, que incluyen las deficiencias relevantes en los controles internos identificadas durante nuestra auditoría.

#### **Otros asuntos**

Además de nuestra obligación de auditar los estados financieros y emitir el dictamen correspondiente de conformidad con la Ley de 23 de julio de 2016 y las NIA adoptadas para Luxemburgo por la CSSF, el Consejo de Administración del Fondo nos ha solicitado que emitamos un dictamen sobre los estados financieros con arreglo a las normas de auditoría generalmente aceptadas en los Estados Unidos de América, publicadas por el AICPA, con el fin de cumplir los requisitos impuestos por la Norma 206(4)-2 de la Ley de Asesores de Inversiones de 1940 de Estados Unidos. Informamos por separado a este respecto en la página 10.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative Representada por

Firmado electrónicamente por:

John Parkhouse

Luxemburgo, 17 de marzo de 2022



### Informe del Auditor independiente

A los accionistas de Goldman Sachs Funds

Hemos auditado los estados financieros adjuntos de Goldman Sachs Funds y de cada uno de sus subfondos, (el "Fondo"), los cuales comprenden el balance de situación y el estado de las inversiones a 30 de noviembre de 2021, así como la correspondiente cuenta de pérdidas y ganancias y el estado de variaciones patrimoniales para el ejercicio cerrado en esa fecha.

# Responsabilidad del Consejo de Administración del Fondo en relación con los estados financieros

El Consejo de Administración del Fondo es responsable de la elaboración y presentación objetiva de los estados financieros con arreglo a los requisitos legales y normativos de Luxemburgo en materia de elaboración y presentación de estados financieros. Esto incluye diseñar, adoptar y mantener los controles internos pertinentes para la elaboración y presentación objetiva de los estados financieros sin errores sustanciales, ya se deban a fraude o a equívoco.

### Responsabilidad del Auditor

Nuestra responsabilidad consiste en expresar un dictamen sobre dichos estados financieros basada en nuestra auditoría. Hemos llevado a cabo nuestra auditoría de conformidad con las normas de auditoría generalmente aceptadas en los Estados Unidos de América. Dichas normas exigen la planificación y ejecución de una auditoría para obtener una garantía razonable de que los estados financieros no incluyen ningún error sustancial.

Toda auditoría consiste en aplicar determinados procedimientos con el fin de obtener evidencias contables sobre los importes e informaciones contenidas en los estados financieros. Los procedimientos seleccionados dependen de nuestro juicio e incluyen la evaluación de los riesgos de errores sustanciales en los estados financieros, ya se deban a fraude o a equívoco. A la hora de realizar dichas evaluaciones, examinamos los controles internos pertinentes para la elaboración y presentación objetiva de los estados financieros del Fondo de la entidad, con vistas a diseñar procedimientos de auditoría adecuados a las circunstancias, pero no para expresar una opinión sobre la eficacia de dichos controles del Fondo. Por este motivo, no expresamos ninguna opinión al respecto. La auditoría también incluye una evaluación de la idoneidad de las políticas contables empleadas, determinando hasta qué punto las estimaciones contables elaboradas por el Consejo de Administración del Fondo son razonables, además de evaluar la presentación general de los estados financieros. Creemos que los datos de auditoría que hemos obtenido son suficientes y adecuados para poder formular nuestro dictamen de auditoría.



#### Dictamen

A nuestro juicio, los estados financieros mencionados anteriormente reflejan fielmente, en todos los aspectos esenciales, la situación financiera de Goldman Sachs Funds y de cada uno de sus subfondos a 30 de noviembre de 2021, así como los resultados de sus operaciones y los cambios en su patrimonio neto durante el ejercicio cerrado en esa fecha, de conformidad con los requisitos legales y normativos relacionados con la elaboración y presentación de los estados financieros.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative Representada por Firmado electrónicamente por: John Parkhouse

Luxemburgo, 17 de marzo de 2022

John Parkhouse

	Notas	Asia Equity Portfolio USD	All China Equity Portfolio <sup>(a)</sup> USD	Emerging Markets Equity ESG Portfolio USD	Emerging Markets Equity Portfolio USD	Global Environmental Impact Equity Portfolio USD	Global Equity Income Portfolio USD	Global Equity Partners ESG Portfolio USD	Global Equity Partners Portfolio USD	Global Future Health Care Equity Portfolio USD	Global Future Technology Leaders Equity Portfolio USD
Activo Inversiones, al valor razonable, excluyendo derivados Plusvalía latente de contratos a plazo sobre bonos no entregables Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos	3(d) 3(d)	230.718.087	62.003.885 —	694.820.030 —	5.143.639.904 —	1.345.584.424	27.130.591 —	72.600.175 —	1.735.484.433	327.567.068 —	5.532.004.102 —
de una clase de acciones Plusvalía latente sobre futuros y futuros de clases de acciones de cobertura de duración Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras	3(d) 3(d)	_	=	162.150	=	=	=	_	1.688.953	_	=
en clases de acciones de cobertura de duración Cantidades pagadas anticipadamente por transacciones con permutas financieras	3(d) 3(d)	=	_	_	_	_	_	_	_	_	=
Valor de mercado de opciones compradas Tesorería Importes por cobrar de intermediarios	3(d) 3(e) 3(f),13	8.780.307 1.791.615	61.649	13.757.011 2.730.386	52.140.519	16.784.739	95.424	60.348	5.055.908	5.280.343	84.983.835
Importes por cobrar de intermedianos Importes por cobrar por venta de inversiones	3(1), 13		07.740		0.500.005						
Importes por cobrar por venta de acciones Dividendos por cobrar excepto contratos de permutas financieras y contratos por diferencia Dividendos por cobrar por contratos de permutas financieras	3(b) 3(b)	49.792 18.849 40.905	97.740 507 13.038	626.581 119.615.906 130.832	6.590.025 11.308.945 1.567.868	19.316.030 616.557	43.509 —	446.904 36.273	10.756.435 1.082.144	509.756 54.003	34.743.674 2.576.368
Intereses por cobrar (excepto contratos de permutas financieras) Intereses por cobrar por contratos de permutas financieras	3(b) 3(b)	_	_	_	_	_	_	_	_	_	_
Devolución de impuestos por dividendos por cobrar	5 5	_	_	4.974	58.167	124.273	5.022	5.695	335.308	_	_
Devolución de impuestos por intereses por cobrar	5		_	_	<u> </u>	_	_	_	450	_	_
Intereses por cobrar por préstamos de valores Comisiones del Asesor de inversiones renunciadas por cobrar	6 6	2.911 12.458	21.075	_	54.940 9	_	44.157	26.973	158	_	_
Otros activos		_	_		F 04F 000 077	4 000 400 000	_	7.831	4 754 400 000	29.158	
Total activos Pasivo		241.414.924	62.197.894	831.847.870	5.215.360.377	1.382.426.023	27.318.704	73.184.199	1.754.403.339	333.440.328	5.654.307.979
Descubierto bancario		_	73	_	890	_	_	_	_	_	998
Importe por pagar a intermediarios Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos	3(f),13	_	_	_	_	_	_	_	600.000	_	395
de una clase de acciones Minusvalla latente sobre futuros y futuros de clases de acciones de cobertura de describado Minusvalla latente sobre contratos de permutas financieras y contratos de	3(d) 3(d)	114 553.749	=	=	=	=	=	=	299.340 —	=	=
en clases de acciones de cobertura de duración	3(d)	_	_	_	_	_	_	_	_	_	_
Cantidades percibidas anticipadamente por transacciones con permutas financieras Valor de mercado de opciones suscritas	3(d) 3(d)		_	_	_	_	_	_			_
Valor de mercado de títulos con garantía hipotecaria a plazo cubiertos	3(d)	_	_	_	_	_	_	_	_	_	_
Importes por pagar por compra de inversiones Importes por pagar por reembolso de acciones		124.897 112.085	49.053	78.805.011 90.475	8.997.210 6.107.517	14.490.136 1.503.657	7.287	39.577	957.729	287.722 514.522	33.452.145 1.008
Intereses por pagar por contratos de permutas financieras	3(b)	112.003	49.055	90.473	0.107.517	1.505.057	7.207	39.577	937.729	514.522	1.000
Intereses por pagar (excepto contratos de permutas financieras)	3(b)	_	_	_	44.724	_	_	_	_	_	_
Dividendos por pagar por contratos de permutas financieras Comisiones por pagar por préstamos de valores	3(b) 6	_	_	_	_	_	_	_	_	_	_
Repartos por pagar	8	-			2.805.831		84				
Comisión del Asesor de inversiones por pagar Comisiones de rentabilidad por pagar	6	162.485	43.304	460.132	4.046.543	709.792	27.666	56.124	901.990	258.041	490.683
Comisión de administración por pagar	6	39.305	17.387	62.727	253.560	96.738	16.821	18.527	130.533	43.657	240.531
Comisión de depositario por pagar Comisiones de distribución y servicio por pagar	6 6	55.428 9.338	25.084	108.046 194	975.984 73.058	84.073 49.362	10.161 477	13.595 2.788	73.909 5.666	26.080 608	323.938 1.535
Comisión del Agente de transferencias por pagar	6	23.645	11.470	19.423	173.273	39.120	11.887	13.284	41.917	21.400	22.708
Taxe d'abonnement pagadera Impuesto sobre incrementos patrimoniales por pagar	5 5	11.354 1.571.993	3.465	19.994 1.521.905	179.188 32.345.283	50.120	2.038	3.927	77.689	16.258	103.402
Honorarios de auditoría por pagar	5	1.571.993	17.071	1.521.905	24.923	12.037	12.037	12.038	12.037	12.029	12.037
Comisiones de la Sociedad Gestora por pagar	6	4.460	1.105	7.802	81.775	18.669	668	1.418	31.128	5.617	50.131
Comisiones por pagar a los miembros del Consejo de Administración Honorarios de abogados por pagar	6	528 13.562	213 13.950	671 17.630	10.345 116.986	1.152 11.531	46 13.605	88 13.922	2.490 27.677	494	8.806 32.722
Primas de seguro por pagar		662	400	172	7.463	156	369	203	3.438	277	1.402
Gastos de imprenta por pagar Gastos de edición por pagar		7.919 597	4.560 357	5.502 557	67.831 1.075	14.175 756	3.306 438	3.272 478	19.581 1.394	8.994 477	30.894 557
Gastos por pagar por retención en origen de dividendos e ingresos por intereses	5	3.764	_	11.668	68.029	155.429	7.261	3.553	141.348	16.067	474.345
Gastos de declaraciones tributarias por pagar Comisiones del Agente de pagos por pagar		23.327 13.724	18.388 13.602	21.151 14.087	28.444 18.570	23.938 13.852	50.557 13.577	20.541 13.580	14.044	20.780 13.590	21.605 13.667
Gastos de comunicaciones reglamentarias por pagar		11.898	10.937	6.910	18.167	11.809	11.257	11.417	15.101	11.418	11.738
Otros pasivos		25.393 2.787.297	10.035	25.597	115.814	7.736 <b>17.294.238</b>	6.051 <b>195.593</b>	12.307 <b>240.639</b>	8.654	6.977	22.157 35.317.404
Total pasivos Patrimonio		238.627.627	240.454 61.957.440	81.211.691 750.636.179	56.562.483 5.158.797.894	1.365.131.785	27.123.111	72.943.560	3.365.665 1.751.037.674	1.265.008 332.175.320	5.618.990.575
Ajuste por dilución	3(k)	_	_	1.576.336	_	_	_	_	_	_	_
Patrimonio (después del ajuste por dilución)	` '	238.627.627	61.957.440	752.212.515	5.158.797.894	1.365.131.785	27.123.111	72.943.560	1.751.037.674	332.175.320	5.618.990.575

<sup>(</sup>a) Consulte el Anexo III (sin auditar).

	Global llennials Equity Portfolio USD	India Equity Portfolio USD	Japan Equity Partners Portfolio <sup>(b)(c)</sup> JPY	Japan Equity Portfolio <sup>(b)(c)</sup> JPY	US Equity Portfolio USD	US Focused Growth Equity Portfolio USD	US Small Cap Equity Portfolio <sup>(a)</sup> USD	US Technology Opportunities Equity Portfolio USD	Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio <sup>(a)</sup> USD	Global Infrastructure Equity Portfolio USD
Plusvalía latente de contratos à plazo sobre bonos no entregables 3(d)	7.745.114	2.352.066.437	310.462.006	185.680.945	876.487.494	49.961.685	80.415.880	482.024.934	4.939.006	43.142.731
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones 3(d) Plusvalía latente sobre futuros y futuros de clases de acciones de cobertura de duración Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras	=	Ξ	49.880 —	12.341	1.944.985	Ξ	10.523	Ξ	Ξ	Ξ
en clases de acciones de cobertura de duración 3(d) Cantidades pagadas anticipadamente por transacciones con permutas financieras 3(d) Valor de mercado de opciones compradas 3(d)	=	=		=	=	=	=	=	=	=
Tesorería 3(e) Importes por cobrar de intermediarios 3(f),13 Importes por cobrar por venta de inversiones Importes por cobrar por venta de acciones 14.	307.773 — - - - - 	40.380.655 1.807.166 — 3.926.292	4.869.928 678.953 1.154.807 1.344.828	2.144.000 379.817 1.421.684 432.137	13.023.699 — — 544.587	55.567 — — 132.424	82.465 — — 135.635	3.296.600 — 3.561.778	41.672 — —	55.788 — 48.035 556.396
	987.650	467.236 —	906.365	797.840	915.650 —	3.758	47.733 —	176.528	5.671	75.548 —
Intereses por cobrar por contratos de permutas financieras 3(b) Devolución de impuestos por dividendos por cobrar 5 Devolución de impuestos por intereses por cobrar 5	8.740	=	=	=	=	=	=	=	=	838
Intereses por cobrar por préstamos de valores 6 Comisiones del Asesor de inversiones renunciadas por cobrar 6 Otros activos Total activos 2.893.	11.116  3.520.820	6.403 2.398.654.189	319.466.767	190.868.764	892.916.422	8.375 <b>50.161.809</b>	80.693.087	489.059.840	39.623 5.025.972	13.033 43.892.369
Pasivo				130.000.704	032.310.422	30.101.003	00.033.007	+03.003.040	0.020.372	40.002.000
Descubierto bancario Importe por pagar a intermediarios 3(f),13 Minusvalla latente sobre contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos	293 —	1.300.842	251 280.000	5.000	Ξ	Ξ	Ξ	=	=	Ξ
de una clase de acciones 3(d) Minusvalía latente sobre futuros y futuros de clases de acciones de cobertura de duración 3(d) Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras	=	666.908	1.160.367	488.122 —	56.044 —	Ξ	570 —	=	=	=
en clases de acciones de cobertura de duración 3(d) Cantidades percibidas anticipadamente por transacciones con permutas financieras 3(d)	_	=	=	=	=		=	=	=	=
Valor de mercado de opciones suscritas 3(d) Valor de mercado de títulos con garantía hipotecaria a plazo cubiertos 3(d)	_	=	_	_	_	_	=	=	=	_
Importes por pagar por compra de inversiones	_	_	1.214.791	693.455	1.287.348	_	_	_	_	575.496
Intereses por pagar por contratos de permutas financieras 3(b)	5.691.807	6.608.062	502.801	146.511 —	1.022.057	104.691	=	14.027	=	28.740
Intereses por pagar (excepto contratos de permutas financieras) 3(b)  Dividendos por pagar por contratos de permutas financieras 3(b)	_	=	=	=	_	_	=	=	=	_
Comisiones por pagar por préstamos de valores 6 É Repartos por pagar 8	_	_	121	1.433	=	_	=	_	34	1.300
Comisión del Asesor de inversiones por pagar 6 2. Comisiones de rentabilidad por pagar 6	2.341.945	2.216.433	190.055	118.632	968.660	55.175	53.566	41.059	3.188	41.583
Comisión de administración por pagar 6	160.732 157.670	96.570 493.406	17.139	14.320 12.634	98.530	17.675	19.319	52.971	5.562	22.642 21.746
Comisión de depositario por pagar 6 Comisiones de distribución y servicio por pagar 6	177.360	75.641	16.525	5.860	38.669 11.178	7.279 7.417	12.416 385	29.471 8	159 7	8.124
Comisión del Agente de transferencias por pagar 6 Taxe d'abonnement pagadera 5	137.539 135.423	112.532 111.522	6.626 9.554	6.311 5.305	38.095 67.440	16.313 601	13.164 5.684	11.571 8.475	400 95	23.359 2.964
Impuesto sobre incrementos patrimoniales por pagar Honorarios de auditoría por pagar 5	13.088	5.524.494 51.519	1.335	1.335	12.037	12.037	12.037	12.029	11.766	12.038
Comisiones de la Sociedad Gestora por pagar 6 Comisiones por pagar a los miembros del Consejo de Administración 6	56.013 4.622	49.655 10.523	3.757 466	2.237 312	28.427 1.679	1.464 83	2.365 132	4.061 661	45 16	923 43
Honorarios de abogados por pagar	105.032	42.682 5.004	3.840 400	3.260 446	23.877 1.784	13.846 273	14.070 385	5.881 4.742	985 17	13.689
Primas de seguro por pagar Gastos de imprenta por pagar	1.636 35. <u>1</u> 35	28.811	2.935	1.883	10.640	4.054	3.714	4.074	573	224 3.219
Gastos de edición por pagar Gastos por pagar por retención en origen de dividendos e ingresos por intereses 5	796 145.003	796 94.273	111 138.810	124 122.189	875 244.772	477 1.106	477 14.299	478 52.895	520 1.300	956 20.371
Gastos de declaraciones tributarias por pagar Comisiones del Agente de pagos por pagar	27.336 14.988	17.820	37 1.600	6.229 1.675	27.705 13.799	20.541 13.677	20.541 13.684	20.541 13.491	27.767 2.107	28.073 13.597
Gastos de comunicaciones reglamentarias por pagar Otros pasivos	11.422 33.870	6.542 45.729	1.393 1.949	1.644 2.056	13.019 8.793	11.417 5.885	11.417 5.053	11.417 3.123	4.680 1.239	13.340 6.879
Total pasivos 9.	.251.710	17.559.764	3.554.863	1.640.973	3.975.428	294.011	203.278	290.975	60.460	839.306
Patrimonio 2.884. Ajuste por dilución 3(k)	1.269.110	2.381.094.425	315.911.904	189.227.791	888.940.994	49.867.798	80.489.809	488.768.865	4.965.512	43.053.063
	1.269.110	2.381.094.425	315.911.904	189.227.791	888.940.994	49.867.798	80.489.809	488.768.865	4.965.512	43.053.063

<sup>(</sup>a) Consulte el Anexo III (sin auditar).

<sup>(</sup>b) Expresado en miles.

<sup>(</sup>c) Consulte la Nota 3 (i).

	Notas	Global Real Estate Equity Portfolio USD	North America Energy & Energy Infrastructure Equity Portfolio USD	Emerging Markets CORE® Equity Portfolio <sup>(c)</sup> USD	Europe CORE® Equity Portfolio EUR	Eurozone CORE® Equity Portfolio <sup>(a)</sup> EUR	Global CORE® Equity Portfolio <sup>(c)</sup> USD	Global Small Cap CORE® Equity Portfolio <sup>(c)</sup> USD	US CORE® Equity Portfolio <sup>(c)</sup> USD	US Small Cap CORE® Equity Portfolio <sup>(c)</sup> USD	Asia High Yield Bond Portfolio USD
Activo Inversiones, al valor razonable, excluyendo derivados Plusvalía latente de contratos a plazo sobre bonos no entregables	3(d) 3(d)	43.042.072	54.124.367	2.796.203.461	1.701.199.865	4.053.296	4.159.967.930	707.401.660	1.974.076.905	187.938.974	389.386.317
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones Plusvalía latente sobre futuros y futuros de clases de acciones de cobertura de duración Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras	3(d) 3(d)	Ξ	Ξ	10.099	321.120 6.076	=	277.534 2.904.942	1.028	633.261	Ξ	418.807 277.032
en clases de acciones de cobertura de duración Cantidades pagadas anticipadamente por transacciones con permutas financieras Valor de mercado de opciones compradas	3(d) 3(d) 3(d)	Ξ	Ξ	Ξ	Ξ	Ξ	Ξ	Ξ	Ξ	Ξ	Ξ
Valor de l'interado de optionies compandas Tesorería Importes por cobrar de intermediarios Importes por cobrar por venta de inversiones	3(e) 3(f),13	108.398 — 145	177.170	47.751.034 5.309.395	40.999.740 1.838.600 2.279.358	66.779 6.512 10.402	104.173.217 1.745.650	17.296.740 36.576 16.155.724	13.285.797 680.503	2.888.520 297.977 249.081	8.441.387 362.479
Importes por cobrar por venta de acciones Dividendos por cobrar excepto contratos de permutas financieras y contratos por diferencia Dividendos por cobrar por contratos de permutas financieras	3(b) 3(b)	77.252 102.341	220.366 244.929 —	3.429.986 2.273.761	3.131.667 2.249.115	3.100	9.612.647 7.162.021	208.205 1.546.893	9.241.597 2.056.759	251.176 235.890	1.644.102 1.740
Intereses por cobrar (excepto contratos de permutas financieras) Intereses por cobrar por contratos de permutas financieras Devolución de impuestos por dividendos por cobrar	3(b) 3(b) 5	1.998	83.856	<u> </u>	5.011.733	<u></u>	1.962.906	 155.812	2.946	=	5.879.363
Devolución de impuestos por intereses por cobrar Intereses por cobrar por préstamos de valores Comisiones del Asesor de inversiones renunciadas por cobrar Otros activos	6 6	18.581	9.732	5.385	4.887	21.441	27.014	2.454	8.212	Ξ	4.229 — — 28.870
Total activos		43.350.787	54.860.420	2.855.728.117	1.757.042.161	4.161.906	4.287.833.861	742.805.092	1.999.985.980	191.861.618	406.444.326
Pasivo Descubierto bancario Importe por pagar a intermediarios Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos	3(f),13	Ξ	Ξ	6.016	Ξ	Ξ	1.255	=	Ξ	Ξ	Ξ
de una clase de acciones Minusvalla latente sobre futuros y futuros de clases de acciones de cobertura de duración Minusvalla latente sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras y	3(d) 3(d)	Ξ	Ξ	480 2.234.800	2.437.888 115.253	1.049	61.784 463.911	5.631 6.142	7.598 39.390	181.007	76.245 11.625
en clases de acciones de cobertura de duración Cantidades percibidas anticipadamente por transacciones con permutas financieras Valor de mercado de opciones suscritas	3(d) 3(d) 3(d)	=	Ξ	=	=	=	=	=	=	=	=
Valor de mercado de tífulos con garantía hipotecaria a plazo cubiertos Importes por pagar por compra de inversiones Importes por pagar por reembolso de acciones	3(d)	 107.149	97.092	<u> </u>	2.279.358 4.580.922	_	1.976.509	2.237.214 24.918.650	3.750.092	<u> </u>	2.755.097 1.082.240
Intereses por pagar por contratos de permutas financieras Intereses por pagar (excepto contratos de permutas financieras) Dividendos por pagar por contratos de permutas financieras	3(b) 3(b) 3(b)	=		=	=	=	=		=		=
Comisiones por pagar por préstamos de valores Repartos por pagar Comisión del Asesor de inversiones por pagar	8	92.927 37.786	371 63.965	1.474.558	840.542	1.582	76 1.317.365	357.525	1.063.209	2.051  50.497	434.127 220.408
Comisiones de rentabilidad por pagar Comisión de administración por pagar Comisión de depositario por pagar Comisiones de distribución y servicio por pagar	6 6	20.962 15.915 172	16.944 15.119 6.267	174.746 663.410 516	100.092 143.161 61.991	9.035 504 4	227.783 201.358 108.515	78.210 74.456 13.378	133.978 78.215 83.126	32.139 27.882 4.832	53.037 28.067 281
Comisión del Agente de transferencias por pagar Taxe d'abonnement pagadera Impuesto sobre incrementos patrimoniales por pagar	6 5 5	23.846 1.970	15.069 4.282 —	72.886 76.591 967.000	61.907 60.437	14.061 74 —	86.311 109.664 —	35.158 28.107	51.399 69.638	20.601 6.091	25.605 13.360 —
Honorarios de auditoría por pagar Comisiones de la Sociedad Gestora por pagar Comisiones por pagar a los miembros del Consejo de Administración Honorarios de abogados por pagar	6 6	12.037 693 85 13.209	12.037 1.460 103 12.455	18.121 37.094 6.276 100.616	11.258 25.577 3.745 82.043	10.355 35 3 3.462	13.088 50.479 7.873 122.541	17.070 13.244 1.453 20.621	18.121 30.629 3.575 104.811	12.038 2.569 480 14.600	17.062 5.403 299
Primas de seguro por pagar Gastos de imprenta por pagar Gastos de edición por pagar		380 2.929 956	543 4.597 438	4.927 26.493 995	6.213 22.395 1.027	63 2.317 654	7.074 33.730 1.632	1.230 10.387 836	3.179 17.737 796	1.090 6.807 517	1.636 2.039 836
Gastos por pagar por retención en origen de dividendos e ingresos por intereses Gastos de declaraciones tributarias por pagar Comisiones del Agente de pagos por pagar Gastos de comunicaciones reglamentarias por pagar	5	15.415 28.076 13.590 13.340 6.984	68.653 19.692 13.618 11.257 5.570	278.660 27.890 17.289 16.193 71.909	58.584 24.939 13.393 9.866 32.260	232 16.759 3.979 566 11.240	1.442.482 30.477 14.785 18.807 40.531	315.729 27.521 14.484 16.209 19.258	616.673 27.335 14.489 16.477 17.510	66.332 21.390 14.403 11.578 7.941	26.725 13.537 17.662
Otros pasivos Total pasivos		408.421	369.532	11.426.195	10.972.851	75.974	6.338.030	28.212.515	6.147.977	1.083.539	4.296 <b>4.789.587</b>
Patrimonio		42.942.366	54.490.888	2.844.301.922	1.746.069.310	4.085.932	4.281.495.831	714.592.577	1.993.838.003	190.778.079	401.654.739
Ajuste por dilución	3(k)	_	_		_	_	_		(397.377)	_	_
Patrimonio (después del ajuste por dilución)		42.942.366	54.490.888	2.844.301.922	1.746.069.310	4.085.932	4.281.495.831	714.592.577	1.993.440.626	190.778.079	401.654.739
(a) Consulte el Anexo III (sin auditar)											

<sup>(</sup>a) Consulte el Anexo III (sin auditar).

<sup>(</sup>c) Consulte la Nota 3 (i).

	Notas	Emerging Markets Corporate Bond Portfolio USD	Emerging Markets Debt Blend Portfolio USD	Emerging Markets Debt Local Portfolio USD	Emerging Markets Debt Portfolio USD	Markets Short Duration Bond	Euro Short	ESG-Enhanced Europe High Yield Bond Portfolio <sup>(a)</sup> EUR	ESG-Enhanced Global Income Bond Portfolio <sup>(a)</sup> USD		Global Credit Portfolio (Hedged) USD
Activo Inversiones, al valor razonable, excluyendo derivados Plusvalía latente de contratos a plazo sobre bonos no entregables Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos	3(d) 3(d)	4.031.895.732	621.908.846 12.709	1.485.990.849 39.875	4.369.126.353	50.052.637	401.253.764	104.018.477	43.736.726	27.195.722	1.468.834.464
de una clase de acciones Plusvalla latente sobre futuros y futuros de clases de acciones de cobertura de duración Plusvalla latente sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras	3(d) 3(d)	14.397.991 7.720.877	12.592.049 837.371	42.124.621 832.545	60.137.644 16.073.480	168.419 37.754	701.818 470.586	207.374	142.630 67.971	4.801 62.577	10.525.364 7.226.443
en clases de acciones de cobertura de duración Cantidades pagadas anticipadamente por transacciones con permutas financieras Valor de mercado de opciones compradas	3(d) 3(d) 3(d)	2.440.603 3.564.573	5.321.222 1.998.870 976.865	20.664.500 5.203.103 3.088.185	27.860.491 15.090.123 4.406.038	ΞΞ	411.806 775.762	9.027 36.925	57.190 196.897	118.413 192.500 4.445	5.099.448 11.192.449 257.735
Tesorería Importes por cobrar de intermediarios Importes por cobrar por venta de inversiones Importes por cobrar por venta de acciones	3(e) 3(f),13	65.727.349 84.180.587 6.729.731 71.078.952	11.715.901 22.127.982 766.412	31.258.512 44.024.204 — 9.224.988	66.767.895 182.127.335 2.729.688 3.119.623	272.374 518.845 713.918 55.755	10.612.143 483.420 — 1.617.418	1.714.499 245.478 327.025 25.618	642.528 116.928 — 957.278	461.239 428.181 — 15.700	23.457.998 16.700.742 306.981 841.171
Dividendos por cobrár excepto contratos de permutas financieras y contratos por diferencia Dividendos por cobrar por contratos de permutas financieras Intereses por cobrar (excepto contratos de permutas financieras)	3(b) 3(b) 3(b) 3(b)	10.397 — 48.311.471	3.2 <u>40</u> 8.352.578	5.460 — 23.150.422	15.225 — 61.157.010	115  584.746	2.104.400	1.245.755	42 — 512.853	<u> </u>	6.553 10.809.053
Intereses por cobrar por contratos de permutas financieras Devolución de impuestos por dividendos por cobrar Devolución de impuestos por intereses por cobrar Intereses por cobrar por préstamos de valores	3(b) 5 5	690.407 	934.7 <u>15</u> 108.504	2.748.967 — 457.140	4.590.158 — —	Ξ	27.553 — —	=	21.150 — —	125 — 423	917.737 — —
Comisiones del Asesor de inversiones renunciadas por cobrar Otros activos Total activos	6	4.336.777.151	687.657.264	1.668.813.393	4.813.201.063	26.453 52.431.016	21.047 418.479.717	3.697 107.833.875	532 37.461 46.490.186	21.319	1.556.176.138
Pasivo											
Descubierto bancario Importe por pagar a intermediarios Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos	3(f),13	32 510.000	1.184 1.800.000	1.771 8.650.001	1.100 15.280.000	=	344.616	=	=	Ξ	157 5.520.000
de una clase de acciones Minusvalía latente sobre futuros y futuros de clases de acciones de cobertura de duración Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras	3(d) 3(d)	6.115.779 2.397.836	19.844.305	53.826.918 1.248.757	66.972.641 553.464	38.214 202.285	136.612 293.960	205.052 104.535	104.615 43.505	74.704 43.432	12.319.188 3.139.039
en clases de acciones de cobertura de duración Cantidades percibidas anticipadamente por transacciones con permutas financieras Valor de mercado de opciones suscritas	3(d) 3(d) 3(d)	798.454 841.341 —	2.454.408 1.761.129 878.811	18.699.393 4.527.731 2.773.886	22.609.236 11.580.279 3.953.602	=	898.563 341.216 —	29.741 24.595 —	2.584 29.712 —	91.053 99.918 12.473	3.832.244 2.762.728 3.457.162
Valor de mercado de tífulos con garantía hipotecaria a plazo cubiertos Importes por pagar por compra de inversiones Importes por pagar por reembolso de acciones	3(d)	63.534.006		1.289.804	7.054.434	Ξ	8.236.465 581.241	944.435 86.030	3.084.844	40.570	2.431.013 1.361.379
Intereses por pagar por contratos de permutas financieras Intereses por pagar (excepto contratos de permutas financieras) Dividendos por pagar por contratos de permutas financieras	3(b) 3(b) 3(b)	9.486	566.005 — —	1.749.925 — —	2.436.474 — —	Ξ	=	=	30 	42.579 — —	129.434 — —
Comisiones por pagar por préstamos de valores Repartos por pagar Comisión del Asesor de inversiones por pagar	8	1.230.447 2.687.444	134.238	226.232 771.532	701.691 2.432.403	24.045	92.127	2.870 47.418	1.767 20.112	9.855	391.360
Comisiones de rentabilidad por pagar Comisión de administración por pagar Comisión de depositario por pagar Comisiones de distribución y servicio por pagar Comisión del Agente de transferencias por pagar Taxe d'abonnement pagadera	6 6 6 6 5	234.020 208.798 10.415 89.537 135.360	73.777 148.108 235 13.568 9.996	128.259 275.588 3.622 40.122 28.642	290.548 331.561 158.880 126.400 153.131	24.881 10.767 174 18.237 2.978	41.540 72.456 904 13.735 18.452	17.356 20.121 520 14.282 3.284	24.813 16.492 53 17.584 841	6.991 38.595 6.087 1.607	137.152 172.756 13.697 54.774 41.412
Impuesto sobre incrementos patrimoniales por pagar Honorarios de auditoría por pagar Comisiones de la Sociedad Gestora por pagar Comisiones por pagar a los miembros del Consejo de Administración Honorarios de abogados por pagar Primas de seguro por pagar Gastos de imprenta por pagar	6 6	18.121 60.418 8.395 107.025 3.671 40.640	12 17.070 5.580 2.196 22.578 1.282 7.848	11.624 23.872 14.288 3.661 34.971 3.122 15.064	24.923 71.382 11.641 142.023 12.012 49.840	17.070 1.235 149 13.803 710 3.723	14.683 6.593 738 15.684 1.034 5.468	14.683 1.246 147 11.912 534 3.353	17.062 424 82 — 2.637 2.508	17.723 522 51 10.241 257 2.215	23.871 23.106 3.690 31.928 4.026 19.306
Gastos de edición por pagar Gastos por pagar por retención en origen de dividendos e ingresos por intereses Gastos de declaraciones tributarias por pagar Comisiones del Agente de pagos por pagar Gastos de comunicaciones reglamentarias por pagar Otros pasivos	5	1.513 30.475 14.375 28.133 61.547	557 22.904 13.481 17.381 34.341	1.115 28.813 14.125 20.417 38.915	2.826 	796 — 27.336 13.577 18.342 6.177	308 — 15.633 11.676 14.133 5.896 11.163.733	548 — 20.587 11.706 14.257 13.008	796 	147 11.485 10.045 11.786 17.706	1.234 29.552 13.721 20.105 12.629
Total pasivos Patrimonio		79.177.268 4.257.599.883	27.830.994 659.826.270	94.452.170 1.574.361.223	135.122.605 4.678.078.458	424.499 52.006.517	11.163.733 407.315.984	1.592.220 106.241.655	3.431.929 43.058.257	509.472 28.398.616	35.946.663 1.520.229.475
Patrimonio Ajuste por dilución Patrimonio (después del ajuste por dilución)	3(k)	4.257.599.883	659.826.270	1.574.361.223	4.678.078.458	(192.424) 51.814.093	(366.584) 406.949.400	106.241.655	43.058.257	28.398.616	1.520.229.475

<sup>(</sup>a) Consulte el Anexo III (sin auditar).

Consulte la Información estadística relativa a las Acciones en circulación y al Valor liquidativo por acción a 30 de noviembre de 2021.

	Notas	Global Fixed Income Portfolio USD	Global Fixed Income Portfolio (Hedged) EUR	Global High Yield Portfolio USD	Global Sovereign Bond Portfolio USD	Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio USD	US Dollar Short Duration Bond Portfolio USD	US Fixed Income Portfolio USD	US Mortgage Backed Securities Portfolio USD	Emerging Markets Multi- Asset Portfolio USD	ESG-Enhanced Global Multi-Asset Balanced Portfolio <sup>(a)</sup> USD
Activo Inversiones, al valor razonable, excluyendo derivados Plusvalía latente de contratos a plazo sobre bonos no entregables	3(d) 3(d)	127.151.745	1.217.436.053	2.968.501.457	523.294.688 8.430	192.872.502	428.636.797	245.205.576	437.737.314	16.132.864	126.272.393
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones Plusvalía latente sobre futuros y futuros de clases de acciones de cobertura de duración Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras	3(d) 3(d)	317.069 661.730	7.974.122 6.055.189	14.963.686 1.642.618	11.458.740 1.808.379	159.560 215.143	236.330 394.542	26.845 736.723	161.253 367.501	84.223 17.587	597.749 333.956
en clases de acciones de cobertura de duración Cantidades pagadas anticipadamente por transacciones con permutas financieras Valor de mercado de opciones compradas	3(d) 3(d) 3(d)	591.142 619.397 63.279	4.462.404 7.813.011 602.425	4.371.105 12.982.793	3.435.946 3.377.722 414.742		92.873 183.537	363.243 788.734 24.033	791.951 46.592 30.206	19.968 39	17.117 94.859 616.164
Tesorería Importes por cobrar de intermediarios Importes por cobrar por venta de inversiones Importes por cobrar por venta de acciones	3(e) 3(f),13	2.218.496 2.350.899 12.788.431 130.926	25.003.733 35.859.480 96.645.239 1.744.116	40.660.329 8.628.434 6.752.890 2.676.884	6.825.690 15.678.879 9.722.147 10.103.925	2.634.482 986.678 13.737.640 164.099	513.280 914.834 10.127.615 17.000.000	3.133.242 2.033.945 14.257.764 190.612	4.510.887 1.191.146 260.863.194 71.716	1.166.507 90.611 12.703 38.301	5.449.591 4.204.119 455.247 338.052
Dividendos por cobrar excepto contratos de permutas financieras y contratos por diferencia Dividendos por cobrar por contratos de permutas financieras Intereses por cobrar (excepto contratos de permutas financieras) Intereses por cobrar por contratos de permutas financieras	3(b) 3(b) 3(b) 3(b)	58 — 751.461 28.535	5.947.900 451.869	3.267 — 39.904.735 1.987.552	701 — 3.714.006 839.726	2.417.182	11 	1.118 — 791.813 64.878	1.113 — 566.421 681	2.774 — 92.513 6.862	101.553 — 288.105 10.012
Devolución de impuestos por dividendos por cobrar Devolución de impuestos por intereses por cobrar Intereses por cobrar por préstamos de valores	5 5 6	=	451.005	39.444	83.758	=			Ξ	653 1.598	4.851 1.318
Comisiones del Asesor de inversiones renunciadas por cobrar Otros activos Total activos	6	22.201 ————————————————————————————————————	1.409.995.541	3.103.115.194	590.767.479	8.324 	10.151 — <b>459.887.408</b>	7.396 — <b>267.625.922</b>	19 <b>706.339.994</b>	66.496  17.733.699	8.099 
Pasivo											
Descubierto bancario Importe por pagar a intermediarios Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos	3(f),13	300.000	9.264.632	370 6.121.819	1.523 5.650.000	502 —	1.048 550.000	48 —	=	19 —	22.109
de una clase de acciones Minusvalla latente sobre futuros y futuros de clases de acciones de cobertura de duración Minusvalla latente sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras	3(d) 3(d)	355.417 239.871	18.643.094 1.130.930	4.998.865 1.758.575	15.325.336 482.285	193.402 862.686	7.809 286.632	161.239 174.635	14.498 194.918	171.284 3.237	2.877.163 100.904
en clases de acciones de cobertura de duración Cantidades percibidas anticipadamente por transacciones con permutas financieras Valor de mercado de opciones suscritas	3(d) 3(d) 3(d)	618.005 754.394 389.143	5.445.020 5.490.246 3.443.746	1.490.815 12.970 —	4.993.959 2.139.625 2.099.200	=	293.883 102.582	432.843 355.243 67.415	210.107 1.380.196 48.268	558 —	899 — 38.741
Valor de mercado de títulos con garantía hipotecaria a plazo cubiertos Importes por pagar por compra de inversiones Importes por pagar por reembolso de acciones Intereses por pagar por contratos de permutas financieras	3(d) 3(b)	2.073.302 17.621.416 123.967 12.581	10.140.833 135.160.873 936.157 70.269	4.117.648 15.646.406 57.190	9.601.228 1.129.300 552.689	13.345.971 1.766.314	1.095.155 20.867.281 2.559.189	9.396.118 40.397.166 2.637.008	42.912.504 367.836.762 568.629	4.355 3.492	634.220 83.806
Intereses por pagar (excepto contratos de permutas financieras) Dividendos por pagar por contratos de permutas financieras Comisiones por pagar por préstamos de valores	3(b) 3(b) 6	-	-	-	-	=	=	=	=	-	=
Repartos por pagar Comisión del Asesor de inversiones por pagar	8 6	48.710	239.472	1.256.143 1.120.349	245.104	142.113	77.206	224 85.996	40.597	58.813 20.323	103.353
Comisiones de rentabilidad por pagar Comisión de administración por pagar	6 6	47.899	95.413	218.896	59.054	44.149	53.215	43.625	51.855	26.123	24.329
Comisión de depositario por pagar Comisiones de distribución y servicio por pagar	6	96.744 4.797	156.399 1.378	136.075 31.063	165.102	19.310 2.142	36.426	61.184 796	17.009 1.138	44.746 39	35.250 3.854
Comisión del Agente de transferencias por pagar Taxe d'abonnement pagadera	6	14.165 5.015	35.687 38.840	95.475 87.466	8.394 8.609	26.010 10.129	10.890 15.396	16.365 6.780	18.327 6.303	20.062 3.167	16.435 8.952
Impuesto sobre incrementos patrimoniales por pagar Honorarios de auditoría por pagar	5	23.871	20.533	24.922	17.070	17.070	17.070	23.871	23.871	54.256 18.121	12.037
Comisiones de la Sociedad Gestora por pagar Comisiones por pagar a los miembros del Consejo de Administración	6	2.245 409	16.598 2.560	39.167 6.646	4.461 1.324	3.007 447	5.385 748	2.496 289	2.828 784	580 47	4.190 240
Honorarios de abogados por pagar Primas de seguro por pagar		15.484 595	23.506 2.339	101.798 11.858	21.595 870	14.154 1.324	16.790 1.022	14.228 782	15.578 812	83.013 177	15.006 450
Gastos de imprenta por pagar Gastos de edición por pagar Gastos por pagar por retención en origen de dividendos e ingresos por intereses	5	5.050 439	13.963 787	39.208 2.587	5.524 279	6.394 1.074	6.741 239 —	6.122 556 115	5.773 597	2.598 836 164	4.242 438 20.037
Gastos de declaraciones tributarias por pagar Comisiones del Agente de pagos por pagar	3	20.541 13.607 16.901	23.984 11.734 16.062	35.834 19.812 30.388	16.848 13.577 16.988	28.628 13.582 19.463	17.378 13.582 16.100	22.240 13.580 17.381	23.328 13.577 17.542	27.521 13.577 18.202	19.691 14.081 16.900
Gastos de comunicaciones reglamentarias por pagar Otros pasivos		7.574	13.553	28.842	8.857	6.432	5.754	5.229	7.570	35.547	7.650
Total pasivos Patrimonio		22.812.142 124.883.227	190.438.608 1.219.556.933	37.491.187 3.065.624.007	42.568.801 548.198.678	16.524.303 196.671.307	26.057.521 433.829.887	53.943.574 213.682.348	413.413.371 292.926.623	610.857 17.122.842	4.064.977 134.728.208
Ajuste por dilución Patrimonio (después del ajuste por dilución)	3(k)	124.883.227	1.219.556.933	3.065.624.007	548.198.678	196.671.307	130.149 433.960.036	213.682.348	292.926.623	17.122.842	134.728.208

<sup>(</sup>a) Consulte el Anexo III (sin auditar).

Consulte la Información estadística relativa a las Acciones en circulación y al Valor liquidativo por acción a 30 de noviembre de 2021.

	Notas	Global Multi-Asset Conservative Portfolio USD	Global Multi- Asset Growth Portfolio USD	Global Multi- Asset Income Portfolio USD	US Real Estate Balanced Portfolio USD	Emerging Markets Total Return Bond Portfolio USD	Global Absolute Return Portfolio USD	Global Dynamic Bond Portfolio <sup>(a)</sup> USD	Global Dynamic Bond Plus Portfolio <sup>(a)</sup> USD	Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged) EUR	Global Strategic Macro Bond Portfolio USD
Activo Inversiones, al valor razonable, excluyendo derivados Plusvalía latente de contratos a plazo sobre bonos no entregables Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos	3(d) 3(d)	461.922.126 —	211.082.378	471.298.577 —	219.649.7 <u>60</u>	152.613.490 —	270.154.651 —	575.736.897 —	1.283.763.096	1.876.737.530	353.624.221 —
de una clase de acciones Plusvalía latente sobre futuros y futuros de clases de acciones de cobertura de duración Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras	3(d) 3(d)	938.857 1.138.500	323.470 342.411	756.063 4.049.715	235.462 207.800	4.865.474 264.523	588.957 1.988.034	8.546.047 135.936	27.435.654 4.400.556	38.847.961 8.094.895	17.400.802 2.611.223
en clases de acciones de cobertura de duración Cantidades pagadas anticipadamente por transacciones con permutas financieras Valor de mercado de opciones compradas Tesorería Importes por cobrar de intermediarios Importes por cobrar por venta de inversiones Importes por cobrar por venta de acciones Dividendos por cobrar accepto contratos de permutas financieras y contratos por diferencia	3(d) 3(d) 3(d) 3(e) 3(f),13	2.276.850 11.210.096 5.541.067 602.883 1.199	1.154.382 4.093.510 2.298.984 349.742 245	1.957 3.026 65.553.653 21.125.762 732.868 5.132.699 313.735	180.706 — 7.606.179 636.491 — 153.853 32.831	2.570.465 1.077.765 384.332 3.608.803 11.328.255 — 977	3.162.636 877.674 2.286.532 31.542.293 40.268.241 57.741 415.687 43.235	3.244.517 5.568.559 944.650 5.661.893 41.981.480 6.499.310 —	16.813.097 18.987.033 2.506.736 16.436.251 89.204.200 57.233.790 3.349 4.980	8.800.249 14.318.060 3.564.833 37.369.478 53.333.492 221.819.813 195.543	10.552.752 7.817.609 1.453.075 13.483.973 23.494.949 92.320.792 194.522 1.040
Dividendos por cobrar por contratos de permutas financieras Intereses por cobrar (excepto contratos de permutas financieras) Intereses por cobrar por contratos de permutas financieras Devolución de impuestos por dividendos por cobrar	3(b) 3(b) 3(b) 5	- - -		2.742.399	1.149.307 1.904	1.755.159 289.688	5.073 653.790 86.888 4.567	1.758.476 346.615	6.843.099 1.792.899	9.752.748 926.972	893.253 768.309
Devolución de impuestos por intereses por cobrar Intereses por cobrar por préstamos de valores Comisiones del Asesor de inversiones renunciadas por cobrar	5 6 6	Ξ	=	2.115	Ξ	1.214 	60.792	7.617	=	Ξ	23.373
Otros activos Total activos		483.631.578	219.645.122	571.730.911	229.854.293	178.780.417	352.196.791	650.433.326	1.525.424.740	2.273.761.574	524.639.893
Pasivo Descubierto bancario Importe por pagar a intermediarios Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos	3(f),13	=	Ξ	1.623	206 —	7.440 1.100.000	4 40.533	47.779 710.000	42.588 6.020.000	13.656.044	104.281 2.700.000
de una clase de acciones Minusvalla latente sobre futuros y futuros de clases de acciones de cobertura de duración Minusvalla latente sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras	3(d) 3(d)	4.056.686 296.623	574.344 592.763	3.487.055 1.756.853	44.191 405.819	9.068.556 521.847	9.292.061 2.223.388	27.151.231 3.499.668	44.101.030 6.241.978	36.521.413 940.207	17.325.301 3.634.503
en clases de acciones de cobertura de duración Cantidades percibidas anticipadamente por transacciones con permutas financieras Valor de mercado de opciones suscritas	3(d) 3(d) 3(d)	<u> </u>	94.728	137.507	14.754 576.992	1.449.468 958.961 346.235	3.564.181  1.309.934	7.247.401 5.540.363 3.977.723	26.298.745 22.230.874 11.541.179	18.253.727 16.310.547 9.912.488	11.940.305 6.983.447 7.915.558
Valor de mercado de títulos con garantía hipotecaria a plazo cubiertos Importes por pagar por compra de inversiones Importes por pagar por reembolso de acciones Intereses por pagar por contratos de permutas financieras	3(d) 3(b)	3.702 1.328.202	2.449 775.634	4.372.483 3.211.974 70	210.813 7.896	958.707 202.151	348.138 57.276 2.636	16.508.635 300.773	153.755.911 487.929 1.119.223	11.049.474 295.680.153 310.302 672.136	106.489.160 742.002 655.445
Intereses por pagar (excepto contratos de permutas financieras) Dividendos por pagar por contratos de permutas financieras Comisiones por pagar por préstamos de valores	3(b) 3(b) 6	=	=	2.130.762	90.687	Ξ	4.056	=	697.538	=	=
Repartos por pagar Comisión del Asesor de inversiones por pagar Comisiones de rentabilidad por pagar	6	265.329 57.933	142.796 31.828	558.475 	189.176 — 39.585	5.119 13.013 30.360	59.354 40.604	1.696 1 71.450	494.850 — 128.825	271.151 	145.352 47.912
Comisión de administración por pagar Comisión de depositario por pagar Comisiones de distribución y servicio por pagar Comisión del Agente de transferencias por pagar Taxe d'abonnement pagadera	66655	25.062 6.809 19.361 2.860	17.087 533 15.799 2.442	67.427 13.240 26.970 61.219	19.035 642 24.903 14.167	78.482 9 12.368 2.648	88.439 24 16.151 10.457	154.949 315 16.704 7.237	187.946 10.392 55.687 31.406	219.134 2.472 31.050 50.860	149.066 5.448 37.738 10.429
Impuesto sobre incrementos patrimoniales por pagar Honorarios de auditoría por pagar Comisiones de la Sociedad Gestora por pagar Comisiones por pagar a los miembros del Consejo de Administración	5 6 6	12.037 6.243 1.016	12.037 2.632 424	18.121 18.042 353	17.070 4.776 458	17.070 1.416 357	65.318 23.871 2.611 535	23.871 4.944 1.335	23.871 13.964 2.828	34.780 20.533 16.698 3.605	23.871 4.706 974
Honorarios de abogados por pagar Primas de seguro por pagar Gastos de imprenta por pagar Gastos de edición por pagar	-	19.961 743 5.884 477	16.569 452 4.125 438	87.856 404 5.513 955	98.550 1.270 7.069 756	13.948 234 2.999 557	16.036 393 3.831 677	21.614 965 5.789 716	32.901 3.980 15.662 1.751	29.242 2.155 14.767 822	21.047 1.790 7.076 1.393
Gastos por pagar por retención en origen de dividendos e ingresos por intereses Gastos de declaraciones tributarias por pagar Comisiones del Agente de pagos por pagar Gastos de comunicaciones reglamentarias por pagar Otros pasivos	5	20.540 13.966 17.061 9.022	19.691 13.884 16.901 7.180	64.133 28.075 13.662 17.706 9.117	7.490 26.486 13.663 18.182 7.390	22.455 13.577 17.381 12.502	6.057 27.335 13.678 18.162 30.622	25.452 13.580 18.021 24.335	32.139 13.610 22.187 37.620	23.826 11.759 15.360 28.351	30.477 14.497 25.638 16.096
Total pasivos		6.307.378	2.344.736	16.154.870	1.842.026	14.857.860	17.266.362	65.376.547	273.646.614	404.189.008	159.033.512
Patrimonio Ajuste por dilución	3(k)	477.324.200	217.300.386	555.576.041	228.012.267	163.922.557	334.930.429	585.056.779	1.251.778.126	1.869.572.566	365.606.381
Patrimonio (después del ajuste por dilución)	O(II)	477.324.200	217.300.386	555.576.041	228.012.267	163.922.557	334.930.429	585.056.779	1.251.778.126	1.869.572.566	365.606.381

(a) Consulte el Anexo III (sin auditar).

Consulte la Información estadística relativa a las Acciones en circulación y al Valor liquidativo por acción a 30 de noviembre de 2021.

	Notas	Strategic Absolute Return Bond II Portfolio USD	Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio USD	Global Corporate Portfolio (Hedged) NOK	Absolute Return Tracker Portfolio USD	Alternative Trend Portfolio USD	Total combinado ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021 USD
Activo Inversiones, al valor razonable, excluyendo derivados Plusvalía latente de contratos a plazo sobre bonos no entregables Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos	3(d) 3(d)	77.017.140	634.257.526 —	16.590.347.346 —	1.024.150.125	422.091.875 —	67.857.455.212 61.014
de una clase de acciones Plusvalla latente sobre futuros y futuros de clases de acciones de cobertura de duración Plusvalla latente sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras	3(d) 3(d)	3.605.844 288.360	11.385	32.777.430 87.682.284	1.550.742 1.087.655	2.562.609 4.393.602	300.759.070 89.645.252
en clases de acciones de cobertura de duración Cantidades pagadas anticipadamente por transacciones con permutas financieras Valor de mercado de opciones compradas Tesorería Importes por cobrar de intermediarios Importes por cobrar por venta de inversiones Importes por cobrar por venta de acciones Dividendos por cobrar excepto contratos de permutas financieras y contratos por diferencia	3(d) 3(d) 3(d) 3(e) 3(f),13	869.898 1.703.994 278.508 769.305 8.050.692 5.418.912	8.043.158 — 153.571 1.113.866	47.957.535 111.557.611 2.331.742 290.408.665 956.324.132 30.855.083	3.794.673 12.065.624 290.163 127.640.214 63.966.856 1.610.268 17.194.660 492.548	6.002.662 30.955.591 65.298.001 192.152 2.744	133.346.213 148.137.860 26.457.858 1.258.657.164 993.927.678 919.290.548 408.547.410 42.323.879
Dividendos por cobrar por contratos de permutas financieras Intereses por cobrar (excepto contratos de permutas financieras) Intereses por cobrar por contratos de permutas financieras Devolución de impuestos por dividendos por cobrar Devolución de impuestos por intereses por cobrar Intereses por cobrar por préstamos de valores Comisiones del Asesor de inversiones renunciadas por cobrar	3(b) 3(b) 3(b) 5 5 6	318.841 117.795 — 40.643	410.767 — 4127 11.370	115.098.213 10.773.846 —	62.519 1.074.766 5.817 — 170.658	22.109 544.647 —	5.073 260.179.331 20.673.660 9.643.559 686.807 157.329 762.433
Otros activos Total activos	U	98.480.130	644.001.770	18.276.113.887	1.255.157.288	532.065.992	109.723 72.470.827.073
Pasivo			644.001.770	10.276.113.007	1.255.157.266	532.065.992	
Descubierto bancario Importe por pagar a intermediarios Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos	3(f),13	206.722 270.000	Ξ	38.502.878	1.624.042	Ξ	1.729.370 90.729.763
de una clase de acciones Minusvalla latente sobre futuros y futuros de clases de acciones de cobertura de duración Minusvalla latente sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras	3(d) 3(d)	5.895.854 540.239	233.591	916.804.054 6.462.870	4.153.690 6.064.922	4.793.208 8.607.447	496.017.530 53.946.983
en clases de acciones de cobertura de duración Cantidades percibidas anticipadamente por transacciones con permutas financieras Valor de mercado de opciones suscritas	3(d) 3(d) 3(d)	2.119.132 1.586.903 1.192.887	=	36.744.391 38.889.081 30.824.002	8.346.652 — 146.845	1.012.308	150.634.688 93.780.216 59.127.731
Valor de mercado de títulos con garantía hipotecaria a plazo cubiertos Importes por pagar por compra de inversiones Importes por pagar por reembolso de acciones	3(d)	7.549.352	249.320 14.000	21.003.116 	48.107.616 4.311.531	230.115	79.588.483 1.484.051.849 182.608.730
Intereses por pagar por contratos de permutas financieras Intereses por pagar (excepto contratos de permutas financieras) Dividendos por pagar por contratos de permutas financieras	3(b) 3(b) 3(b) 6	87.783 — —	=	5.150	4.230 — 6.559	=	8.791.816 44.726 10.615 16.223
Comisiones por pagar por préstamos de valores Repartos por pagar Comisión del Asesor de inversiones por pagar Comisiones de rentabilidad por pagar	8 6 6	67.805	1.386.943	3.527.886	692.182	79.397	9.731.949 34.739.598 13.014
Comisión de administración por pagar Comisión de depositario por pagar Comisiones de distribución y servicio por pagar	6 6 6	24.932 129.448 228	67.043 60.615	606.285 1.264.627	97.785 246.198 455	54.776 65.730	5.148.537 7.773.346 1.037.818
Comisión del Agente de transferencias por pagar Taxe d'abonnement pagadera Impuesto sobre incrementos patrimoniales por pagar	6 5 5	13.905 2.201	14.574 43.300	32.138 278.748	34.291 40.865	11.675 8.589	2.269.280 2.231.909 42.101.459
Honorarios de auditoría por pagar Comisiones de la Sociedad Gestora por pagar Comisiones por pagar a los miembros del Consejo de Administración	6	23.871 876 259	12.038 14.862 1.209	209.943 141.116 37.143	17.071 17.414 1.583	23.871 4.358 876	1.143.331 970.409 139.060
Honorarios de abogados por pagar Primas de seguro por pagar Gastos de imprenta por pagar Gastos de edición por pagar	Ü	15.451 453 3.326 557	20.387 1.815 8.287 397	320.422 15.249 112.810 347	22.188 3.823 15.124 716	17.427 431 4.462 358	2.225.273 134.350 799.764 51.736
Gastos por pagar por retênción en origen de dividendos e ingresos por intereses Gastos de declaraciones tributarias por pagar Comisiones del Agente de pagos por pagar Gastos de comunicaciones reglamentarias por pagar Otros pasivos	5	22.904 13.577 17.381 23.080	311.407 18.603 13.577 25.302 29.127	 108.350 110.226 124.061	130.348 25.637 17.592 18.322 11.340	18.177 13.675 16.880 6.803	7.184.033 1.558.100 902.341 1.037.079 1.291.376
Total pasivos Patrimonio		19.809.126 78.671.004	2.526.397 641.475.373	1.096.124.893 17.179.988.994	74.159.021 1.180.998.267	14.970.563 517.095.429	2.823.562.485 69.647.264.588
Ajuste por dilución Patrimonio (después del ajuste por dilución)	3(k)	78.671.004	641.475.373	17.179.988.994	354.299 1.181.352.566	517.095.429	1.053.865 69.648.318.453

Consulte la Información estadística relativa a las Acciones en circulación y al Valor liquidativo por acción a 30 de noviembre de 2021.

	Notas	Asia Equity Portfolio USD	All China Equity Portfolio <sup>(a)</sup> USD	Emerging Markets Equity ESG Portfolio USD	Emerging Markets Equity Portfolio USD	Global Environmental Impact Equity Portfolio USD	Global Equity Income Portfolio USD	Global Equity Partners ESG Portfolio USD	Global Equity Partners Portfolio USD	Global Future Health Care Equity Portfolio USD	Global Future Technology Leaders Equity Portfolio USD
Ingresos Ingresos por dividendos excepto contratos de permutas financieras y contratos por diferencia Ingresos por intereses (excepto de contratos de permutas financieras)	3(b) 3(b)	2.956.280	1.154.842	5.689.500	69.431.387	7.915.887	710.045	555.781	13.800.274 58	818.334	21.762.502
Ingresos por intereses de contratos de permutas financieras	3(b)	_	_	_		_	_	=	_	=	_
(Amortización) neta/Acumulación neta Ingresos por intereses de préstamo de valores	3(b) 6	6.534	_	_	362.728	_	1.391	_	11.778	_	_
Otros ingresos		2.962.814	1.154.842	5.689.500	69.794.116	7.915.887	711.436	555.781	13.812.110	818.334	21.762.502
Gastos		2.002.014			00.704.110	7.010.007	711.400				21.702.002
Gastos por intereses de descubiertos bancarios Gastos por dividendos de contratos de permutas financieras	3(b) 3(b)	_	236	660	4.217	4.501	_	26	6.056	66	3.118
Gastos por intereses, excluidos de permitas linancieras  Gastos por intereses, excluidos contratos de permitas financieras	3(b)	978	330		=	=	=	=	=	=	1.962
Gastos por intereses de contratos de permutas financieras	3(b) 6	635	_	_	31.375	_	 181	_	800	_	_
Gastos aplicados a préstamos de valores Comisión del Asesor de inversiones	6	1.751.989	754.081	3.910.168	47.955.970	5.866.045	288.723	501.906	9.023.945	2.330.025	4.524.830
Comisiones de rentabilidad	6	405.000			- 400 044	404.044			405.700		-
Comisiones del Depositario Comisiones de administración	6 6	135.300 91.818	62.007 45.169	245.499 125.696	2.423.241 587.620	194.941 182.748	25.400 39.999	31.455 42.875	165.762 291.465	84.864 86.717	801.315 520.667
Comisiones de distribución y servicio	6	119.328		1.643	926.481	278.626	4.959	25.178	62.947	4.387	10.808
Comisión del Agente de transferencias Taxe d'abonnement	6 5	59.198 67.663	30.438 25.895	49.304 85.997	418.783 1.129.229	92.224 215.890	30.709 11.663	34.578 22.288	112.883 391.273	48.888 86.524	59.961 560.924
Honorarios de auditoría	3	17.286	17.286	12.112	26.400	12.112	12.111	12.112	12.112	11.606	12.112
Comisiones de la Sociedad Gestora	6 6	49.611 1.827	16.297 653	66.139 1.759	949.116 28.600	136.341 3.066	7.107	14.312 284	292.029 7.013	49.987 1.119	481.521 28.179
Comisiones de los miembros del Consejo de Administración Honorarios de abogados	О	18.218	8.343	1.759	124.275	24.155	134 8.365	8.387	30.444	21.233	45.899
Gastos de seguros		3.382	2.416	247	40.495	465	922	1.051	14.511	231	2.588
Gastos de imprenta Gastos de edición		19.477 3.904	11.613 2.342	13.787 3.693	152.302 6.993	34.661 4.840	8.542 2.863	8.594 3.123	45.636 9.109	23.036 3.672	75.863 3.608
Gastos de edicion Gastos de declaraciones tributarias		33.019	27.799	31.459	39.284	22.621	59.203	29.776	12.410	20.382	20.935
Comisiones del Agente de pagos		25.283 31.307	25.283 28.303	25.283 29.458	25.302 37.264	25.283 21.591	25.283 29.923	25.283 28.324	26.598 32.688	25.283 39.004	25.283 7.458
Gastos de declaraciones reglamentarias Otros gastos		85.446	26.636	75.570	384.642	47.450	29.923 19.817	29.081	35.518	27.297	81.689
·		2.515.669	1.085.127	4.696.333	55.291.589	7.167.560	575.904	818.633	10.573.199	2.864.321	7.268.720
Menos: Exención del cobro de la comisión del Asesor de inversiones  Total gastos	6	12.459 <b>2.503.210</b>	54.680 <b>1.030.447</b>	4.696.333	55.291.580	7.167.560	190.108 385.796	173.566 <b>645.067</b>	10.573.199	2.864.321	7.268.720
Retención fiscal sobre los dividendos y otros ingresos de inversión	5	480.779	88.224	677.733	9.045.918	1.211.456	120.515	104.795	2.292.254	195.098	4.634.582
Ingresos/(Gastos) netos de operaciones inversión del ejercicio		(21.175)	36.171	315.434	5.456.618	(463.129)	205.125	(194.081)	946.657	(2.241.085)	9.859.200
Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre valores de inversión Plusvalía/(Minusvalía) materializada neta sobre transacciones de futuros y contratos de futuros		12.235.961	13.560.345	3.596.269	330.629.038	46.323.511	781.819	6.053.665	111.140.024	(2.277.725)	601.302.372
de clases de acciones de cobertura de duración Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de divisas, contratos de divisas		(1.514.834)	(518.505)	333.929	_	_	_	_	_	_	_
a plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones Plusvalía/(Minusvalía) materializada neta sobre contratos de permutas financieras y contratos		(186.401)	643.169	(399.014)	(36.999.945)	551.606	51.795	237.185	(4.297.587)	(8.430)	3.595.577
de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de duración Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de opciones		_	_	_	_	_	_	_	_	_	_
Plusvalía/(minusvalía) materializada neta		10.534.726	13.685.009	3.531.184	293.629.093	46.875.117	833.614	6.290.850	106.842.437	(2.286.155)	604.897.949
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores de inversión Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores hipotecarios a plazo cubiertos		(32.098.293)	(20.845.749)	(18.437.062)	(89.336.209)	41.866.001	1.376.581	3.098.085	116.142.370	9.019.092	301.155.733
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre transacciones de futuros y contratos		(530, 380)		162.150							
de futuros de clases de acciones de cobertura de duración Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente de contratos de divisas a plazo sobre bonos		(539.380)	_	162.150	_	_	_	_	_	_	_
no entregables Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de divisas, contratos de		_	_	_	_	_	_	_	_	_	_
divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de		850	(647)	(58.150)	(291.844)	83.600	(1.478)	(865)	1.233.376	499	(18.976)
duración Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de opciones		_	_	_	_	_	_	_	_	_	
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente  Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente		(32.636.823)	(20.846.396)	(18.333.062)	(89.628.053)	41.949.601	1.375.103	3.097.220	117.375.746	9.019.591	301.136.757
Plusvalía/(minusvalía) neta de operaciones del ejercicio		(22.123.272)	(7.125.216)	(14.486.444)	209.457.658	88.361.589	2.413.842	9.193.989	225.164.840	4.492.351	915.893.906

<sup>(</sup>a) Consulte el Anexo III (sin auditar).

	Notas _	Global Millennials Equity Portfolio USD	India Equity Portfolio USD	Japan Equity Partners Portfolio <sup>(b)(c)</sup> JPY	Japan Equity Portfolio <sup>(b)(c)</sup> JPY	US Equity Portfolio USD	US Focused Growth Equity Portfolio USD	US Small Cap Equity Portfolio <sup>(a)</sup> USD	US Technology Opportunities Equity Portfolio USD	Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio <sup>(a)</sup> USD	Global Infrastructure Equity Portfolio USD
Ingresos Ingresos por dividendos excepto contratos de permutas financieras y contratos por diferencia Ingresos por intereses (excepto de contratos de permutas financieras)	3(b) 3(b)	9.656.289	14.684.770	2.946.081	2.412.231	9.678.396	84.192 —	537.763	1.638.023	9.804	749.912
Ingresos por intereses de contratos de permutas financieras	3(b) 3(b)	_	_	_	_	_	_	_	_	_	_
(Amortización) neta/Acumulación neta Ingresos por intereses de préstamo de valores	6	89.609	_	19.508	25.347	2.384	=	_	=		_
Otros ingresos	-	9.745.898	51.625 <b>14.736.395</b>	2.965.589	2.437.578	9.680.780	84.192	537.763	1.638.023	9.804	749.912
Gastos	-										
Gastos por intereses de descubiertos bancarios Gastos por dividendos de contratos de permutas financieras	3(b) 3(b)	4.897	2.519	11.876	7.739	_	_	_	_	_	68 —
Gastos por intereses, excluidos contratos de permutas financieras	3(b)	_	_	_	_	52	_	_	_	_	_
Gastos por intereses de contratos de permutas financieras Gastos aplicados a préstamos de valores	3(b) 6	8.179	_	1,206	 778	216	_	_	_	_	_
Comisión del Asesor de inversiones Comisiones de rentabilidad	6	22.658.988	22.514.508	1.689.323	1.148.591	11.667.275	588.015	503.768	145.618	4.470	320.265
Comisiones del Depositario	6	369.831	1.105.967	43.876	32.982	90.901	18.189	33.963	74.261	159	54.762
Comisiones de administración Comisiones de distribución y servicio	6 6	347.769 1.918.281	338.000 757.726	37.208	30.678 74.616	210.814 119.855	41.999 71.457	44.907 3.484	103.749 70	5.562 10	60.575 65.551
Comisión del Agente de transferencias	6	313.769	291.311	15.939	18.064	92.104	40.680	33.788	29.958	400	53.202
Taxe d'abonnement Honorarios de auditoría	5	743.901 14.231	656.242 49.917	45.830 1.350	26.030 1.350	400.608 12.112	21.362 12.112	31.719 12.111	39.735 11.435	95 11.766	12.200 12.112
Comisiones de la Sociedad Gestora	6	550.964	513.251	34.227	22.074	314.604	15.087	23.606	33.231	63	7.266
Comisiones de los miembros del Consejo de Administración	6	13.190	28.100	1.416	855	4.631	245	336	1.491	16	118
Honorarios de abogados Gastos de seguros		111.714 8.519	78.001 21.633	4.383 2.500	2.535 1.780	12.754 5.458	7.587 1.025	8.286 1.584	16.784 4.730	985 17	7.550 1.090
Gastos de imprenta		83.837	61.200	7.013	4.369	24.385	10.325	9.576	12.768	2.224	9.569
Gastos de edición Gastos de declaraciones tributarias		5.373 38.911	5.204 10.033	733 1.252	803 7.483	5.725 37.847	3.123 29.775	3.122 30.305	3.857 23.237	520 27.767	6.245 38.566
Comisiones del Agente de pagos		25.881	28.136	2.643	2.648	25.655	25.283	25.283	25.283	2.107	25.283
Gastos de declaraciones reglamentarias Otros gastos		27.358 188.819	25.962 283.546	6.322 7.864	6.948 9.455	31.352 32.167	30.821 20.446	27.127 16.555	38.996 26.576	4.680 1.239	34.073 20.436
01103 gastos	_	27.434.412	26.771.256	1.914.961	1.399.778	13.088.515	937.531	809.520	591.779	62.080	728.931
Menos: Exención del cobro de la comisión del Asesor de inversiones	6		20 774 250	4.044.064	4 200 770	42 000 545	108.087	45.503		55.487	243.661
<b>Total gastos</b> Retención fiscal sobre los dividendos y otros ingresos de inversión	5	<b>27.434.412</b> 1.970.904	<b>26.771.256</b> 2.937.270	<b>1.914.961</b> 451.192	<b>1.399.778</b> 369.433	<b>13.088.515</b> 2.773.209	<b>829.444</b> 23.929	<b>764.017</b> 156.452	<b>591.779</b> 449.072	<b>6.593</b> 2.174	<b>485.270</b> 130.680
Ingresos/(Gastos) netos de operaciones inversión del ejercicio	· -	(19.659.418)	(14.972.131)	599.436	668.367	(6.180.944)	(769.181)	(382.706)	597.172	1.037	133.962
Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre valores de inversión		136.854.652	1.175.259.520	20.705.180	19.744.777	90.399.728	5.349.302	10.465.736	13.410.820	8.179	629.327
Plusvalía/(Minusvalía) materializada neta sobre transacciones de futuros y contratos de futuros de clases de acciones de cobertura de duración		_	15.269.968	122.771	(123.624)	_	_	_	_	_	_
Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de divisas, contratos de divisas a		047.055			, ,	(44,440,004)		(00 545)	(75.057)	0.401	160 100
plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones Plusvalía/(Minusvalía) materializada neta sobre contratos de permutas financieras y contratos		247.255	(65.174.566)	4.239.863	1.970.868	(11.418.921)	1	(92.545)	(75.857)	6.101	166.403
de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de duración		_	_	_	_	_	_	_	_	_	_
Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de opciones  Plusvalía/(minusvalía) materializada neta	-	137.101.907	1.125.354.922	25.067.814	21.592.021	78.980.807	5.349.303	10.373.191	13.334.963	14.280	795.730
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores de inversión	-	83.821.267	(445.100.172)	8.656.433	(522.319)	102.489.586	6.015.195	1.013.625	61.252.924	(50.163)	468.563
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores hipotecarios a plazo cubiertos Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre transacciones de futuros y contratos		_	_	_	_	_	_	_	_	_	_
de futuros de clases de acciones de cobertura de duración		_	(647.645)	_	_	_	_	_	_	_	_
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente de contratos de divisas a plazo sobre bonos no entregables		_	_	_	_	_	_	_	_	_	_
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de divisas, contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de		5.791	(414.419)	(1.194.912)	(928.060)	(545.106)	(302)	(15.090)	_	6	(1.266)
duración		_	_	_	_	_	_	_	_	_	_
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de opciones Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente	-	83.827.058	(446.162.236)	7.461.521	(1.450.379)	101.944.480	6.014.893	998.535	61.252.924	(50.157)	467.297
Plusvalía/(minusvalía) neta de operaciones del ejercicio	_	201.269.547	664.220.555	33.128.771	20.810.009	174.744.343	10.595.015	10.989.020	75.185.059	(34.840)	1.396.989
(a) Consulte el Anexo III (sin auditar)											

<sup>(</sup>a) Consulte el Anexo III (sin auditar).

<sup>(</sup>b) Expresado en miles.

<sup>(</sup>c) Consulte la Nota 3 (i).

Las plusvalías y minusvalías se derivaron únicamente de operaciones continuas. No se produjeron plusvalías ni minusvalías aparte de las reflejadas en la Cuenta de pérdidas y ganancias.

	Notas	Global Real Estate Equity Portfolio USD	North America Energy & Energy Infrastructure Equity Portfolio USD	Emerging Markets CORE® Equity Portfolio <sup>(b)</sup> USD	Europe CORE® Equity Portfolio EUR	Eurozone CORE® Equity Portfolio <sup>(a)</sup> EUR	Global CORE® Equity Portfolio <sup>(b)</sup> USD	Global Small Cap CORE® Equity Portfolio <sup>(b)</sup> USD	US CORE® Equity Portfolio <sup>(b)</sup> USD	US Small Cap CORE® Equity Portfolio <sup>(b)</sup> USD	Asia High Yield Bond Portfolio USD
Ingresos Ingresos por dividendos excepto contratos de permutas financieras y contratos por diferencia	3(b)	1.790.090	2.022.159	103.255.344	55.233.765	15.259	75.409.991	12.461.186	26.055.045	2.725.243	4.506
Ingresos por intereses (excepto de contratos de permutas financieras) Ingresos por intereses de contratos de permutas financieras	3(b) 3(b)	_	_	390	=	=	_	_	=	_	10.081.739
(Amortización) neta/Acumulación neta	3(b)	_	_	_		_	_	_	_	_	1.867.970
Ingresos por intereses de préstamo de valores Otros ingresos	6	_	9.097	489.684	206.590	_	461.727 —	31.302	150.531	3.886	_
Gastos		1.790.090	2.031.256	103.745.418	55.440.355	15.259	75.871.718	12.492.488	26.205.576	2.729.129	11.954.215
Gastos por intereses de descubiertos bancarios	3(b)	34	363	15.144	170.703	162	48.781	4.204	22.027	_	92
Gastos por dividendos de contratos de permutas financieras Gastos por intereses, excluidos contratos de permutas financieras	3(b) 3(b)	_	_	_	60.400	7	1.561	— 653	294	_	 54
Gastos por intereses de contratos de permutas financieras	3(b)	_	— 968	20.017	16.924	<u>·</u>	_	2.992	_	 148	
Gastos aplicados a préstamos de valores Comisión del Asesor de inversiones	6	439.516	651.859	39.917 18.677.738	10.000.372	7.101	25.498 14.817.070	4.371.881	13.983 11.358.537	574.422	1.290.038
Comisiones de rentabilidad Comisiones del Depositario	6 6	25.891	32.466	1.475.183	332.087	 504	468.415	 157.141	180.002	66.477	52.934
Comisiones de administración	6	58.767	40.138	415.435	291.499	9.035	521.695	184.117	307.872	79.521	94.480
Comisiones de distribución y servicio Comisión del Agente de transferencias	6	2.020 52.091	39.922 39.802	7.993 190.472	673.835 145.087	19 14.061	1.325.470 204.090	155.025 79.973	880.135 126.931	43.278 58.515	607 58.990
Taxe d'abonnement Honorarios de auditoría	5	11.994 12.112	24.777 12.111	530.009 19.406	373.293 11.951	180 10.355	653.065 14.230	177.300 17.286	400.288 19.406	44.021 12.111	46.122 12.374
Comisiones de la Sociedad Gestora	6	7.799	14.335	467.197	311.467	161	566.633	143.588	332.593	31.215	31.012
Comisiones de los miembros del Consejo de Administración Honorarios de abogados		244 15.149	259 8.467	15.651 97.448	9.608 87.726	3 3.478	21.064 105.103	3.834 13.615	10.335 98.148	1.226 9.603	793 22.449
Gastos de seguros		1.459	2.197 10.705	42.068	51.998 51.595	63	54.304	6.255	23.458 40.937	7.100 13.532	995
Gastos de imprenta Gastos de edición		8.556 6.245	2.862	56.998 6.437	6.501	4.183 654	69.639 10.531	23.745 5.465	5.205	3.383	7.757 5.141
Gastos de declaraciones tributarias Comisiones del Agente de pagos		40.642 25.283	28.856 25.345	38.206 25.283	36.954 21.770	16.760 10.598	43.235 25.332	39.564 25.283	37.368 25.290	30.695 25.487	24.895 25.283
Gastos de declaraciones reglamentarias		33.941	29.203	29.724	21.557	8.285	31.793	36.832	41.216	31.688	45.917
Otros gastos		20.001 761.744	19.181 983.816	218.999 22.369.308	107.538 12.782.865	7.935 93.544	141.659 19.149.168	51.293 5.500.046	72.750 13.996.775	25.652 1.058.074	36.685 1.756.618
Menos: Exención del cobro de la comisión del Asesor de inversiones  Total gastos	6	161.869 <b>599.875</b>	105.337 <b>878.479</b>	22.369.308	12.782.865	82.980 <b>10.564</b>	23 19.149.145	5.500.046	13.996.775	4.593 <b>1.053.481</b>	47.606 <b>1.709.012</b>
Retención fiscal sobre los dividendos y otros ingresos de inversión	5	276.526	359.592	13.088.101	3.807.777	898	12.627.309	2.550.850	6.660.006	710.734	1.234
Ingresos/(Gastos) netos de operaciones inversión del ejercicio Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre valores de inversión		913.689 2.096.886	<b>793.185</b> 3.161.185	<b>68.288.009</b> 657.100.246	38.849.713 347.367.728	3.797 10.735	<b>44.095.264</b> 819.411.516	<b>4.441.592</b> 151.754.385	<b>5.548.795</b> 451.523.262	<b>964.914</b> 61.157.280	10.243.969 (4.388.327)
Plusvalía/(Minusvalía) materializada neta sobre transacciones de futuros y contratos de futuros		2.090.000	5.101.105								(
de clases de acciones de cobertura de duración Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de divisas, contratos de divisas a		_	_	1.516.640	2.431.774	(3)	(711.648)	559.474	5.608.558	(39.083)	(366.495)
plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones		483.227	185.083	(9.501.045)	19.615.204	_	(1.874.398)	(230.352)	(6.387.969)	(54)	(1.027.332)
Plusvalía/(Minusvalía) materializada neta sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de duración		_	_	_	_	_	_	_	_	_	_
Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de opciones Plusvalía/(minusvalía) materializada neta		2.580.113	3.346.268	649.115.841	369.414.706	10.732	816.825.470	152.083.507	450.743.851	61.118.143	(5.782.154)
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores de inversión		3.716.298	11.490.547	(574.243.268)	(8.570.069)	72.586	(96.996.327)	(30.383.514)	(8.860.569)	(6.236.553)	(34.400.488)
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores hipotecarios a plazo cubiertos Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre transacciones de futuros y contratos		_	_	_	_	_	_	_	_	_	_
de futuros de clases de acciones de cobertura de duración		_	_	(3.514.022)	(109.177)	(1.049)	2.441.031	(22.319)	(256.140)	(181.007)	266.587
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente de contratos de divisas a plazo sobre bonos no entregables		_	_	_	_	_	_	_	_	_	_
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de divisas, contratos de		(2.934)	(994)	(152.561)	(910.462)	2	(1.368.225)	(185.513)	(394.015)		329.066
divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de permutas		(2.934)	(994)	(152.561)	(910.462)	2	(1.300.225)	(100.013)	(394.015)	_	329.000
financieras y contratos de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de duración		_	_				_	_	_	_	_
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de opciones											
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente Plusvalía/(minusvalía) neta de operaciones del ejercicio		3.713.364 7.207.166	11.489.553 15.629.006	(577.909.851) 139.493.999	(9.589.708) 398.674.711	71.539 86.068	(95.923.521) 764.997.213	(30.591.346) 125.933.753	(9.510.724) 446.781.922	(6.417.560) 55.665.497	(33.804.835) (29.343.020)
· idotalia/illinactalia/ lieta de operaciones del ejercicio		7.207.100	10.020.000	100.700.000	000.01 7.7 11	00.000	10-1.001.210	.20.000.700	A-0.101.022	00.000.401	(-0.070.020)

<sup>(</sup>a) Consulte el Anexo III (sin auditar).

<sup>(</sup>b) Consulte la Nota 3(i).

Las plusvalías y minusvalías se derivaron únicamente de operaciones continuas. No se produjeron plusvalías ni minusvalías aparte de las reflejadas en la Cuenta de pérdidas y ganancias.

	Notas	Emerging Markets Corporate Bond Portfolio USD	Emerging Markets Debt Blend Portfolio USD	Emerging Markets Debt Local Portfolio USD	Emerging Markets Debt Portfolio USD	ESG-Enhanced Emerging Markets Short Duration Bond Portfolio <sup>(a)</sup> USD	ESG-Enhanced Euro Short Duration Bond Plus Portfolio <sup>(a)</sup> EUR	ESG-Enhanced Europe High Yield Bond Portfolio <sup>(a)</sup> EUR		ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio <sup>(a)</sup> GBP	Global Credit Portfolio (Hedged) USD
Ingresos Ingresos por dividendos excepto contratos de permutas financieras y contratos por diferencia Ingresos por intereses (excepto de contratos de permutas financieras) Ingresos por intereses de contratos de permutas financieras (Amortización) neta/Acumulación neta	3(b) 3(b) 3(b) 3(b)	69.886 191.411.361 2.353.911 1.095.092	10.551 42.254.776 1.863.170 528.070	44.743 77.647.452 3.766.885 4.215.631	35.142 241.219.963 8.736.351 9.101.383	461 3.148.463 — (357.868)	5.670.107 134.195 (3.144.028)	3.075.178 58.159	771 1.914.398 70.290 (182.295)	21 870.686 42.493 (189.964)	28.726 42.232.444 3.617.610 (5.847.809)
Ingresos por intereses de préstamo de valores Otros ingresos	6	194.930.250	44.656.567	85.674.711	259.092.839	2.791.056	2.660.274	3.133.337	10.618 1.813.782	723.236	40.030.971
Gastos Gastos por intereses de descubiertos bancarios	2/h)		1.314				43.708	9.118	491		
Gastos por dividendos de contratos de permutas financieras	3(b) 3(b)	2.652	1.314	2.868	21.821	56 —	_	_	_	68	2.727
Gastos por intereses, excluidos contratos de permutas financieras Gastos por intereses de contratos de permutas financieras	3(b) 3(b)	_	=	=	84.514	50 —	11.556	492 2.960	180 —	1.045	4.519 36.035
Gastos aplicados a préstamos de valores Comisión del Asesor de inversiones	6	31.155.132	3.129.212	10.512.316	35.223.423	348.302	1.034.770	481.049	244.242	121.414	5.143.521
Comisiones de rentabilidad Comisiones del Depositario	6	509.965	386.323	702.842	846.152	26.303	153.740	40.900	39.963	76.413	402.573
Comisiones de administración Comisiones de distribución y servicio	6	535.171 141.123	204.277 3.627	309.800 47.872	726.247 2.123.555	60.210 2.416	101.054 12.888	50.472 6.060	57.305 669	20.226	310.460 103.414
Comisión del Agente de transferencias Taxe d'abonnement	6 5	202.755 807.122	33.764 84.761	97.527 193.110	303.797 1.102.015	47.181 22.227	33.575 107.434	36.010 17.576	43.240 5.563	15.414 8.268	131.962 292.734
Honorarios de auditoría Comisiones de la Sociedad Gestora	6	19.405 680.536	17.286 90.459	24.279 185.858	26.399 1.013.382	17.286 17.730	14.471 77.678	14.471 12.638	8.752 5.145	16.968 7.237	24.279 235.882
Comisiones de los miembros del Consejo de Administración Honorarios de abogados	6	25.588 124.446	5.729 15.769	9.128 27.400	33.098 105.083	457 15.431	1.872 10.287	429 11.634	351 17.184	131 5.655	10.082 24.427
Gastos de imprenta		20.992 94.950	5.623 18.661	11.255 33.115	52.452 107.056	2.981 10.020	6.007 12.225	1.929 8.439	2.224	5.233	12.811 43.940
Gastos de edición Gastos de declaraciones tributarias		9.855 43.235	3.644 33.199	7.288 40.002	18.585 56.526	5.205 41.672	1.959 22.918	3.554 28.610	5.367 22.911	922 17.850	8.103 41.439
Comisiones del Agente de pagos Gastos de declaraciones reglamentarias		25.567 45.840	25.451 32.699	25.644 39.040	44.059 59.088	25.283 39.427	21.704 26.627	21.705 30.455	25.283 26.737	19.554 21.354	25.283 40.103
Otros gastos		156.916 34.601.250	71.813 4.163.611	106.493 12.375.837	206.504 42.153.756	19.009 701.246	19.890 1.714.363	27.564 806.065	505.607	35.014 372.766	54.383 6.948.677
Menos: Exención del cobro de la comisión del Asesor de inversiones  Total gastos	6	34.601.250	4.163.611	12.375.815	42.153.756	239.225 <b>462.021</b>	183.268 <b>1.531.095</b>	124.130 <b>681.935</b>	147.829 <b>357.778</b>	186.350 <b>186.416</b>	6.948.677
Retención fiscal sobre los dividendos y otros ingresos de inversión Ingresos/(Gastos) netos de operaciones inversión del ejercicio	5	35.553 160.293.447	94.311 <b>40.398.645</b>	293.571 73.005.325	216.939.083	2.328.989	76 1.129.103	2.451.400	4.849 1.451.155	2.085 <b>534.735</b>	33.082.294
Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre valores de inversión Plusvalía/(Minusvalía) materializada neta sobre transacciones de futuros y contratos de futuros		26.569.894	9.758.025	9.167.452	38.919.496	308.642	(105.126)	115.221	184.475	651.434	32.030.344
de clases de acciones de cobertura de duración		(16.614.905)	(3.385.984)	1.748.523	(46.538.193)	340.425	112.559	161.368	(250.522)	(163.101)	(2.357.424)
Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de divisas, contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones		(62.171.757)	13.602.690	(30.190.138)	14.552.402	(776.006)	(4.337.545)	(70.310)	(673.017)	84.676	27.937
Plusvalía/(Minusvalía) materializada neta sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de duración		1.624.854	1.778.373	9.518.462	23.090.310	_	(587.356)	(50.447)	41.746	(135.934)	(1.189.077)
Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de opciones  Plusvalía/(minusvalía) materializada neta		(50.591.914)	(419.592) 21.333.512	(1.018.636) (10.774.337)	(1.389.324) 28.634.691	(126.939)	(4.917.468)	155.832	(697.318)	17.546 <b>454.621</b>	1.543.792 30.055.572
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores de inversión Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores hipotecarios a plazo cubiertos		(148.237.730)	(55.682.281)	(127.781.395)	(384.666.460)	(1.928.098)	1.150.054	13.636	(1.511.677)	(1.223.930)	(94.145.842)
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre transacciones de futuros y contratos de futuros de clases de acciones de cobertura de duración		4.657.870	693.280	(543.617)	13.229.080	(149.934)	18.497	(100.408)	32.698	5.961	4.013.185
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente de contratos de divisas a plazo sobre bonos no entregables		_	(203.798)	(476.688)	_	_	_	_	_	_	_
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de divisas, contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de permutas		(12.440.651)	(25.609.513)	(34.437.290)	(60.617.492)	(243.885)	247.874	58.267	83.004	(146.425)	(1.482.247)
financieras y contratos de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de duración		659.508	1.102.615	(5.080.393)	(3.816.504)	_	(451.827)	(25.799)	27.402	21.555	1.574.548
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de opciones  Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente		(155.361.003)	(407.052) ( <b>80.106.749</b> )	(974.256) (169.293.639)	(1.631.097) (437.502.473)	(2.321.917)	964.598	(54.304)	(1.368.573)	(10.045) (1.352.884)	(1.194.795) (91.235.151)
Plusvalía/(minusvalía) neta de operaciones del ejercicio		(45.659.470)	(18.374.592)	(107.062.651)	(191.928.699)	(119.867)	(2.823.767)	2.552.928	(614.736)	(363.528)	(28.097.285)

<sup>(</sup>a) Consulte el Anexo III (sin auditar).

	Notas	Global Fixed Income Portfolio USD	Global Fixed Income Portfolio (Hedged) EUR	Global High Yield Portfolio USD	Global Sovereign Bond Portfolio USD	Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio USD	US Dollar Short Duration Bond Portfolio USD	US Fixed Income Portfolio USD	US Mortgage Backed Securities Portfolio USD	Emerging Markets Multi-Asset Portfolio USD	ESG-Enhanced Global Multi-Asset Balanced Portfolio <sup>(a)</sup> USD
Ingresos Ingresos por dividendos excepto contratos de permutas financieras y contratos por diferencia Ingresos por intereses (excepto de contratos de permutas financieras) Ingresos por intereses de contratos de permutas financieras (Amortización) neta/Acumulación neta Ingresos por intereses de préstamo de valores Otros ingresos	3(b) 3(b) 3(b) 3(b) 6	3.441 4.405.340 215.207 (642.656)	24.728.978 1.996.230 (4.244.057)	390.591 161.978.193 9.260.052 (3.834.457) 307.469	6.711 13.898.987 1.530.827 (2.144.694)	9.083.576 157.341	5.593 8.412.664 85.159 (1.993.895)	6.880 3.952.739 330.027 (538.070)	9.767 9.397.486 368.101 (143.574)	211.271 470.453 15.301 (22.139)	2.033.529 696.928 44.264 (154.068)
•		3.981.332	22.481.151	168.101.848	13.291.831	9.240.917	6.509.521	3.751.576	9.631.780	674.886	2.620.653
Gastos Gastos por intereses de descubiertos bancarios Gastos por idividendos de contratos de permutas financieras Gastos por intereses, excluidos contratos de permutas financieras Gastos por intereses de contratos de permutas financieras Gastos por intereses de contratos de permutas financieras Gastos aplicados a préstamos de valores	3(b) 3(b) 3(b) 3(b) 6	692 — — —	217.635 — — —	922 	1.722 — — —	223 — — —	=	130 — — —	=	220 — — —	3.249 1.666 —
Comisión del Asesor de inversiones Comisiones de rentabilidad	6	812.469 —	3.221.473	14.890.732	3.286.565	1.728.144	861.904	806.660	583.423 —	297.970	1.125.914
Comisiones del Depositario Comisiones de administración Comisiones de distribución y servicio Comisión del Agente de transferencias Taxe d'abonnement	6 6 6 5	212.870 71.898 62.060 37.951 45.627	353.026 230.408 21.118 89.136 252.364	320.436 506.186 413.009 257.355 546.038	418.807 147.074 — 21.741 59.602	46.197 105.785 26.043 64.407 65.983	74.929 105.911 — 29.425 91.402	118.302 78.661 13.224 41.444 44.127	44.445 111.896 18.547 46.023 44.767	110.417 60.000 511 51.098 10.112	69.049 55.741 41.229 44.780 49.074
Honorarios de auditoría Comisiones de la Sociedad Gestora Comisiones de los miembros del Consejo de Administración Honorarios de abogados Gastos de seguros	6 6	24.280 35.763 1.215 8.842 2.166	20.321 206.383 7.412 18.602 6.083	26.399 493.243 18.266 105.267 29.834	17.287 59.836 3.501 15.612 3.995	17.286 36.849 1.180 10.608 7.570	17.288 60.508 2.083 14.760 6.709	24.280 28.455 814 10.438 1.137	24.279 39.815 2.171 10.247 713	19.405 8.506 137 66.243	12.112 44.862 648 14.780 2.491
Gastos de imprenta Gastos de edición Gastos de declaraciones tributarias Comisiones del Agente de pagos		12.743 2.898 29.776 25.283	33.368 5.005 31.888 21.704	84.474 16.952 53.652 50.331	12.638 1.821 26.257 25.283	16.150 7.026 39.643 25.283	15.639 1.561 28.087 25.283	14.839 3.643 31.614 25.285	14.152 3.903 33.019 25.283	7.748 5.466 37.488 25.283	10.474 2.863 29.096 25.283
Gastos de declaráciones reglamentarias Otros gastos		40.757 22.381	27.113 48.815	59.989 71.920	33.740 25.062	54.437 20.782	34.237 18.657	40.676 16.899	38.597 22.301	40.273 84.243	39.919 28.647
Menos: Exención del cobro de la comisión del Asesor de inversiones  Total gastos	6	1.449.671 146.541 1.303.130	4.811.854 — 4.811.854	17.984.441 — 17.984.441	4.160.543 — 4.160.543	2.273.596 43.363 <b>2.230.233</b>	1.388.383 85.884 <b>1.302.499</b>	1.300.628 40.250 <b>1.260.378</b>	1.063.581 19 <b>1.063.562</b>	825.120 441.097 <b>384.023</b>	1.601.877 127.517 <b>1.474.360</b>
Retención fiscal sobre los dividendos y otros ingresos de inversión	5	5.977	20.194	419.146	180.237		_	8.959	_	23.495	129.115
Ingresos/(Gastos) netos de operaciones inversión del ejercicio Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre valores de inversión		2.672.225 1.808.550	<b>17.649.103</b> 1.454.604	<b>149.698.261</b> 66.860.572	<b>8.951.051</b> 2.676.479	<b>7.010.684</b> 2.491.870	<b>5.207.022</b> (1.615.686)	<b>2.482.239</b> (935.416)	8.568.218 (8.754.826)	<b>267.368</b> 2.360.963	1.017.178 16.898.003
Plusvalia/(Minusvalia) materializada neta sobre transacciones de futuros y contratos de futuros de clases de acciones de cobertura de duración		(99.311)	(4.093.867)	(12.977.960)	(1.279.597)	496.735	(193.176)	1.288.525	713.918	(62.244)	612.820
Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de divisas, contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones		(940.287)	1.292.976	(74.582.770)	12.364.721	(495.535)	221	(118.763)	(284.922)	(285.895)	1.967.454
Plusválía/(Minusvalía) materializada neta sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de duración		(1.256.092)	(7.431.494)	14.073.816	(3.455.625)	497.677	(695.253)	(402.712)	205.422	2.059	283
Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de opciones		180.719 (306.421)	1.672.399	(6.626.342)	1.168.895 <b>11.474.873</b>	2.990.747	11.251 (2.492.643)	57.741	36.637	(492) <b>2.014.391</b>	452.008 19.930.568
Plusvalía/(minusvalía) materializada neta Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores de inversión		(8.802.901)	(7.105.382) 24.966.203	(96.747.748)	(44.031.278)	(4.706.541)	(5.796.757)	(3.613.068)	(8.083.771) (4.501.834)	(1.739.511)	(6.677.437)
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores hipotecarios a plazo cubiertos Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre transacciones de futuros y contratos		(2.170)	(196.960)	-	`	`	8.126	11.758	` 585.189́	·	· <u> </u>
de futuros de clases de acciones de cobertura de duración Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente de contratos de divisas a plazo sobre bonos		169.944	3.606.201	(531.699)	1.345.436	(647.543)	133.437	558.873	137.385	14.030	(283.235)
no entregables Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de divisas, contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de		(762.656)	(17.051.033)	(9.636.460)	966 (11.089.168)	(528.489)	331.439	105.036	(454.849)	(179.843)	(2.581.395)
duración Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de opciones		(36.319) (153.090)	(1.002.508) (1.560.939)	(12.446.018)	(5.253.754) (660.280)	(100.393)	(258.625)	(194.599) (49.767)	829.159 (120.761)	(21.311)	16.218 (197.071)
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente Plusvalía/(minusvalía) neta de operaciones del ejercicio		(9.587.192) (7.221.388)	8.760.964 19.304.685	(119.361.925) 23.709.994	(59.688.078) (39.262.154)	(5.982.966) 4.018.465	(5.582.380) (2.868.001)	(3.181.767) (810.153)	(3.525.711) (3.041.264)	(1.926.635) 355.124	(9.722.920) 11.224.826
(-)											

<sup>(</sup>a) Consulte el Anexo III (sin auditar).

	Notas	Global Multi-Asset Conservative Portfolio USD	Global Multi-Asset Growth Portfolio USD	Global Multi-Asset Income Portfolio USD	US Real Estate Balanced Portfolio USD	Emerging Markets Total Return Bond Portfolio USD	Global Absolute Return Portfolio USD	Global Dynamic Bond Portfolio <sup>(a)</sup> USD	Global Dynamic Bond Plus Portfolio <sup>(a)</sup> USD	Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged) EUR	Global Strategic Macro Bond Portfolio USD
Ingresos											
Ingresos por dividendos excepto contratos de permutas financieras y contratos por diferencia Ingresos por intereses (excepto de contratos de permutas financieras)	3(b) 3(b)	9.074.501	2.065.189	3.786.398 5.487.113	1.582.149 5.177.802	4.159 7.158.225	1.597.958 2.433.056	22.461 13.601.504	32.441 52.521.113	40.825.018	13.940 20.422.385
Ingresos por intereses (excepto de contratos de permutas financieras)	3(b)	_	_	5.467.113	107.102	375.398	387.156	339.921	5.585.810	2.377.438	548.969
(Amortización) neta/Acumulación neta	3(b)	_	_	(351.526)	601.234	373.379	(752.043)	(753.704)	196.414	(4.010.286)	(1.129.340)
Ingresos por intereses de préstamo de valores	6	_	_	_	_	_	_	_	_	_	_
Otros ingresos		9.074.501	2.065.189	8.921.985	7.468.287	7.911.161	3.666.127	13.210.182	58.335.778	39.192.170	19.855.954
Gastos											
Gastos por intereses de descubiertos bancarios Gastos por dividendos de contratos de permutas financieras	3(b) 3(b)	5.603	1.958	4.031	_	2.689	10.750 93.226	3.135	3.605	189.455	701 —
Gastos por intereses, excluidos contratos de permutas financieras	3(b)	2.606	5.042	16.482	_	1.738	20.700	_	_	_	_
Gastos por intereses de contratos de permutas financieras	3(b)	_	_	254	_	_	_	_	_	_	_
Gastos aplicados a préstamos de valores Comisión del Asesor de inversiones	6 6	3.138.642	1.626.921	3.583.393	2.222.960	64.908	749.828	28.628	6.412.917	2.901.587	2.184.182
Comisiones de rentabilidad	6	3.130.042	1.020.921	3.363.393	2.222.960	14.743	749.020	20.020	0.412.917	2.901.567	47.453
Comisiones del Depositario	6	59.454	37.118	136.893	41.833	194.948	172.331	364.568	422.776	511.496	327.070
Comisiones de administración	6 6	137.454 62.608	74.333 6.081	120.019 122.727	93.647 6.836	71.646 120	101.083 81	171.094 4.799	308.668 161.217	274.255 29.480	173.697 88.242
Comisiones de distribución y servicio Comisión del Agente de transferencias	6	47.238	38.434	116.528	59.481	31.661	40.649	42.078	136.774	73.476	92.586
Taxe d'abonnement	5	17.578	15.159	173.635	87.051	17.325	29.100	62.295	198.929	206.729	72.431
Honorarios de auditoría	6	12.112 71.556	12.112 29.249	19.405 116.828	17.286 55.920	17.287 17.263	24.280 27.440	24.280 62.591	24.279	20.321 186.049	24.279 67.803
Comisiones de la Sociedad Gestora Comisiones de los miembros del Consejo de Administración	6	7 1.556 2.645	1.143	961	55.920 1.114	964	1.440	3.669	180.047 7.359	9.745	2.258
Honorarios de abogados	O	18.180	15.911	69.402	20.705	19.758	21.729	15.087	24.514	24.324	13.398
Gastos de seguros		3.476	3.023	1.772	3.055	802	1.957	-		6.531	4.921
Gastos de imprenta Gastos de edición		13.692 3.122	10.035 2.862	15.450 6.329	16.583 4.944	8.121 3.644	10.196 4.529	13.355 4.566	35.930 11.604	32.464 5.167	16.921 9.262
Gastos de declaraciones tributarias		30.255	29.096	38.576	36.210	32.523	39.205	34.921	46.478	31.585	43.245
Comisiones del Agente de pagos		25.283	25.283	25.515	25.283	25.283	25.283	25.283	26.920	21.705	26.399
Gastos de declaraciones reglamentarias Otros gastos		37.060 31.718	39.388 24.403	45.228 43.023	38.339 23.060	36.844 31.363	43.893 107.278	37.322 50.685	44.236 63.327	23.056 67.831	55.798 62.868
01103 983103		3.720.282	1.997.551	4.656.451	2.754.307	593.630	1.524.980	948.572	8.109.580	4.615.256	3.313.514
Menos: Exención del cobro de la comisión del Asesor de inversiones	6		1	46.092		157.354	93.723	22.971			52.952
<b>Total gastos</b> Retención fiscal sobre los dividendos y otros ingresos de inversión	5	3.720.282	1.997.550	<b>4.610.359</b> 526.082	<b>2.754.307</b> 459.310	436.276	<b>1.431.257</b> 368.567	925.601	<b>8.109.580</b> 5.845	<b>4.615.256</b> 54.046	3.260.562
Ingresos/(Gastos) netos de operaciones inversión del ejercicio	5	5.354.219	67.639	3.785.544	4.254.670	7.474.885	1.866.303	12.284.581	50.220.353	34.522.868	16.595.392
Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre valores de inversión		11.937.407	9.684.212	2.707.859	11.559.129	289.839	4.773.754	(1.725.003)	1.645.791	11.587.038	(26.888.373)
Plusvalía/(Minusvalía) materializada neta sobre transacciones de futuros y contratos de futuros	5										
de clases de acciones de cobertura de duración Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de divisas, contratos de divisas a		530.812	4.058.049	8.775.912	724.947	(37.665)	4.800.429	6.431.816	(1.646.966)	(20.138.918)	7.549.605
plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones		3.120.812	274.774	1.702.234	(1.274.722)	10.629.448	(3.666.880)	46.637.636	13.342.098	(67.875.761)	(3.249.962)
Plusvalía/(Minusvalía) materializada neta sobre contratos de permutas financieras y contratos		_			_	2.395.084	(3.303.750)	(7.316.502)	(16.643.128)	(19.637.715)	(3.802.180)
de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de duración		1.661.423	988.419	(2 026 020)			4.018.726	,	,	,	,
Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de opciones  Plusvalía/(minusvalía) materializada neta		17.250.454	15.005.454	(3.836.920) 9.349.085	11.009.354	(118.506) <b>13.158.200</b>	6.622.279	2.089.216 <b>46.117.163</b>	7.506.886 <b>4.204.681</b>	3.798.083 (92.267.273)	5.551.047 (20.839.863)
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores de inversión		3.271.665	16.788.078	(6.060.494)	13.112.597	(8.514.974)	218.133	(15.657.997)	(46.718.275)	36.278.269	(10.965.736)
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores hipotecarios a plazo cubiertos		_	_	·	_	· –	_		· <u> </u>	(317.084)	
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre transacciones de futuros y contratos de futuros de clases de acciones de cobertura de duración		(892.502)	(1.513.997)	887.626	(226.125)	(328.581)	(635.794)	(3.359.414)	(2.148.889)	5.379.632	(761.064)
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente de contratos de divisas a plazo sobre bonos		(032.302)	(1.515.551)	007.020	(220.125)	(020.301)	(000.704)	(5.555.414)	(2.140.003)	3.37 3.032	(701.004)
no entregables Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de divisas, contratos de		_	_	_	_	(73.746)	_	_	_	_	(228.701)
divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de permutas		(3.385.509)	(121.139)	(2.876.510)	(196.318)	(9.679.187)	(10.291.932)	(44.305.935)	(39.869.723)	934.593	(7.074.492)
financieras y contratos de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de				4.6	100.15-	4 404 4	0.070.555	// /00 0==:	(00.740.055)	(10.015.715)	(0.1.17.10.1)
duración Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de opciones		(829.790)	(493.984)	1.957 699.921	129.105	1.161.175 (112.351)	3.272.597 (339.828)	(4.402.837) (1.873.655)	(22.749.688) (6.042.968)	(10.345.718) (4.509.502)	(2.147.181) (4.509.212)
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente  Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente		(1.836.136)	14.658.958	(7.347.500)	12.819.259	(17.547.664)	(7.776.824)	(69.599.838)	(117.529.543)	27.420.190	(25.686.386)
Plusvalía/(minusvalía) neta de operaciones del ejercicio		20.768.537	29.732.051	5.787.129	28.083.283	3.085.421	711.758	(11.198.094)	(63.104.509)	(30.324.215)	(29.930.857)

<sup>(</sup>a) Consulte el Anexo III (sin auditar).

Ingresco or dividendas excepto contratos de permutas financieras y contratos and prematos por infereneses excepto contratos de permutas financieras (%) \$ 3,005 \$ 2,005 \$ 2,007 \$ 33,005,007 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$ 2,000 \$		Notas	Strategic Absolute Return Bond II Portfolio USD	Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio USD	Global Corporate Portfolio (Hedged) NOK	Absolute Return Tracker Portfolio USD	Alternative Trend Portfolio USD	Total combinado ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021 USD
Ingresso por intereses (excepto de contratos de permutas financieras)  (a) 10, 344.3055	Ingresos Ingresos por dividendos excepto contratos de permutas financieras y contratos por diferencia	3(b)	2.806	7.989.449	_	4.321.171	15.783	533.825.387
Amortzacion) netal'Accumulacion netal' (1,430,307) (26,455,77) (25,365,877) (1,770,024) (1,430,307) (26,455,77) (25,365,877) (1,770,024) (1,430,307) (26,455,77) (25,365,877) (1,770,024) (1,430,307) (26,455,77) (25,365,877) (1,430,307) (26,457) (25,365,877) (25,365,877) (1,430,307) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457) (26,457)		3(b)		24.592				
Castos por interesse de descuhiertos bancarios   30   10   10   10   10   10   10   10	(Amortización) neta/Acumulación neta	3(b)		(367)				(25.385.877)
Gastios prilateress de descubiento bincarias Gastios proliterieses de fescubiento bincarias Gastios proliterieses de contratos de permutas financieras 3(b) 3(b)		6		1.193				2.586.663
Gastos por intereses de descubientos bancarios (30) 1.053 1.669 2.717.944 59.287 22.589 1.511.862 (2310) 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.000 2.0	v		4.084.514	8.014.867	366.678.741	6.952.202	1.767.702	
Gastos por dividendos de contratos de permulas financieras (30) Castos por interesse, excluídos contratos de permulas financieras (30) Castos por interesse, excluídos contratos de permulas financieras (30) Carisdos pilicados a priestamos de valores (30) Comisión del Asser de inversiones (30) Comisión del Asser de inversión del del pulsvalla (minusvalla) latentes del concisión del Asser de inversión del del pulsvalla (minusvalla) latentes del concisión del Asser de inversión del del pulsvalla (minusvalla) latente sobre valores de divisas a plazo especificos de una clase de acciones (30) Comisión del de la plusvalla (minusvalla) latentes de contratos de divisas a plazo cobertura de duración (30) Comisión del de la plusvalla (minusvalla) latentes debre contratos de devisas a plazo cobertura de duración (30) Comisión del de la pl		3(h)	1.053	1 660	2 717 044	50 287	22 580	1 511 862
Gastos apirications a pricisamose de valores   6   978.918   4.205.737   42.864.812   6.409.02   - 627.91   332.0708.818   32.0708.818   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718	Gastos por dividendos de contratos de permutas financieras	3(b)	_	_	_	79.693		172.919
Gastos apirications a pricisamose de valores   6   978.918   4.205.737   42.864.812   6.409.02   - 627.91   332.0708.818   32.0708.818   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0718   32.0708.818   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718   32.0718		3(b)			2.566.668	89.579	158.641	
Comisiones de Pertabilidad Comisiones de Depositarion   6   37.577   132.974   2.997.277   514.864   142.97   18.778.853   2.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.000   19.00	Gastos aplicados a préstamos de valores	6				<del>_</del>		191.075
Comisiones del Depositario	Comision del Asesor de inversiones Comisiones de rentabilidad	6 6		4.205.737	42.864.812	6.409.021	627.196	
Comisiones de distribución y servicio   6   3.4898   37.856   84.350   86.514   30.274   550.1751     Taxe d'abonnement   5   18.741   259.197   1.708.881   203.120   45.838   13.064.897     Honorations de audioricat de Gestora   6   16.77   20.081   1.798.81   203.120   45.838   13.048.897     Honorations de audioricat de Gestora   6   16.77   20.081   1.799.92   1.708.811   1.799.92   24.280   1.538.897     Honorations de audioricat de Gestora   6   16.77   20.081   1.799.92   1.708   1.708   24.280   1.538.798     Honorations de abougados   6   16.77   20.081   1.799.92   1.708   2.4280   1.7078   2.2871   1.7078   2.7971   1.708.811   1.708.811   1.709.92   1.7078   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971   2.7971	Comisiones del Depositario	6	307.157					18.376.853
Comisioned la flagentide trainsferencias   6   34.888   37.856   84.350   86.514   30.274   5.661.151   Taxe d'abbonnement   5   13.741   25.9197   17.08.881   20.3120   45.338   310.4.897   Honoranios de aludinate d'Gestora   6   6   70.500   70.3120   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.32200   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220   70.3220				154.144	2.402.377		119.032	
Honorarios de auditoria   24 280   12 112   194,956   17,287   24 280   11,513.878   24 281   11,513.878   24 281   11,513.878   24 281   11,513.878   24 281   11,513.878   24 281   11,513.878   24 281   11,513.878   24 281   11,513.878   24 281   11,513.878   24 281   11,513.878   24 281   11,513.878   24 281   11,513.878   24 281   11,513.878   24 281   11,513.878   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281   24 281	Comisión del Agente de transferencias		34.898			86.514		5.661.151
Comisiones de la Sociedad Gestora   6   16.717   206.691   1714.592   164.263   42.913   10.882.771   30.798   10.0079   3.6113   99.813   4.076   2.317   379.798   10.0079   3.6113   99.813   4.076   2.317   379.798   10.0079   3.6113   99.813   4.076   2.317   379.798   10.0079   3.6113   99.813   4.076   2.317   379.798   10.0079   3.6113   99.813   4.076   2.317   379.798   2.008.710   3.6153   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   3.613   39.813   3.0079   37.0079   39.813   30.0079   37.0079   39.813   30.0079   37.0079   39.813   30.0079   37.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   30.0079   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813   39.813		5	18.741 24.280				45.838 24.280	
Honorarios de abogados   10,959   16,716   180,477   31,922   17,078   2,080,710   Gastos de seguros   1,184   7,934   37,899   21,028   2,136   592,529   Gastos de edición   3,844   7,934   37,899   2,1450   33,260   10,800   1,853,429   Gastos de edición   3,844   2,800   2,214   3,3260   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891   2,338,891	Comisiones de la Sociedad Gestora		16.717	206.691	1.714.592	164.263	42.913	10.882.771
Gastos de seguros		ь						
Gastos de edicariaciones tributarias Castos de edicariaciones tributarias Castos de edicariaciones tributarias Comisiones del Agente de pagos Castos de edicariaciones reglamentarias Circia gastos Castos de edicariaciones reglamentarias Circia gastos Comisiones del Agente de pagos Castos de edicariaciones reglamentarias Circia gastos Cir	Gastos de seguros		1.184	7.934	37.899	21.028	2.136	592.529
Gastos de declaraciones tributarias (29.59s   27.45p   37.35p   27.377   2.165.538   25.05m								
Salas de declaraciones réglamentarias   38.802   37.076   336.754   43.644   38.579   2.34.031   2.305   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.3052   2.30					220 421		27.377	
Menos: Exención del cobro de la comisión del Asesor de inversiones   6								
Menos: Exención del cobro de la comisión del Asesor de inversiones   6								
Total gastos   Retención fiscal sobre los dividendos y otros ingresos de inversión   5	Menos: Exención del cobro de la comisión del Asesor de inversiones	6			36.391.630		1.302.907	
Plusvalla/(minusvalla) materializada neta sobre valores de inversión del ejercicio (2.540.083)   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776, 978   1.986.776	Total gastos	_	1.179.268		58.591.650		1.362.967	
Plusvalia/(minusvalia) materializada neta sobre valores de ínversión Plusvalia/(Minusvalia) materializada neta sobre transacciones de futuros y contratos de futuros de clases de acciones de cobertura de duración Plusvalia/(minusvalia) materializada neta sobre contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo e contratos de divisas a plazo sobre transacciones de cobertura de duración variación neta de la plusvalia/(minusvalia) latente sobre valores hipotecarios a plazo cubiertos variación neta de la plusvalia/(minusvalia) latente sobre transacciones de futuros y contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones de cobertura de duración variación neta de la plusvalia/(minusvalia) latente sobre contratos de divisas a plazo sobre bonos no entregables  Variación neta de la plusvalia/(minusvalia) latente sobre contratos de divisas a plazo sobre bonos no entregables  Variación neta de la plusvalia/(minusvalia) latente sobre contratos de divisas a plazo sobre bonos no entregables  Variación neta de la plusvalia/(minusvalia) latente sobre contratos de divisas a plazo sobre bonos no entregables  Variación neta de la plusvalia/(minusvalia) latente sobre contratos de divisas contratos de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de duración  Variación neta de la plusvalia/(minusvalia) latente sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas finan		5	2.905.246		308.087.091		404.735	
de clases de acciones de cobertura de duración   560.362   - (155.761.069)   7.211.548   35.987.539   (27.492.529)     Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones   6.164.942   4.197.699   1.030.689.475   (34.345.116)   (8.845.934)   (108.616.445)     Plusvalía/(Minusvalía) materializada neta sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de duración   740.754   - 15.970.997   8.298.282   - 35.918.976     Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de opciones   740.754   - 15.970.997   8.298.282   - 35.918.976     Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de opciones   740.754   - 15.970.997   8.298.282   - 35.918.976     Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre valores de inversión   (2.214.234)   (42.170.416)   (356.029.440)   1.720.738   (104.872)   (1.606.372.568)     Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores hipotecarios a plazo cubiertos   (276.750)   - 80.910.489   (7.246.731)   (9.170.439)   14.776.639     Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de divisas a plazo sobre bonos no entregables   (27.254.90)   (990.341)   (1.390.109.012)   (8.260.891)   (5.048.312)   (500.415.345)     Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras en clases de acciones de acciones de acciones de cobertura de duración   (276.750)   (990.341)   (1.390.109.012)   (8.260.891)   (5.048.312)   (500.415.345)     Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de duración   (1.544.828)   (990.341)   (1.390.109.012)   (8.260.891)   (5.048.312)   (73.551.815)   (73.551.815)   (73.551.815)   (73.551.815)   (73.551.815)   (73.551.815)   (73.551.815)   (73.551.815)   (73	Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre valores de inversión							
Plusvalia/(Minusvalia) materializada neta sobre contratos de permutas financieras y contratos de operator de duración (3.709.447)	de clases de acciones de cobertura de duración		560.362	_	(155.761.069)	7.211.548	35.987.539	(27.492.529)
de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de duración Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de opciones Plusvalía/(minusvalía) materializada neta Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores de inversión Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores hipotecarios a plazo cubiertos Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores hipotecarios a plazo cubiertos Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores hipotecarios a plazo cubiertos Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores hipotecarios a plazo cubiertos Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre transacciones de futuros y contratos de futuros de clases de acciones de cobertura de duración Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente de contratos de divisas a plazo sobre bonos no entregables Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de divisas, contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de duración Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de duración Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de duración Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de opciones  (5.225.490) (990.341) (1.390.109.012) (8.260.891) (5.048.312) (500.415.345)  (5.048.315) (5.048.315) (5.048.315) (7.3551.815)  (7.3551.815) (7.3551.815) (7.3551.815) (7.3551.815) (7.3551.815) (7.3551.815) (7.3551.815) (7.3551.815) (7.3551.815) (7.3551.815) (7.3551.815) (7.3551.815) (7.3551.815) (7.3551.815) (7.3551.815) (7.3551.815) (7.3551.815) (	plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones		6.164.942	4.197.699	1.030.689.475	(34.345.116)	(8.845.934)	(108.616.445)
Plusvalia/(minusvalia) materializada neta sobre contratos de opciones   740.754   15.970.997   8.298.282   35.918.976			(3.709.447)	_	(39.047.371)	5.743.493	555.104	(19.958.002)
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores de inversión Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores hipotecarios a plazo cubiertos Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre transacciones de futuros y contratos de futuros de clases de acciones de cobertura de duración Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de divisas a plazo sobre bonos no entregables Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de divisas a plazo sobre bonos divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de duración Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de opciones  Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de duración Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de opciones  Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de opciones  (5.225.490) (990.341) (1.390.109.012) (8.260.891) (5.048.312) (500.415.345)  (699.472) — (6.450.971) (8.164.818) (1.314.389) (73.551.815)  (699.472) — (14.605.973) (2.049.051) (2.197.133.339)	Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de opciones							
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores hipotecarios a plazo cubiertos Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre transacciones de futuros y contratos de futuros de clases de acciones de cobertura de duración (276.750) — 80.910.489 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (7.246.731) (9.170.439) 14.776.639 (9.170.439) (9.170.439) 14.776.639 (9.170.439) (9.170.439) 14.776.639 (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) 14.776.639 (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.170.439) (9.17								
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente de contratos de divisas a plazo sobre bonos no entregables  Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de divisas, contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones  Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de permutas  financieras y contratos de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de duración  Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de opciones  (5.225.490) (990.341) (1.390.109.012) (8.260.891) (5.048.312) (500.415.345)  (6.0450.971) (8.164.819) (7.3551.815)  Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de opciones  (6.99.472) - (14.605.973) (2.049.051) - (30.579.527)  Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente  (9.960.774) (43.160.757) (1.686.284.907) (24.000.754) (15.638.012) (2.197.133.339)	Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores hipotecarios a plazo cubiertos		(2.214.234)	(42.170.410)	(330.029.440)	1.720.730	(104.072)	
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de permutas financieras y contratos de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de duración Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de opciones (1.544.828) — (6.450.971) (8.164.819) (7.3.551.815) (8.9.472) — (14.605.973) (2.049.051) — (30.579.527) (8.9.60.774) (8.164.819) (9.9.60.774) (9.9.60.775) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907) (1.686.284.907)	Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente de contratos de divisas a plazo sobre bonos		(276.750)	_	80.910.489	(7.246.731)	(9.170.439)	
divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de opernutas financieras y contratos de permutas financieras en clases de acciones de cobertura de duración Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de opciones  (5.225.490) (990.341) (1.390.109.012) (8.260.891) (5.048.312) (500.415.345) (609.472) (6.450.971) (8.164.819) (73.551.815) (609.472) (609.472) (1.605.973) (2.049.051) (2.049.051) (30.579.527)  Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente (9.960.774) (43.160.757) (1.686.284.907) (2.000.754) (15.638.012) (2.197.133.339)			_	_	_	_	_	(981.967)
Variación néta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de opciones       (699.472)       — (14.605.973)       (2.049.051)       — (30.579.527)         Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente       (9.960.774)       (43.160.757)       (1.686.284.907)       (24.000.754)       (15.638.012)       (2.197.133.333)	divisas a plazo y contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre contratos de permutas		, ,	(990.341)	,	,	(5.048.312)	,
	Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre contratos de opciones	1	(699.472)	(43 160 757)	(14.605.973)	(2.049.051)	`	(30.579.527)

Patrimonio al comienzo del ejercicio Reversión del método de cálculo del Valor liquidativo oscilante Ganancias procedentes de la emisión de acciones Pago por reembolso de acciones Plusvalía/(minusvalía) neta de operaciones del ejercicio Dividendos Ajuste de divisas
Patrimonio a 30 de noviembre de 2021
Ajuste por dilución
Patrimonio (después del ajuste por dilución)

<sup>(</sup>a) Consulte el Anexo III (sin auditar).

Portfolio Portfolio ESG Portfolio Po	
202.768.057 90.487.191 173.679.716 4.093.321.631 236.030.810 15.646.516 29.087.611 1.025.963.124 45.495.4	73 3.320.855.483
7 158.593.449 52.350.987 654.442.333 2.536.943.039 1.149.722.422 12.904.442 72.826.413 810.922.174 341.297.0	24 1.729.330.588
7 (100.501.993) (73.749.326) (62.480.766) (1.663.342.170) (108.982.390) (3.769.672) (38.146.786) (310.950.468) (59.109.5 (22.123.272) (7.125.216) (14.486.444) 209.457.658 88.361.589 2.413.842 9.193.989 225.164.840 4.492.3	
8 (108.614) (6.196) (102.827) (17.582.264) (646) (72.017) (17.667) (780.673)	
17	
<u>238.627.627</u> 61.957.440 750.636.179 5.158.797.894 1.365.131.785 <u>27.123.111</u> 72.943.560 1.751.037.674 332.175.	20 5.618.990.575
3(k)	
238.627.627 61.957.440 752.212.515 5.158.797.894 1.365.131.785 27.123.111 72.943.560 1.751.037.674 332.175.	20 5.618.990.575

Patrimonio al comienzo del ejercicio
Reversión del método de cálculo del Valor liquidativo oscilante
Ganancias procedentes de la emisión de acciones
Pago por reembolso de acciones
Plusvalia/(minusvalia) neta de operaciones del ejercicio
Dividendos
Ajuste de divisas

Patrimonio a 30 de noviembre de 2021

Ajuste por dilución

Patrimonio (después del ajuste por dilución)

Notas	Global Millennials Equity Portfolio USD	India Equity Portfolio USD	Japan Equity Partners Portfolio <sup>(b)(c)</sup> JPY	Japan Equity Portfolio <sup>(b)(c)</sup> JPY	US Equity Portfolio USD	US Focused Growth Equity Portfolio USD	US Small Cap Equity Portfolio <sup>(a)</sup> USD	US Technology Opportunities Equity Portfolio USD	Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio <sup>(a)</sup> USD	Global Infrastructure Equity Portfolio USD
	1.319.157.105	1.479.688.982	178.517.294	126.195.862	710.813.001	37.166.559	36.023.808	84.444.356	_	13.370.168
3(k)	_	_	_	_	_	_	_	(25.326)	_	_
7	2.170.111.785	1.014.504.131	183.646.681	92.373.946	169.313.352	12.312.497	40.544.817	417.824.790	5.010.386	39.841.278
7	(806.261.406)	(776.093.273)	(79.364.761)	(50.086.798)	(165.804.094)	(10.206.273)	(7.067.836)	(88.660.014)	(10.000)	(11.547.896)
	201.269.547	664.220.555	33.128.771	20.810.009	` 174.744.343	` 10.595.015	10.989.020	75.185.059	(34.840)	` 1.396.989
8	(7.921)	(1.225.970)	(16.081)	(65.228)	(125.608)	_	_	_	(34)	(7.476)
17					_	_				
	2.884.269.110	2.381.094.425	315.911.904	189.227.791	888.940.994	49.867.798	80.489.809	488.768.865	4.965.512	43.053.063
3(k)	_	_	_	_	_	_	_	_	_	_
	2.884.269.110	2.381.094.425	315.911.904	189.227.791	888.940.994	49.867.798	80.489.809	488.768.865	4.965.512	43.053.063
										-

<sup>(</sup>a) Consulte el Anexo III (sin auditar).
(b) Expresado en miles.

<sup>(</sup>c) Consulte la Nota 3(i).

Patrimonio al comienzo del ejercicio Reversión del método de cálculo del Valor liquidativo oscilar Ganancias procedentes de la emisión de acciones Pago por reembolso de acciones Plusvalla/(minusvalla) neta de operaciones del ejercicio Dividendos	nte
Ajuste de divisas Patrimonio a 30 de noviembre de 2021	
Ajuste por dilución	
Patrimonio (después del ajuste por dilución)	

<sup>(</sup>a) Consulte el Anexo III (sin auditar). (c) Consulte la Nota 3 (i).

Notas	Global Real Estate Equity Portfolio USD	North America Energy & Energy Infrastructure Equity Portfolio USD	Emerging Markets CORE® Equity Portfolio® USD	Europe CORE® Equity Portfolio EUR	Eurozone CORE® Equity Portfolio <sup>(a)</sup> EUR	Global CORE® Equity Portfolio <sup>©</sup> USD	Global Small Cap CORE® Equity Portfolio <sup>(c)</sup> USD	US CORE® Equity Portfolio <sup>(c)</sup> USD	US Small Cap CORE® Equity Portfolio <sup>(c)</sup> USD	Asia High Yield Bond Portfolio USD
Notas					LUK					
- 4.	38.924.838	39.222.744	2.714.209.308	1.853.562.539	_	3.741.624.886	455.713.402	1.745.560.224	216.142.387	30.829.396
3(k)			<del></del>	<del></del>		<del></del>	<del></del>	<del></del>	<del></del>	
7	14.773.563	24.469.240	1.129.071.840	483.129.263	3.999.864	1.144.879.018	424.425.289	1.070.137.242	38.363.711	492.530.498
7	(17.487.389)	(24.729.732)	(1.135.564.702)	(985.687.342)	_	(1.367.732.631)	(290.768.004)	(1.267.492.485)	(119.355.485)	(89.759.037)
	7.207.166	15.629.006	139.493.999	398.674.711	86.068	764.997.213	125.933.753	446.781.922	55.665.497	(29.343.020)
8	(475.812)	(100.370)	(2.908.523)	(3.609.861)	_	(2.272.655)	(711.863)	(1.148.900)	(38.031)	(2.603.098)
17	_									
	42.942.366	54.490.888	2.844.301.922	1.746.069.310	4.085.932	4.281.495.831	714.592.577	1.993.838.003	190.778.079	401.654.739
3(k)	_	_	_	_	_	_	_	(397.377)	_	
	42.942.366	54.490.888	2.844.301.922	1.746.069.310	4.085.932	4.281.495.831	714.592.577	1.993.440.626	190.778.079	401.654.739

Patrimonio al comienzo del ejercicio
Reversión del método de cálculo del Valor liquidativo oscilante
Ganancias procedentes de la emisión de acciones
Pago por reembolso de acciones
Plusvalia/(minusvalia) neta de operaciones del ejercicio
Dividendos
Ajuste de divisas

Patrimonio a 30 de noviembre de 2021

Ajuste por dilución

Patrimonio (después del ajuste por dilución)

(a) Consulte el Anexo III (sin auditar).

Notas	Emerging Markets Corporate Bond Portfolio USD	Emerging Markets Debt Blend Portfolio USD	Emerging Markets Debt Local Portfolio USD	Emerging Markets Debt Portfolio USD	Emerging Markets Short Duration Bond Portfolio <sup>(a)</sup> USD	ESG-Enhanced Euro Short Duration Bond Plus Portfolio <sup>(a)</sup> EUR	ESG-Enhanced Europe High Yield Bond Portfolio <sup>(a)</sup> EUR	ESG-Enhanced Global Income Bond Portfolio <sup>(a)</sup> USD	ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio <sup>(a)</sup> GBP	Global Credit Portfolio (Hedged) USD
	3.601.827.353	1.054.798.705	1.715.001.987	6.500.406.621	66.915.736	296.507.391	63.455.616	20.739.856	30.382.815	1.367.572.539
3(k)	_	_	_	_	_	_	_	_	_	_
7	2.484.027.536	30.241.848	349.798.111	1.287.098.743	19.069.304	219.017.532	64.755.817	45.400.599	9.972.428	1.099.874.813
7	(1.757.525.279)	(385.618.434)	(319.283.480)	(2.837.591.708)	(33.411.869)	(105.097.295)	(24.348.153)	(22,449,050)	(10.982.740)	(910.752.200)
	(45.659.470)	(18.374.592)	(107.062.651)	(191.928.699)	(119.867)	(2.823.767)	2.552.928	(614.736)	(363.528)	(28.097.285)
8	(25.070.257)	(21.221.257)	(64.092.744)	(79.906.499)	(446.787)	(287.877)	(174.553)	(18.412)	(610.359)	(8.368.392)
17	`	`	`	`	`	`	`	`	`	`
	4.257.599.883	659.826.270	1.574.361.223	4.678.078.458	52.006.517	407.315.984	106.241.655	43.058.257	28.398.616	1.520.229.475
3(k)		_	_	_	(192.424)	(366.584)	_	_	_	_
	4.257.599.883	659.826.270	1.574.361.223	4.678.078.458	51.814.093	406.949.400	106.241.655	43.058.257	28.398.616	1.520.229.475

ESG Enhanced

Patrimonio al comienzo del ejercicio
Reversión del método de cálculo del Valor liquidativo oscilante
Ganancias procedentes de la emisión de acciones
Pago por reembolso de acciones
Plusvalia/(minusvalia) neta de operaciones del ejercicio
Dividendos
Ajuste de divisas

Patrimonio a 30 de noviembre de 2021

Ajuste por dilución

Patrimonio (después del ajuste por dilución)

(a) Consulte el Anexo III (sin auditar).

Notas	Global Fixed Income Portfolio USD	Global Fixed Income Portfolio (Hedged) EUR	Global High Yield Portfolio USD	Global Sovereign Bond Portfolio USD	Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio USD	US Dollar Short Duration Bond Portfolio USD	US Fixed Income Portfolio USD	US Mortgage Backed Securities Portfolio USD	Emerging Markets Multi-Asset Portfolio USD	Global Multi-Asset Balanced Portfolio <sup>(a)</sup> USD
NOTAS_										
	175.765.011	1.063.970.870	3.071.998.576	596.951.465	184.388.293	335.966.551	140.977.740	402.526.611	25.030.407	108.581.751
3(k)	_	(1.169.082)	_	(894.086)	_	201.701	_	_	_	_
7	145.780.047	585.118.412	1.136.032.264	150.784.723	74.499.883	319.382.125	283.345.761	54.387.427	2.526.161	55.271.058
7	(188.109.215)	(440.477.188)	(1.109.739.761)	(159.379.680)	(64.869.028)	(217.915.072)	(209.670.328)	(150.852.787)	(9.885.922)	(40.045.963)
	(7.221.388)	19.304.685	23.709.994	(39.262.154)	4.018.465	(2.868.001)	(810.153)	(3.041.264)	355.124	11.224.826
8	(1.331.228)	(7.190.764)	(56.377.066)	(1.590)	(1.366.306)	` (937.417)	(160.672)	(10.093.364)	(902,928)	(303.464)
17				_						
_	124.883.227	1.219.556.933	3.065.624.007	548.198.678	196.671.307	433.829.887	213.682.348	292.926.623	17.122.842	134.728.208
3(k)	_	_	_	_	_	130.149	_	_	_	_
	124.883.227	1.219.556.933	3.065.624.007	548.198.678	196.671.307	433.960.036	213.682.348	292.926.623	17.122.842	134.728.208

ESG Enhanced

Patrimonio al comienzo del ejercicio Reversión del método de cálculo del Valor liquidativo oscilar Ganancias procedentes de la emisión de acciones Pago por reembolso de acciones Plusvalla/(minusvalía) neta de operaciones del ejercicio Dividendos Ajuste de divisas	nte
Patrimonio a 30 de noviembre de 2021	
Ajuste por dilución	
Patrimonio (después del ajuste por dilución)	

<sup>(</sup>a) Consulte el Anexo III (sin auditar).

Notas _	Global Multi-Asset Conservative Portfolio USD	Global Multi-Asset Growth Portfolio USD	Global Multi-Asset Income Portfolio USD	US Real Estate Balanced Portfolio USD	Emerging Markets Total Return Bond Portfolio USD	Global Absolute Return Portfolio USD	Global Dynamic Bond Portfolio <sup>(a)</sup> USD	Global Dynamic Bond Plus Portfolio <sup>(a)</sup> USD	Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged) EUR	Global Strategic Macro Bond Portfolio USD
3(k)	460.892.956	197.157.338	103.079.790	213.501.225	162.796.105	216.935.475 (151.749)	598.033.162	1.355.991.657	1.617.987.777	491.905.676 (638.647)
7	96.014.983	39.680.435	599.048.282	26.746.443	1.283.209	281.433.929	6.661.473	218.338.765	1.551.658.407	120.230.741
7	(99.846.567)	(49.225.936)	(137.750.013)	(38.565.112)	(3.238.355)	(163.340.016)	(8.020.463)	(230.342.691)	(1.251.130.494)	(214.150.562)
8	20.768.537 (505.709)	29.732.051 (43.502)	5.787.129 (14.589.147)	28.083.283 (1.753.572)	3.085.421 (3.823)	711.758 (658.968)	(11.198.094) (419.299)	(63.104.509) (29.105.096)	(30.324.215) (18.618.909)	(29.930.857) (1.809.970)
17	(000.700)	(40.002)	(14.000.147)	(1.700.072)	(0.020)	(000.000)	(+10.200)	(20.100.000)	(10.010.000)	(1.000.070)
_	477.324.200	217.300.386	555.576.041	228.012.267	163.922.557	334.930.429	585.056.779	1.251.778.126	1.869.572.566	365.606.381
3(k)	_	_	_	_	_	_	_	_	_	_
	477.324.200	217.300.386	555.576.041	228.012.267	163.922.557	334.930.429	585.056.779	1.251.778.126	1.869.572.566	365.606.381

	Notas	Strategic Absolute Return Bond II Portfolio USD	Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio USD	Global Corporate Portfolio (Hedged) NOK	Absolute Return Tracker Portfolio USD	Alternative Trend Portfolio USD	ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021 USD
Patrimonio al comienzo del ejercicio Reversión del método de cálculo del Valor liquidativo oscilante Ganancias procedentes de la emisión de acciones Pago por reembolso de acciones Plusvalla/(minusvalía) neta de operaciones del ejercicio Dividendos Ajuste de divisas	3(k) 7 7 8 17	88.455.779 40.781.777 (44.582.729) (5.839.000) (144.823)	714.875.939 500.764 262.971.283 (458.379.170) 121.912.728 (406.171)	17.358.002.750 14.870.879 (192.884.635)	751.370.877 940.039.326 (509.547.265) (864.671)	363.054.742 229.692.544 (87.604.924) 12.205.275 (252.208)	57.791.633.707 (2.106.871) 32.135.588.977 (23.950.882.936) 4.714.489.102 (387.730.591) (653.726.800)
Patrimonio a 30 de noviembre de 2021		78.671.004	641.475.373	17.179.988.994	1.180.998.267	517.095.429	69.647.264.588
Ajuste por dilución	3(k)	_	_	_	354.299	_	1.053.865
Patrimonio (después del ajuste por dilución)		78.671.004	641.475.373	17.179.988.994	1.181.352.566	517.095.429	69.648.318.453

Total combinado

	'	Acciones en circulación a	Valor liqu	ıidativo poı a <sup>(a)</sup>	acción	Pa	trimonio neto a <sup>(a</sup>	a)
	Divisa	30-nov-21	30-nov-21	30-nov-20	30-nov-19	30-nov-21	30-nov-20	30-nov
<b>Asia Equity Portfolio</b> Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referenci.	a USD	842.139	27,94	29,82	21,94	23.531.355	2.402.354	1.408.
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	191.674	36,18	38,61	28,40	6.935.210	6.804.777	8.305.
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	9.238	18,06	19,37	14,32	166.865	126.711	342.
Clase de acciones "A"	USD	79.716	42,76	45,86	33,91	3.408.766	3.298.004	3.347.4
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	308.503	34,92	35,62	28,79	10.774.348	7.814.386	5.449.3
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	3.372.176	15,54	16,45	12,00	52.411.145	28.165.067	15.471.
Clase de acciones "I"	GBP	7.784	19,55	20,75	15,78	152.171	16.200	12.
Clase de acciones "I"	USD	231.959	53,39	56,72	41,63	12.383.192	24.151.839	10.667.
Clase de acciones de acumulación "IO"	JPY	3.100.344		1.949,52	1.483,75		9.725.867.782	
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	1.515.720	23,23	24,72	18,14	35.203.078	4.507.942	1.756
Clase de acciones "P"	USD	39.571	22,73	24,19	17,76	899.458	1.544.935	1.277
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	2.384	23,39	23,49	18,71	55.759	56.019	39
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	1.416.196	20,41	21,62	15,79	28.907.580	24.707.025	3.957
Clase de acciones "R"	GBP	31.274	19,53	20,73	15,77	610.763	432.898	265
Clase de acciones "R"	USD	316.577	19,80	21,04	15,44	6.269.093	3.728.659	419
All China Equity Portfolio(b)			-,	,-	-,			
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	104.890	23,81	25,63	17,69	2.497.756	1.165.044	204
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	14.045	23,30	25,07	17,31	327.243	223.069	89
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	716.213	26,37	28,14	19,28	18.885.074	67.189.371	28.841
Clase de acciones "I"	USD	709	24,14	25,82	17,82	17.108	18.263	12
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	1.204.563	23,71	25,35	17,39	28.564.579	14.084.709	5.248
Clase de acciones "P"	USD	56.582	22,24	23,79	16,43	1.258.174	166.168	12
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	130.918	23,18	24,76	16,97	3.034.824	3.732.385	2.324
Clase de acciones "R"	GBP	21.598	25,16	26,94	19,21	543.506	799.929	349
Clase de acciones "R"	USD	306.693	21,67	23,19	16,00	6.646.585	2.840.316	36
Emerging Markets Equity ESG Portfolio					,			
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	4.953.239	14,55	13,89	10,74	72.074.653	28.382.993	11.320
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	17.003	14,55	13,89	10,74	247.421	305.404	10
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	32.527	13,50	12,29	10,41	439.098	22.497	10
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "I"	USD	2.346.200	14,85	14,07	10,80	34.832.162	33.020.090	25.330
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	18.150.168	13,44	12,07	10,08	243.964.911	2.796.911	9
Clase de acciones de acumulación "I"	GBP	2.354.120	11,15	10,54	_	26.248.706	1.040.047	
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	17.430.877	15,01	14,19	10,86	261.617.618	87.280.193	47.191
Clase de acciones "I"	USD	694.308	14,89	14,09	10,86	10.335.871	451.082	10
Clase de acciones de acumulación "IO"	EUR	570.121	17,06	15,17	12,56	9.726.149	8.648.652	7.158
Clase de acciones "IO"(b)	USD	667.951	8,93	_	_	5.967.789	_	
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	178.761	13,21	12,55	_	2.361.069	12.546	
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	133.726	14,97	14,17	10,86	2.002.385	14.171	10
Clase de acciones "R"	GBP	2.121.850	13,53	12,80	10,17	28.716.101	6.703.860	753
Clase de acciones "R"	USD	12.233	14,81	14,02	10,87	181.160	100.795	21
Emerging Markets Equity Portfolio								
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia		14.313.140	27,98	26,63	20,87	400.448.642	327.124.009	237.484
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	815.795	52,73	50,19	39,35	43.013.761	31.028.624	22.153
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	CHF	54.559	15,99	15,02	13,04	872.578	797.148	526
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	13.256.422	21,17	19,12	16,34	280.660.828	263.344.190	273.372
Clase de acciones puntuales en otras divisas	GBP	85.870	21,44	20,40	16,57	1.841.324	604.975	452
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	490.143	18,52	17,70	13,92	9.078.720	9.356.871	11.523
Clase de acciones "A"	USD	258.067	53,66	51,28	40,34	13.848.891	14.497.808	13.146
Clase de acciones "B"	USD	1.107	43,99	42,45	33,73	48.696	46.996	37
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	2.896.447	46,25	41,97	36,05	133.952.787	124.891.008	99.006
Clase de acciones "G"(b)	USD	26.408	10,26	_	_	270.862	_	
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	13.055.328	21,26	19,01	16,09	277.547.876	185.777.830	161.683
Clase de acciones de acumulación "I"	SEK	735	138,82	123,21	107,70	101.971	572.326.045	210.690
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	75.975.044	27,21	25,66	19,91		1.657.444.226	
Clase de acciones "I"	EUR	5.371.273	13,42	12,04	10,29	72.059.459	42.529.182	36.330
Clase de acciones "I"	GBP	8.964.123	20,12	19,02	15,44	180.351.261	125.482.178	85.610
Clase de acciones "I"	USD	3.194.612	65,14	61,63	48,29	208.081.481	225.884.922	164.288
Clase de acciones de acumulación "IO"	GBP	454.781	36,05	33,68	26,88	16.395.380	14.651.878	26.221
Clase de acciones de acumulación "IO"(b)	SEK	17.680.413	98,26			1.737.327.121	<del></del>	
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	19.418.048	19,82	18,52	14,26	384.799.442	318.712.058	166.726
Clase de acciones "IS" (Dis) (estable semestral)	EUR	9.046.338	12,47	12,39	10,46	112.807.305	75.290.342	63.559
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IX"	USD	336.330	9,60	9,56	7,85	3.228.427	4.092.153	16.699
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	3.359.953	22,42	21,23	16,56	75.336.801	55.026.621	24.866
Clase de acciones "P"	USD	275.155	21,75	20,60	16,14	5.983.611	3.768.907	4.707
Clase de acciones de acumulación "R"	CHF	42.746	16,76	15,60	13,43	716.308	2.551.509	1.820
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	1.544.741	17,67	15,82	13,40	27.297.896	18.988.628	8.827
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	13.028.199	19,50	18,40	14,29	254.060.415	199.260.319	127.991
Clase de acciones "R"	GBP	6.150.804	22,34	21,12	17,16	137.403.142	88.937.009	34.163
Clase de acciones "R"	USD	1.115.971	18,61	17,61	13,80	20.768.837	16.096.206	8.204
Global Environmental Impact Equity Portfolio	1							
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia		1.066.103	16,97	13,88	_	18.089.459	7.459.811	
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	20.343	16,96	13,88	_	345.085	36.205	
Clase de acciones de acumulación en otras divisas <sup>(b)</sup>	EUR	2.650	11,54	_	_	30.577	_	
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	4.616.111	15,93	12,47	_	73.555.361	3.407.905	
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	1.899.821	22,21	17,12	_	42.192.743	15.957	
Clase de acciones de acumulación "I"	GBP	590.829	16,77	13,60	_	9.909.543	4.645.387	
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	24.232.720	17,20	13,96	_	416.897.407	127.886.813	
Clase de acciones "I"(b)	AUD	2.055.408	11,83			24.308.080		

	е	Acciones n circulación a	Valor liqu	iidativo po a <sup>(a)</sup>	r acción	Pati	rimonio neto a <sup>(a)</sup>	1
ı	Divisa		30-nov-21		30-nov-19	30-nov-21	30-nov-20	30-no\
Global Environmental Impact Equity Portfolio (continuación)								
	GBP	10.246	16,77	13,61	_	171.803	44.899	
	USD	2.404.013	17,20	13,97	_	41.352.342	1.523	
	USD	37.749.435	10,95	_	_	413.320.580	_	
	GBP	524.922	16,61	13,55	_	8.721.576	2.543.286	
	USD	7.875.032	17,04	13,91	_	134.223.980	51.721.437	
	GBP	1.000	16,62	13,55	_	16.622	13.547	
	USD	100	17,06	13,90	_	1.706	1.390	
	GBP	401.937	16,74	13,58	_	6.726.905	849.172	
	USD	5.315.845	17,18	13,95	_	91.316.868	32.969.373	
Clase de acciones "R"	GBP	2.855.630	16,70	13,60	_	47.685.383	761.679	
Clase de acciones "R"	USD	151.621	17,16	13,95	_	2.602.003	1.395	
Global Equity Income Portfolio								
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	1.421	21,72	19,15	18,44	30.868	27.219	26.
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	198.017	48,18	42,77	41,63	9.539.573	8.669.933	9.011.
Clase de acciones "A"	USD	15.269	20,48	18,19	17,71	312.680	323.733	325.
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	28.674	16,73	14,10	14,92	479.856	306.579	531.
	USD	154.470	17,77	15,52	14,81	2.744.449	14.983	14.
	USD	494.995	21,15	18,60	17,87	10.468.391	4.124.717	954.
	USD	674	20,34	18,05	17,57	13.712	12.061	11.
	USD	1.079	13,90	12,46	12,21	14.999	13.124	12
, , ,	USD	79.110	21,08	18,43	17,60	1.667.579	1.312.837	17
	GBP	52.935	23,83	21,12	21,29	1.261.194	550.162	21
	USD	5.059	19,76	17,52	17,05	99.960	44.418	102
Blobal Equity Partners ESG Portfolio	JJD	5.059	19,70	17,52	17,05	99.900	44.410	102
	LICD	E 242	26.74	24.04	10.00	140 170	104 221	60
	USD	5.242	26,74	21,81	18,33	140.179	104.221	69
	GBP	5.011	31,89	25,99	22,63	159.819	26.119	22
	USD	31.397	25,05	20,53	17,34	786.420	428.363	216
	USD	17.104	25,05	20,53	17,34	428.398	304.969	232
	EUR	116.084	30,96	24,08	22,18	3.594.020	1.064.053	506
	EUR	42.194	31,08	24,17	22,26	1.311.371	1.017.353	618
	USD	980.963	29,67	24,01	20,02	29.105.978	2.278.841	172
Clase de acciones de acumulación "P"	EUR	107.198	34,74	26,81	24,51	3.723.991	2.401.319	2.314
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	287.162	28,03	22,81	19,12	8.048.697	6.247.682	4.944
Clase de acciones "P"	EUR	640	33,89	26,15	23,90	21.675	16.728	15
Clase de acciones "P"	USD	67.125	27,25	22,17	18,58	1.828.832	1.611.573	18
Clase de acciones "R"	USD	878.511	25,67	20,81	17,40	22.547.931	12.679.709	3.699
Slobal Equity Partners Portfolio								
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	275.977	28,99	24,06	20,02	8.000.385	6.928.878	8.188
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia								
Clase cubierta en USD)	USD	7.131	19,46	15,98	13,52	138.809	74.187	13
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	533.835	23,75	19,71	16,40	12.676.396	10.728.709	10.009
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia								
Clase cubierta en USD)	USD	1.000	19,46	15,97	13,51	19.460	15.974	13
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	918.450	30,24	23,81	21,59	27.771.603	15.958.291	15.138
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	GBP	465.016	38,50	31,93	27,52	17.902.727	7.650.390	6.020
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	12.351	17,58	14,52	12,63	217.074	186.819	150
	GBP	448.970	38,38	31,83	27,43	17.232.741	9.743.634	11.336
	EUR	10.661	17,58	14,53	12,64	187.451	154.878	162
,	USD	59.196	36,34	30,31	25,34	2.150.983	1.891.753	3.197
	USD	55.975	36,34	30,32	25,34	2.034.055	1.889.553	1.682
	EUR	131.434	40,37	32,03	29,26	5.305.622	4.265.692	4.365
	EUR	1.311.472	41,00	32,03	28,81	53.773.292	29.603.376	14.758
	USD	15.060.461	23,09	19,01	15,68	347.716.700	264.575.690	195.793
				-				
	EUR	4.685.261	16,62	13,62	11,75	77.881.387	55.671.054	67.634
	USD	1.066	21,09	17,17	14,40	22.473	18.298	15
	GBP	7.373	26,93	22,20	19,03	198.551	227.656	182
	USD	889.576	20,79	16,97	14,28	18.495.761	23.970.434	20.249
	GBP	1.882.334	31,71	25,89	21,97	59.696.531	38.445.381	16.013
	SEK	19.525.333	104,06	-		2.031.778.463		04.5
	USD	3.393.327	30,92	25,27	20,69	104.918.203	61.126.424	31.244
` ,	USD	2.032.008	21,85	17,66	14,70	44.398.773	18.255.520	16.720
	USD	1.793.724	21,19	17,46	14,43	38.004.268	50.129.649	54.597
	USD	1.791.781	40,48	33,51	27,80	72.532.945	47.122.140	48.001
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD)	USD	236.656	20,55	16,82	14,19	4.862.898	2.150.909	15
	USD	887.909	40,23	33,30	27,63	35.721.540	26.421.812	21.748
Clase de acciones "P"	USD	1.066	20,55	16,82	14,19	21.898	17.941	31
				16,68	15,02	80.506.711	30.432.122	10.240
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en USD)	EUR	3.772.440	21,34	10,00				
clase de acciones "P" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "R"	EUR GBP	3.772.440 562.105			17,40	13.894.851	6.400.633	376
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones de acumulación "R"		562.105	24,72	20,35	17,40		6.400.633 31.512.908	
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones de acumulación "R"	GBP USD	562.105 1.666.314	24,72 29,23	20,35 24,08	17,40 19,88	48.708.298	31.512.908	376 27.574 12.417
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en USD)  Clase de acciones de acumulación "R"  Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	GBP	562.105	24,72	20,35	17,40			

	,	Acciones en circulación a	Valor liqu	uidativo po a <sup>(a)</sup>	r acción	Pa	trimonio neto a <sup>(a)</sup>	)
	Divisa	30-nov-21	30-nov-21		30-nov-19	30-nov-21	30-nov-20	30-nov-
Global Equity Partners Portfolio (continuación)								
Clase de acciones "R"	USD	7.792.046	28,60	23,60	19,53	222.831.911	143.341.517	113.241.0
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR USD	11.424	19,46	15,98	13,83	222.307	182.408 2.708.338	157.6
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD)  Blobal Future Health Care Equity Portfolio	บรม	237.808	21,54	17,58	14,79	5.122.918	2.708.338	14.9
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	1.108.525	11,78	10,53	_	13.060.998	10.525	
Clase de acciones de acuminada en la divisa de referencia	USD	5.016	11,78	10,53	_	59.072	10.525	
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	113.586	11,51	9,82	_	1.306.999	8.765	
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	1.281.995	12,13	10,20	_	15.556.680	10.362	
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	12.008.575	11,89	10,54	_	142.730.479	19.611.299	
Clase de acciones "I"	USD	393.823	11,89	10,54	_	4.681.144	10.539	
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	6.113.567	11,81	10,53	_	72.214.374	17.582.947	
Clase de acciones "P"	USD	1.211.635	11,81	10,53	_	14.311.188	3.492.230	
Clase de acciones de acumulación "R"	GBP	79.620	11,43	10,13	_	910.131	357.811	
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	4.421.992	11,88	10,54	_	52.526.976	4.129.972	
Clase de acciones "R"	GBP	264.151	11,42	10,13	_	3.017.688	101.288	
Clase de acciones "R"	USD	686.117	11,89	10,54	_	8.155.371	10.539	
Global Future Technology Leaders Equity Portfolio	USD	171.230	19,20	15,58		3.286.888	245.731	
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	171.230	19,20	15,58	_	3.286.888	322.097	
clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	267.946	18,28	14,08	_	4.899.267	212.136	
lase de acciones de acumulación "E"	EUR	125.263	18,03	13,99	_	2.258.527	201.800	
clase de acciones de acumulación "I"	USD	20.186.176	19,49	15,69	_	393.475.599	116.541.709	
clase de acciones "I"(b)	GBP	800	11,59	13,09	_	9.269		
Clase de acciones "I"	USD	735.222	19,48	15,68	_	14.321.061	10.232.062	
clase de acciones de acumulación "IO"	USD	250.943.581	19,74	15,77	_		3.086.038.644	
lase de acciones de acumulación "P"	USD	6.032.246	26,55	21,48	_	160.150.928	94.513.297	
clase de acciones "P"	USD	540.442	26,55	21,48	_	14.347.776	5.122.900	
lase de acciones de acumulación "R"	GBP	326.875	18,86	15,20	_	6.164.223	74.927	
clase de acciones de acumulación "R"(b)	USD	1.257.119	11,77	_	_	14.797.751	_	
lase de acciones "R"	EUR	1.102.843	16,14	12,33	_	17.795.825	1.919.404	
clase de acciones "R"	GBP	1.000	18,90	15,21	_	18.904	15.208	
clase de acciones "R"	USD	1.735.730	16,38	13,19	_	28.423.035	4.919.545	
lobal Millennials Equity Portfolio								
lase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	12.207.484	32,07	28,27	18,69	391.480.275	126.844.565	11.418.
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	686.521	27,06	23,86	15,78	18.577.154	3.580.751	265.
clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	1.540.602	15,86	13,27	_	24.433.045	5.837.063	
clase de acciones de acumulación en otras divisas	HKD	1.248.471	113,40	99,50	_	141.582.654	79.021	
clase de acciones de acumulación en otras divisas	SGD	6.758.214	11,47	9,94		77.492.571	13.634	
clase de acciones en otras divisas	EUR	53.572	18,26	15,27	11,00	978.294	8.402	6.
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	4.231.372	20,23	17,05	12,39	85.595.932	32.172.132	2.488
Clase de acciones "E"  Clase de acciones de acumulación "I"	EUR EUR	6.229.928 18.079.295	25,58 21,48	21,55 17,82	15,66 12,75	159.356.942 388.390.825	107.085.050 132.065.969	38.060 16.122
Clase de acciones de acumulación "l"	GBP	532.838	31,66	27,66	18,81	16.870.118	7.583.138	675
Clase de acciones de acumulación "l"	USD	21.573.467	34,46	30,14	19,76	743.515.873	285.206.293	29.573
clase de acciones "I"	GBP	221.055	31,76	27,75	18,86	7.020.195	10.522.850	29.575
clase de acciones "I"	USD	7.038.906	28,41	24,84	16,29	199.979.440		23.838
Clase de acciones "IO"	USD	5.885.855	13,73	11,92	- 10,20	80.818.023	17.181.339	20.000
clase de acciones de acumulación "P"	USD	5.527.398	27,48	24,16	15,93	151.867.174	77.077.178	11.087
clase de acciones "P"	USD	1.296.010	27,47	24,16	15,93	35.606.249	11.079.998	998
clase de acciones de acumulación "R"	GBP	497.465	31,58	27,61	18,79	15.708.773	6.128.373	200
lase de acciones de acumulación "R"	USD	4.985.330	34,46	30,16	19,79	171.802.599	104.110.972	9.895
clase de acciones "R"	GBP	1.651.265	31,17	27,25	18,53	51.462.006	28.764.452	7.531
clase de acciones "R"	USD	4.254.519	33,94	29,70	19,49	144.419.189	118.985.404	31.180
ndia Equity Portfolio								
lase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	16.395.379	32,42	22,95	20,59	531.610.271	410.138.973	512.266
lase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	2.229.397	32,37	22,95	20,60	72.159.345	57.899.172	77.698
lase de acciones de acumulación en otras divisas	SEK	1.069.536	197,08	131,83	132,57	210.782.194	143.407.059	165.304
lase de acciones de acumulación en otras divisas	SGD	48.110	16,87	11,72	10,76	811.562	132.517	10
lase de acciones en otras divisas	GBP	103.620	34,41	24,94	23,14	3.565.810	495.409	1.228
lase de acciones de acumulación "A"	USD	101.383	20,14	14,33	12,92	2.041.806	1.173.923	1.525
lase de acciones "A"	USD	697.804	30,05	21,55	19,43	20.971.809	14.659.912	24.192
lase de acciones de acumulación "E"	EUR	3.264.212	41,96	28,43	27,84	136.962.464	81.566.328	100.645
clase de acciones de acumulación "l"	EUR	862.914	21,54	14,39	13,89	18.586.171	4.671.483	51.249
clase de acciones de acumulación "I"	USD	19.917.630	37,00	25,93	23,05	737.021.635		481.675
clase de acciones "I"	GBP	6.300.160	22,57	15,88	14,62	142.202.972		117.174
Clase de acciones "I"	USD	1.203.645	36,34	25,64	22,78	43.740.752	24.941.181	96.958
Clase de acciones de acumulación "IO"  Clase de acciones de acumulación "P"	USD EUR	9.991.984	20,62	14,33	12,63	205.995.206	87.771.787	75.904
clase de acciones de acumulación "P"  Clase de acciones de acumulación "P"	USD	1.078	20,90	14,02	13,58 26.55	22.527 49.318.220	27.670	13 43.658
clase de acciones de acumulación "P"  Clase de acciones "P"	USD	1.167.521 129.581	42,24 41,68	29,74 29,58	26,55 26,51	5.401.332	27.900.807	
clase de acciones "P"  Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	1.735.121	20,20	29,58 13,50	13,04	35.048.630	2.051.165 15.418.967	2.879 18.711
clase de acciones de acumulación "R"	USD	3.977.946	30,93	21,69	19,29	123.052.660	87.186.682	122.548
clase de acciones de accimulación R	GBP	2.424.956	36,72	25,86	23,81	89.055.879	60.074.865	78.339.
clase de acciones "R"	USD	1.144.640	36,72	25,86	19,25	35.195.977	23.618.103	30.481
apan Equity Partners Portfolio	USD	1.144.040	30,75	21,03	18,23	33.183.877	23.010.103	JU.40 I
	JPY	357 586	19 227 80	16 908 61	13 458 52	6.875.632.467	755.312.031	108.900
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia		337.380	13.441.09	10,000,01	10.400,02	0.010.002.401	100.012.001	100.900

	6	Acciones en circulación	Valor liq	uidativo po a <sup>(a)</sup>	r acción	_	tulmonist- //	a)
	<b>.</b> .	a					trimonio neto a	
Lance Facility Deutscare Deutschler (neutscare)	Divisa	30-nov-21	30-nov-21	30-nov-20	30-nov-19	30-nov-21	30-nov-20	30-nov-1
Japan Equity Partners Portfolio (continuación) Clase de acciones de acumulación en otras divisas <sup>(b)</sup>	USD	999	9,91			9.896		
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF)	CHF	57.772	17,79		12,69	1.028.057	468.834	138.49
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	79.445	18,10		12,86	1.437.635	950.904	679.95
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en USD) <sup>(b)</sup>	USD	999	9,67		12,00	9.660	330.304	073.33
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	JPY	774.622		19.723,56	15 576 04		16.140.488.878	5.854.273.78
Clase de acciones de acumulación "l"	EUR	8.926.172	15,74		11,53	140.540.547	103.092.322	53.791.49
Clase de acciones de acumulación "I"	GBP	1.014.142	25,56		18,76	25.920.841	6.143.997	9.32
Clase de acciones de acumulación "I"	JPY	6.904.602			-	140.010.901.568		
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.408.866	19,18		13,41	27.018.605	29.179.734	10.787.26
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	2.403.388	19,71	17,21	13,68	47.368.287	26.267.457	20.674.43
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD) en USD)	USD	10.241.081	24,09	20,95	16,45	246.748.882	86.527.337	41.933.39
Clase de acciones "I"	GBP	1.732.651	15,93	15,04	11,74	27.603.363	20.287.094	17.138.29
Clase de acciones de acumulación "IO"	JPY	1.515.515	13.546,84	11.726,58	_	20.530.439.544	11.923.542.124	-
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	10.798.442	12,29	11,50	_	132.755.174	12.667	-
Clase de acciones de acumulación "P"	JPY	464.467	22.084,10	19.367,30	15.373,24	10.257.336.492	5.909.381.190	3.052.985.41
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD)	USD	2.549.315	23,38	20,44	16,14	59.608.000	49.474.965	61.365.47
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)	GBP	174.899	21,61	18,97	15,17	3.778.760	2.790.191	1.651.23
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en USD)	USD	2.676.656	16,26	14,21	11,22	43.518.539	23.386.396	14.234.9
Clase de acciones de acumulación "R"	JPY	700.443	20.195,95	17.626,52	13.924,36	14.146.115.574	9.351.730.726	6.336.970.3
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.740.264	19,12		13,38	33.268.272	27.138.045	16.008.7
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	151.252	19,63		13,65	2.969.795	1.132.375	249.9
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en USD)	USD	1.703.854	16,47		11,26	28.062.320	20.551.928	12.457.9
Clase de acciones "R"	GBP	1.073	11,14		_	11.957	11.260	
Clase de acciones "R"(b)	JPY	12.325	11.574,52			142.654.937		
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	2.209.014	19,79	17,33	13,82	43.718.666	29.131.860	20.839.3
Japan Equity Portfolio	ID) (	005 444	10.010.00	40 400 00	44.454.00	0.005.040.004	0.700.055.000	0.404.447.0
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia		205.414		16.480,30		3.885.648.664		
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	JPY	730.410	2.175,39		1.661,92	1.588.928.096	1.479.764.935	2.270.846.1
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR	1	1.210.614	27,43		21,32	33.206.709	23.519.911	26.340.1
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK		31.712	207,29		161,08	6.573.696	6.917.205	9.926.5
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en USD Clase de acciones en otras divisas	GBP	206.247 2.711	21,47 24,77		16,24 20,14	4.427.805 67.150	933.163 36.494	994.5 23.8
Clase de acciones en otras divisas  Clase de acciones en otras divisas	USD	331.179	29,28		23,01	9.697.498	6.310.790	13.538.1
Clase de acciones "A"	USD	342.984	20,65		16,39	7.083.516	5.133.131	9.730.9
Clase de acciones "B"	USD	8.021	17,45		14,12	139.936	133.660	113.2
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	1.930.507	16,56		13,67	31.976.330	52.135.942	137.553.2
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	2.063.572	16,78		13,24	34.629.329	26.998.619	26.953.9
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	JPY	7.202.071	1.813,77		1.351,99		14.654.346.863	
Clase de acciones de acumulación "I"	JPY	5.376.225				104.699.958.955		
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	4.984.544	23,28		17,76	116.022.460	45.899.532	19.548.4
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)	USD	669.184	23,97		17,80	16.039.332	10.184.984	5.893.4
Clase de acciones "I"	JPY	611.418		2.367,67	2.072,67		1.723.610.157	
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	3.507.692	18,89		14,51	66.273.345	72.352.435	55.036.4
Clase de acciones puntuales de acumulación "IS"(b)	EUR	11.775.750	10,81	_	_	127.350.830	_	
Clase de acciones puntuales de acumulación "IS"(b)	JPY	68.970	11.332,66	_	_	781.613.340	_	
Clase de acciones puntuales de acumulación "IS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	41.046	11,28	_	_	463.127	_	
Clase de acciones de acumulación "P"	JPY	17.624	23.506,67	20.423,97	17.862,11	414.286.254	388.775.004	394.807.9
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD)	USD	407.224	22,17	19,22	16,69	9.028.816	8.455.796	10.192.6
Clase de acciones "P"	JPY	25.035		20.064,01		577.764.488	523.248.016	468.062.8
Clase de acciones puntuales de acumulación "R"	JPY	620.842		2.984,95		2.145.219.221		321.158.
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	8.710	18,86		14,49	164.280	158.228	138.7
Clase de acciones puntuales "R"	GBP	153.426	28,86		23,36	4.428.067	6.288.181	9.295.3
Clase de acciones puntuales "R"	JPY	79.977	3.323,86		2.527,84	265.831.878	211.128.333	171.875.4
Clase de acciones puntuales "R"	USD	9.119	13,03		10,19	118.809	49.607	10.9
Clase de acciones puntuales de acumulación "RS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	881	10,69	_	_	9.418	_	
US Equity Portfolio								
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	1	15.423.631	38,14		25,77	588.229.130	448.638.588	439.360.0
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	208.487	38,20		25,81	7.965.191	6.934.353	6.921.7
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	17.963	39,84		27,84	715.634	445.708	409.5
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR		4.150.679	37,94		26,42	157.458.176	134.565.593	132.337.1
Clase de acciones en otras divisas	GBP	19.415	39,13	31,02	27,38	759.737	624.619	1.424.6

	е	Acciones n circulación	Valor liqui	idativo por a	acción	Data	imonio neto a <sup>(a)</sup>	
	Divisa	a 30-nov-21	30-nov-21 3		0-nov-19	30-nov-21	30-nov-20	30-nov
US Equity Portfolio (continuación)								
Clase de acciones en otras divisas	SGD	28.119	35,35	27,51	23,95	993.881	773.465	673.3
Clase de acciones "A"	USD	421.988	35,29	28,15	24,09	14.893.711	11.984.026	10.905.9
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	189.767	35,71	27,08	25,33	6.775.902	4.518.004	4.837.3
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	8.491	31,46	25,40	22,24	267.153	217.880	467.2
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	10.236	20,58	15,37	14,15	210.704	217.713	213.3
Clase de acciones de acumulación "l"	USD	84.968	33,43	26,32	22,23	2.840.655	3.490.910	10.251.5
Clase de acciones "I"	GBP	56.690	45,04	35,49	31,18	2.553.163	2.374.227	2.754.7
Clase de acciones "I"	USD	153.574	40,28	31,77	26,93	6.186.133	5.185.009	4.471.2
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	221.798	38,55	30,11	25,24	8.549.897	5.425.844	5.181.0
Clase de acciones "IS"	GBP	940.688	16,50	12,99	11,41	15.517.752	15.620.529	18.543.4
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	269.703	34,48	27,29	23,17	9.298.669	7.988.922	12.563.7
Clase de acciones "P"	USD	44.016	34,53	27,32	23,20	1.519.904	3.081.936	4.947.3
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	257.662	36,09	26,96	24,85	9.299.408	6.136.370	8.051.2
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	133.039	31,57	24,87	21,02	4.200.081	1.462.744	1.326.8
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	461.072	28,46	22,64	19,53	13.122.853	8.700.718	4.420.3
Clase de acciones "R"	GBP	32.422	37,56	29,60	26,00	1.217.811	1.080.583	1.134.
Clase de acciones "R"	USD	127.703	31,32	24,71	20,95	4.000.051	4.004.876	4.811.
US Focused Growth Equity Portfolio		4		00	00.5:	0.76 : :==	0.050 -01	0.000
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	177.972	49,41	38,52	26,81	8.794.177	6.352.799	3.805.
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	200.010	39,70	30,95	21,54	7.940.621	8.591.262	6.040.
Clase de acciones "A"	USD	346.276	38,04	29,80	20,84	13.170.936	10.472.446	7.888.
Clase de acciones "B"	USD	5.124	30,92	24,47	17,29	158.443	125.384	88.
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	49.619	51,22	38,16	29,18	2.541.412	909.026	835
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	13.631	44,16	34,16	23,58	601.980	584.586	328
Clase de acciones "I"	USD	341	48,72	37,68	26,02	16.613	43.384	58.
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	205.637	46,38	36,07	25,04	9.537.453	7.416.650	5.181
Clase de acciones "P"	USD	1.000	46,35	36,04	25,02	46.350	36.042	25.
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	21.139	41,64	32,22	22,25	880.208	432.991	272
Clase de acciones "R"	GBP	29.545	50,55	39,08	27,97	1.493.451	931.575	570
Clase de acciones "R"	USD	92.019	41,67	32,24	22,27	3.834.096	774.798	533.
JS Small Cap Equity Portfolio(b)								
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	116	14,29	11,63	10,31	1.657	1.349	10.
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	116	14,29	11,64	10,31	1.658	1.350	10.
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	38.583	14,17	11,04	10,75	546.701	72.084	10.
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	747.058	14,69	11,87	10,44	10.974.640	1.365	7.240.
Clase de acciones "I"	USD	84.966	14,67	11,86	10,43	1.246.291	1.186	2.895
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	245.871	14,41	11,71	10,36	3.543.397	1.132.402	1.849
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	32.869	13,11	10,78	9,77	430.946	10.755	9
Clase de acciones "P"	USD	15.958	14,41	11,70	10,35	229.881	76.106	76
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	2.961.403	14,65	11,85	10,43	43.394.816	21.182.481	13.406
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	33.030	13,66	11,16	10,07	451.316	1.363.176	1.324
Clase de acciones "R"	GBP	765	15,10	12,20	11,12	11.546	9.324	8
Clase de acciones "R"	USD	1.328.005	14,65	11,84	10,42	19.456.098	11.880.532	7.043
JS Technology Opportunities Equity Portfolio								
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	1.000	13,84	11,05	_	13.841	11.047	
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	2.937	13,84	11,05	_	40.640	11.047	
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	850	14,21	10,75	_	12.075	9.142	
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	1.193	14,13	10,75	_	16.853	9.138	
Clase de acciones de acumulación "I"	GBP	2.300	13,52	10,69	_	31.095	24.594	
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	4.149.903	13,97	11,05	_	57.958.806	33.163	
Clase de acciones "I"	USD	34.111	13,97	11,05	_	476.421	33.163	
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	30.021.233	14,08	11,06	_	422.667.729	84.157.793	
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	449.540	13,88	11,05	_	6.239.845	110.493	
Clase de acciones de acumulación "R"	GBP	20.514	13,50	10,69	_	276.886	8.020	
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	65.436	13,96	11,05	_	913.267	11.054	
Clase de acciones "R"	USD	1.000	13,95	11,05	_	13.953	11.054	
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio(b)								
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa								
le referencia <sup>(b)</sup>	USD	1.000	9,92	_	_	9.922	_	
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa	11100					2 22-		
le referencia <sup>(b)</sup>	USD	1.000	9,91	_	_	9.907	_	
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia(b)	USD	1.000	9,92	_	_	9.922	_	
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis)(b)	HKD	1.000	99,33	_	_	99.330	_	
Clase de acciones de acumulación en otras divisas(b)	EUR	1.000	10,16	_	_	10.162	_	
Clase de acciones de acumulación en otras divisas(b)	HKD	1.000	99,48	_	_	99.479	_	
Clase de acciones de acumulación "E"(b)	EUR	1.000	10,15	_	_	10.153	_	
Clase de acciones "I SD"(b)	USD	1.000	9,93	_	_	9.932	_	
Clase de acciones de acumulación "I"(b)	EUR	1.000	10,17	_	_	10.171	_	
Clase de acciones de acumulación "I"(b)	USD	479.876	9,93	_	_	4.765.410	_	
Clase de acciones "I"(b)	GBP	1.000	10,27	_	_	10.272	_	
Clase de acciones "I"(b)	USD	1.000	9,93	_	_	9.931	_	
Clase de acciones de acumulación "P"(b)	USD	1.000	9,92	_	_	9.924	_	
Clase de acciones "P"(b)	USD	1.000	9,92	_	_	9.924	_	
Clase de acciones de acumulación "R"(b)	EUR	1.000	10,17		_	10.171	_	

	е	Acciones n circulación a	Valor liqu	idativo po a <sup>(a)</sup>	r acción	Patr	rimonio neto a <sup>(a)</sup>	
	Divisa		30-nov-21 3	30-nov-20	30-nov-19	30-nov-21	30-nov-20	30-nov
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio <sup>(b)</sup> (continuación)								
Clase de acciones de acumulación "R"(b)	USD	1.000	9,93	_	_	9.930	_	
Clase de acciones "R"(b)	EUR	1.000	10,17	_	_	10.171	_	
Clase de acciones "R"(b)	GBP	1.000	10,27	_	_	10.271	_	
Clase de acciones "R"(b)	USD	1.000	9,93	_	_	9.930	_	
Global Infrastructure Equity Portfolio	LIOD	044 770	44.07	40.40	40.00	0 400 570	4.540.404	400.0
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	244.770	14,27	13,19	13,03	3.492.579	1.542.134	109.9
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) denominada en la divisa	LIOD			44.04	44.07		4.005	
de referencia <sup>(b)</sup>	USD	_	-	11,21	11,37		1.005	9
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	3.022	13,80	12,83	12,78	41.709	32.744	9
Clase de acciones en otras divisas (bruta trimestral) (Dis)(b)	EUR		40.00	9,93	10,97	785.017	925	954.0
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	58.777	13,36	11,71	12,61 12,37		214.895 932	251.0 1.0
Clase de acciones en otras divisas Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "E"	EUR	82	12,94	11,40 9,79	10,92	1.065		
	EUR	14.087 910.535	10,83 12,28		10,92	152.595 11.180.991	128.337 1.728.771	141.7 1.267.5
Clase de acciones de acumulación "E"				10,85				
Clase de acciones "E"	EUR GBP	21.990	12,22	10,79	11,71 11,00	268.790	145.900 973	199.0
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "I"(b)	USD	_	_	10,55 11,81	11,00	_	1.011	;
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "I"(b) Clase de acciones de acumulación "I"	GBP	81			12,29	1.074	984	;
			13,21	12,10				
Clase de acciones de acumulación "I"	USD GBP	554.787 87	14,85	13,61	13,34	8.236.565	6.552.708	6.421.9
Clase de acciones "I"		87 70 701	12,37	11,49	11,86	1.073	982	
Clase de acciones "I"	USD	70.701	13,95	12,95	12,90	986.222	1.019	
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "P"	USD	131.914	1,10	1,03	12,08	144.623	1.003	85.
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	833.980	14,49	13,35	13,15	12.082.299	2.061.034	1.816.
Clase de acciones "P"	USD	145.365	13,84	12,87	12,81	2.012.138	260.513	
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "R"(b)	GBP	_	_	10,58	11,05	_	979	
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "R"(b)	USD	_		11,78	11,86		1.012	
Clase de acciones de acumulación "R"	GBP	88	13,18	12,07	12,27	1.166	982	0.5
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	130.235	14,80	13,58	13,32	1.927.790	219.508	85.
Clase de acciones "R"	GBP	345	12,37	11,49	11,86	4.266	4.521	10.
Clase de acciones "R"	USD	1.638	13,91	12,93	12,87	22.792	21.164	
Global Real Estate Equity Portfolio	1							
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	233.360	11,65	9,83	12,20	2.719.269	1.444.232	608.
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) denominada en la divisa								
de referencia	USD	6.116	8,89	7,76	10,29	54.357	9.693	112.
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	1.094	10,65	9,18	11,63	11.652	9.828	12.
Clase de acciones en otras divisas (bruta trimestral) (Dis)(b)	EUR			7,37	10,41		8.647	11.
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	508.904	10,89	8,72	11,80	5.544.063	3.527.765	4.217.
Clase de acciones en otras divisas <sup>(b)</sup>	EUR			8,14	11,25		8.723	11.
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "E"	EUR	2.754	8,26	6,94	9,87	22.750	70.347	88.
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	13.062	10,11	8,16	11,12	132.116	64.104	73.
Clase de acciones "E"	EUR	9.124	9,51	7,78	10,75	86.801	103.949	93
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "I"(b)	GBP			7,76	10,33		7.420	9
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "I"	USD	660.475	9,93	8,60	11,05	6.556.086	5.639.672	7.291
Clase de acciones de acumulación "I"(b)	GBP			9,16	11,69		7.485	9
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	1.297.470	12,12	10,14	12,49	15.726.623	14.837.554	15.055
Clase de acciones "I"(b)	GBP			8,37	10,98		7.483	9
Clase de acciones "I"	USD	1.129	10,75	9,27	11,73	12.139	10.158	4.476
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "P"	USD	594.732	9,29	8,09	10,46	5.525.908	6.919.117	11.322
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	471.888	11,31	9,52	11,78	5.338.411	4.675.218	8.355
Clase de acciones "P"	USD	35.994	10,27	8,85	11,21	369.675	742.990	941
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "R"	GBP	1.735	8,95	7,75	10,32	15.532	13.178	17
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "R"(b)	USD	_	_	8,56	11,00	_	10.039	12
Clase de acciones de acumulación "R"(b)	GBP	_		9,15	11,68	_	7.473	9
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	1.000	12,09	10,13	12,47	12.095	10.125	12
Clase de acciones "R"(b)	GBP	_	_	8,36	10,98	_	7.471	9
Clase de acciones "R"	USD	1.127	10,73	9,25	11,72	12.096	10.126	12
North America Energy & Energy Infrastructure Equity Portfolio								
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia		2.436.227	6,94	4,87	6,05	16.913.352	13.193.126	23.257
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	255.903	6,28	4,51	5,70	1.606.333	946.175	1.695
Clase de acciones "A"	USD	48.058	9,99	7,18	9,06	479.978	28.659	35.
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	986.206	7,95	5,34	7,28	7.844.021	1.531.228	1.627
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	156.622	7,49	5,21	6,42	1.172.804	904.108	2.483
Clase de acciones "I"	USD	373	6,27	4,51	5,70	2.340	1.630	2
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	2.890.529	6,75	4,72	5,84	19.509.955	18.491.435	29.131.
Clase de acciones "P"	USD	622.581	5,93	4,26	5,38	3.692.039	2.823.056	4.376
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	10.619	10,16	6,71	9,00	107.852	2.879	3.
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	273.544	7,41	5,17	6,36	2.028.263	891.925	1.899
Clase de acciones "R"	USD	6.004	6,29	4,52	5,71	37.779	102.390	329.
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	1			•	•			
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en la divisa	1							
de referencia	USD	11.037.112	19,97	19,10	15,96	220.389.667	192.366.244	126.130.
Clase de acciones puntuales de acumulación denominada en la divisa								
de referencia	USD	164.592	11,57	11,06	9,20	1.903.849	4.275.300	92.570.
Clase de acciones puntuales denominada en la divisa de referencia	USD	11.352	12,98	12,50	10,56	147.294	245.846	707.
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas	EUR	3.729.378	13,47	12,23	11,14	50.241.484	38.056.165	29.075.
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas	1							
	CHF	27.378	10,01	9.69	8,32	274.173	94,995	41.

	e	Acciones en circulación a	Valor liqu	uidativo po a <sup>(a)</sup>	r acción	Pa	trimonio neto a <sup>(</sup>	a)
	Divisa		30-nov-21	30-nov-20	30-nov-19	30-nov-21	30-nov-20	30-nov
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio (continuación)								
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas		05.000	40.00	0.70	0.00	054.450	447.457	
(Long Emerging Markets CCY vs. USD) Clase de acciones puntuales de acumulación "A" (Long Emerging	EUR	25.220	10,09	9,76	8,36	254.453	117.157	8.3
Markets CCY vs. USD)	PLN	35.124	11,44	11,10	9,55	401.734	422.637	363.6
Clase de acciones puntuales "A"(b)	USD	1.004	9,21			9.248		000.0
Clase de acciones de acumulación "E" al cierre	EUR	53.358	11,95	10,92	10,03	637.395		767.4
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	EUR	19.733.680	11,38	10,25	9,27	224.584.371	141.699.439	213.103.1
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	USD	63.512.118	22,49	21,36	17,71		1.531.187.614	
Clase de acciones puntuales de acumulación "I"	GBP	6.261.055	12,04	11,41	9,78	75.383.141	49.352.809	43.498.8
Clase de acciones "I" al cierre	EUR	4.678.540	11,31	10,33	9,54	52.929.263		32.854.
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	GBP	256.055	20,56	19,38	16,54	5.265.195		4.036.
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	JPY	4.256.126		1.120,53	970,06		5.063.645.127	
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	USD	12.236.786	24,70	23,30	19,20	302.275.110		245.726.
Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"(b)	JPY USD	1.096 2.800.382	965,93	— 11,51	9,45	1.058.962 34.178.668		43.881.
Clase de acciones puntuales de acumulación "IO" Clase de acciones puntuales "IO"	USD	4.291.816	12,21 12,69	12,19	10,30	54.466.938		30.250.
Clase de acciones puntuales 10 Clase de acciones de acumulación "P" al cierre	USD	1.380.978	17,09	16,24	13,49	23.575.941		34.086.
Clase de acciones de acumulación Parcierre	USD	138.167	14,85	14,30	12,11	2.051.737	1.672.792	4.086.
Clase de acciones de acumulación "R" al cierre	USD	3.631.132	16,59	15,76	13,08	60.250.101	60.697.876	35.703.
Clase de acciones de acumulación "R" al cierre (Long Emerging Markets	300	0.001.102	10,08	13,70	10,00	50.250.101	55.557.570	55.105.
CCY vs. USD)	EUR	58.622	10,35	9,94	8,45	606.538	133.531	113.
Clase de acciones "R" al cierre	GBP	6.919.108	16,90	16,25	14,26	116.902.388		63.700.
Clase de acciones "R" al cierre	USD	1.108.770	14,35	13,82	11,70	15.910.533		11.638.
Europe CORE® Equity Portfolio			,		, -			
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	EUR	4.581.467	23,44	18,92	19,93	107.397.941	93.600.234	185.203.
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	EUR	1.658.867	19,75	16,08	17,26	32.764.657	32.912.989	48.434.
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	USD	80.851	13,52	11,51	11,11	1.093.288	613.447	3.154
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta								
en USD)	USD	21.626	12,76	10,38	10,61	275.938		10.
Clase de acciones en otras divisas	GBP	40.102	12,20	10,46	10,67	489.129		78.
Clase de acciones en otras divisas	USD	69.098	13,42	11,52	11,34	927.259		4.846.
Clase de acciones de acumulación "A"	EUR	170.214	12,47	10,12	10,72	2.123.243		2.098
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	558.987	12,17	10,41	10,10	6.802.378		18.206
Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)	PLN	137.792	12,21	10,06	10,52	1.681.925		400.
Clase de acciones "A"	EUR	1.147.491	17,68	14,40	15,46	20.292.881	20.249.387	33.149.
Clase de acciones "A"	USD	732.423	12,65	10,86	10,70	9.266.857	8.297.522	8.762.
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	4.251.878	26,18	21,24	22,49	111.330.169		130.775.
Clase de acciones de acumulación "I"	CHF	1.105	11,23	9,35	9,91	12.403		674.
Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I"	USD	33.726.133 3.822.299	22,73	18,20	19,02	766.678.923 52.770.325		79.516.
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF)	CHF	97.365	13,81 12,69	11,65 10,37	11,16 10,71	1.235.794		630
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CIII")	EUR	3.575.387	12,05	9,91	10,71	43.435.835		38.738.
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)	USD	10.000	13,91	11,22	11,38	139.067	112.240	113.
Clase de acciones "I"	EUR	3.943.150	25,76	20,96	22,49	101.561.971		
Clase de acciones de acumulación "IO"	EUR	1.262.765	21,27	16,95	17,62	26.863.113		23.146.
Clase de acciones de acumulación "IO" (Long European CCY vs. EUR)	SGD	29.591.423	13,12	10,36	10,68	388.094.898		403.511.
Clase de acciones de acumulación "IS"(b)	EUR	1.735.147	12,33	_		21.397.981	_	
Clase de acciones de acumulación "P"	EUR	3.987.671	17,58	14,15	14,87	70.106.551	60.161.169	82.994.
Clase de acciones "P"	EUR	1.265.264	12,16	9,90	10,63	15.389.351	1.546.419	2.979.
Clase de acciones "P"	GBP	40.763	12,24	10,49	10,70	499.013	408.896	653.
Clase de acciones "P"	USD	275.472	12,55	10,77	10,60	3.458.336	1.906.677	13.229.
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	3.318.499	24,00	19,23	20,11	79.655.557	118.015.037	136.854
Clase de acciones "R"	EUR	1.156.051	20,10	16,35	17,55	23.235.139	38.076.886	78.363
Clase de acciones "R"	GBP	110.824	21,09	18,07	18,43	2.337.558		5.083
Clase de acciones "R"	USD	231.965	12,71	10,91	10,74	2.949.084	3.760.446	7.322
Eurozone CORE® Equity Portfolio <sup>(b)</sup>								
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia <sup>(b</sup>		1.000	10,19	_	_	10.187		
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia(b)	EUR	1.000	10,19	_	_	10.187		
Clase de acciones de acumulación en otras divisas <sup>(b)</sup>	USD	1.000	9,81	_	_	9.810		
Clase de acciones de acumulación "E"(b)	EUR	1.000	10,17	_	_	10.168		
Clase de acciones de acumulación "l"(b)	EUR	294.140	10,22	_	_	3.004.789		
Clase de acciones "I"(b)	EUR	100.000	10,22	_	_	1.021.550		
Clase de acciones de acumulación "R"(b)	EUR	1.000	10,21	_	_	10.214	_	
Clase de acciones "R"(b)	EUR	1.000	10,21	_	_	10.214	_	
Global CORE® Equity Portfolio								
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en la divisa	Hen	2 224 560	24 22	26.15	22.42	60 000 507	45.931.927	67.320.
de referencia Clase de acciones puntuales de acumulación denominada en la divisa	USD	2.234.569	31,32	26,15	23,43	69.982.527	45.931.927	07.320.
Clase de acciones puntuales de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	2.026.610	32,25	26,55	23,78	65.349.667	63.783.113	82.590
clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) al cierre denominada en la	030	2.020.010	32,25	20,00	23,10	05.549.007	00.700.113	02.090
divisa de referencia	USD	929	13,50	11,45	10,38	12.534	10.495	9.
Clase de acciones al cierre denominada en la divisa de referencia	USD	440.304	25,68	21,44	19,26	11.307.609		11.387.
Clase de acciones puntuales denominada en la divisa de referencia	USD	620.366	34,80	28,65	25,73	21.588.130		47.322.
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas	HKD	106.984	145,62	120,89	109,39	15.578.603		6.407.
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas	SGD	235.625	14,65	12,00	10,99	3.452.674		4.365.

	е	Acciones n circulación a	Valor liqu	idativo po	r acción	Pa	trimonio neto a <sup>(a</sup>	a)
l <sub>c</sub>	Divisa		30-nov-21 3		30-nov-19	30-nov-21	30-nov-20	30-nov
ilobal CORE® Equity Portfolio (continuación)								
clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras								
	AUD	119.373	14,08	11,65	11,01	1.680.648	1.043.618	150.4
clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas Clase cubierta en SGD)	SGD	228.997	14,13	11,64	10,71	3.236.365	3.032.199	3.057.1
	EUR	2.824.456	15,50	12,11	11,82	43.779.580	33.874.506	41.922.1
clase de acciones puntuales de acumulación en otras divisas (Clase	LOIT	2.024.400	10,00	12,11	11,02	40.770.000	00.07 4.000	71.022.1
	EUR	142.597	13,89	11,39	10,61	1.981.343	174.241	6.9
clase de acciones puntuales "A"	USD	354.984	26,19	21,67	19,51	9.296.852	10.077.970	12.762.6
clase de acciones de acumulación "E" al cierre	EUR	2.919.849	27,76	22,10	21,70	81.063.558	75.298.013	116.125.2
	EUR	3.632.312	33,82	26,55	26,06	122.854.706	113.508.453	133.468.0
clase de acciones puntuales de acumulación "E" (Clase cubierta								
,	EUR	1.020.859	13,60	11,20	10,48	13.879.612	18.426.463	11.082.
•	USD	177.604	12,12			2.152.258		
	EUR	15.470.620	31,58	24,80	24,04	488.509.651	377.370.550	650.006.
	USD	25.881.480	32,22	26,68	23,71	833.884.463	746.902.311	962.878.
` '	CHF	4.994	14,02	11,54	10,66	70.037	79.692	73.
, ,	EUR GBP	1.003.023	13,60	11,21	10,36	13.637.023 142.789	14.445.389	60.366.
	SEK	11.863 910	12,04 99,00	_	_	90.106	_	
	USD	6.743.743	15,02	12,27	10,90	101.301.539	16.552.259	47.601.
•	EUR	831.364	14,29	11,62	10,90	11.882.967	18.910.770	15.397
	GBP	14.981	16,06	13,36	12,42	240.573	217.869	24.032
	USD	2.034.340	26,10	21,73	19,51	53.106.360	48.728.619	161.010
	USD	2.316.400	36,02	29,58	26,55	83.436.710	56.785.336	60.821
	USD	66.591	12,23	10,78	10,35	814.197	227.197	129
	EUR	2.073.064	47,13	36,84	35,52	97.706.884	84.519.511	85.373
	GBP	_	_	39,50	36,19	_	8.470	7.
	USD	4.184.399	28,14	23,19	20,50	117.762.133	80.208.174	16.909
clase de acciones puntuales de acumulación "IO"(b)	SEK	19.665.758	103,43	_	_	2.034.110.826	_	
clase de acciones puntuales de acumulación "IO"	USD	61.677.718	20,57	16,72	14,78	1.268.866.552	1.402.427.234	2.064.527
clase de acciones puntuales "IO"	USD	10.947.590	20,07	16,47	14,78	219.703.576	162.547.196	143.475
clase de acciones puntuales de acumulación "IS"(b)	EUR	858	12,95	_	_	11.117	_	
clase de acciones puntuales de acumulación "IS"(b)	USD	1.004	11,12	_	_	11.167	_	
clase de acciones puntuales de acumulación "IS" (Clase cubierta								
,	EUR	858	12,18	_	_	10.454	_	
	USD	3.248.008	24,77	20,34	18,17	80.467.854	75.850.292	96.384
•	USD	248.964	41,07	33,75	30,31	10.225.326	9.332.627	21.151
clase de acciones de acumulación "R" al cierre								
,	CHF	6.584	12,83	10,56	9,77	84.493	23.258	11.
•	EUR	120.559	16,00	12,41	12,02	1.928.851	2.480.829	3.032
•	USD GBP	1.218.759	30,52	24,94	22,17	37.192.146	70.780.115	114.633
	USD	162.497 1.024.182	16,01 28,22	13,31	12,39 20,81	2.601.339 28.906.074	3.297.753 20.669.070	8.146 26.061
clase de acciones puntuales "R"  Slobal Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	1.024.102	20,22	23,17	20,61	20.900.074	20.009.070	20.001
	USD	871.493	28,01	22,85	22,38	24.411.810	14.666.191	16.380
	USD	6.997.029	28,39	23,02	22,42	198.666.478	167.879.480	182.890
	EUR	217.552	14,48	11,14	11,80	3.150.309	1.393.374	3.318
	SEK	15.594	190,97	145,71	159,54	2.977.998	1.917.883	68.239
•	USD	32.339	22,74	18,65	18,31	735.329	763.242	1.318
	USD	45.653	21,94	17,88	17,46	1.001.657	635.175	896
	EUR	411.680	26,85	20,88	22,36	11.053.193		17.422
	EUR	549.069	26,04	20,13	21,43	14.298.888	11.012.327	15.739
	GBP	724	14,49	11,72	11,78	10.490	9.730	9
	EUR	1.984.781	34,71	26,51	27,88	68.897.630	45.568.290	107.185
	USD	968.632	18,18	14,63	14,12	17.607.449	23.883.211	26.508
clase de acciones "I" al cierre	GBP	734.040	14,14	11,51	11,67	10.380.039	9.166.181	6.733
clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	GBP	7.198	53,13	42,74	42,70	382.451	242.961	205
	JPY	3.738.782	1.318,40	982,87	995,97		4.842.237.877	4.940.112
	USD	1.016.229	32,16	25,90	24,98	32.684.335	25.063.029	22.472
	SEK	13.045.364	102,18	_	_	1.332.933.789	_	
•	USD	747.218	18,58	14,87	14,26	13.881.420	13.183.171	8.687
•	USD	5.383.009	17,93	14,50	14,11	96.518.224	57.189.092	55.585
	USD	164.417	25,11	20,31	19,68	4.128.821	2.878.802	3.452
•	USD	127.423	27,61	22,24	21,47	3.518.106	2.981.580	4.068
Clase de acciones puntuales "R"	GBP	75.281	20,31	16,43	16,57	1.529.065	2.503.019	14.269
	USD	56.353	25,96	21,02	20,47	1.463.042	1.215.336	7.230
clase de acciones puntuales "R"							04.507.655	70 544
clase de acciones puntuales "R"  IS CORE® Equity Portfolio		4 44		00				
clase de acciones puntuales "R"  IS CORE® Equity Portfolio  lase de acciones de acumulación al cierre denominada en la divisa de referencia	USD	1.116.481	37,07	29,56	25,36	41.382.895	34.507.125	
clase de acciones puntuales "R"  IS CORE® Equity Portfolio  lase de acciones de acumulación al cierre denominada en la divisa de referencia  lase de acciones puntuales de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	2.593.846	38,28	30,02	25,86	99.282.165	46.728.009	70.511. 210.872.
Clase de acciones puntuales "R"  S CORE® Equity Portfolio  Ilase de acciones de acumulación al cierre denominada en la divisa de referencia  Ilase de acciones puntuales de acumulación denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones al cierre denominada en la divisa de referencia	USD USD	2.593.846 158.556	38,28 36,62	30,02 29,20	25,86 25,10	99.282.165 5.806.274	46.728.009 5.016.703	210.872. 4.434.
Clase de acciones puntuales "R"  IS CORE® Equity Portfolio  Ilase de acciones de acumulación al cierre denominada en la divisa de referencia  Ilase de acciones puntuales de acumulación denominada en la divisa de referencia  Ilase de acciones al cierre denominada en la divisa de referencia  Ilase de acciones puntuales denominada en la divisa de referencia	USD	2.593.846	38,28	30,02	25,86	99.282.165	46.728.009	210.872

	e	Acciones n circulación a	Valor liqu	idativo por a <sup>(a)</sup>	acción	Pat	rimonio neto a <sup>(a)</sup>		
	Divisa		30-nov-21 3		30-nov-19	30-nov-21	30-nov-20	30-nov-	
S CORE® Equity Portfolio (continuación)									
Clase de acciones puntuales "A"	USD	989.488	37,99	29,94	25,92	37.586.146	22.150.601	38.153.4	
Clase de acciones puntuales de acumulación "E"	EUR	4.268.346	30,98	23,17	21,87	132.231.748	97.675.075	92.210.8	
Clase de acciones puntuales de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	765.784	14,74	11,75	10,43	11.290.713	8.666.992	11.932.1	
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	HKD	788	165,18	130,20	112,18	130.098	102.543	88.3	
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	USD	17.033.451	24,38	19,33	16,50	415.351.091	301.191.506	314.919.0	
Clase de acciones puntuales de acumulación "I"	USD	20.689.302	23,54	18,36	15,73	487.096.910	666.230.304	286.202.1	
Clase de acciones puntuales de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	5.528.037	15,36	12,12	10,64	84.915.206	66.276.584	116.559.0	
Clase de acciones puntuales "I"	USD	8.052.511	46,68	36,55	31,53	375.912.570	234.905.773	184.395.4	
Clase de acciones puntuales de acumulación "P"	USD	1.708.400	33,12	25,92	22,27	56.576.309	40.952.870	60.297.7	
Clase de acciones puntuales "P"	USD	648.244	35,64	27,92	24,09	23.102.842	546.725	836.0	
Clase de acciones puntuales de acumulación "R"	USD	1.619.418	36,31	28,34	24,29	58.801.747	49.952.614	46.459.1	
Clase de acciones puntuales "R"	GBP	62.009	41,69	32,61	29,15	2.584.884	1.972.316	2.492.7	
Clase de acciones puntuales "R"	USD	1.214.859	34,71	27,18	23,45	42.168.321	70.285.155	114.839.0	
Clase de acciones "U" al cierre	USD	141.230	41,47	33,08	28,44	5.857.290	4.671.872	4.016.9	
IS Small Cap CORE® Equity Portfolio									
clase de acciones de acumulación al cierre denominada en la divisa de referencia	USD	35.181	32,43	25,50	25,04	1.141.107	1.582.264	1.658.9	
clase de acciones puntuales de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	20.289	33,57	26,32	25,70	681.181	434.683	581.2	
Clase de acciones puntuales denominada en la divisa de referencia	USD	18.681	33,64	26,37	25,74	628.364	459.089	599.4	
Clase de acciones "A" al cierre	USD	174.134	29,95	23,67	23,34	5.215.187	1.835.832	13.241.2	
Clase de acciones de acumulación "E" al cierre	EUR	30.016	30,67	22,99	24,75	920.656	631.042	1.181.7	
Clase de acciones puntuales de acumulación "E"	EUR	132.587	31,98	23,92	25,58	4.240.362	1.263.714	3.686.	
Clase de acciones puntuales de acumulación "I"	USD	108.235	33,75	26,28	25,49	3.652.920	11.711.832	27.558.3	
Clase de acciones puntuales "I"	USD	280.101	31,29	24,43	23,77	8.764.027	10.108.500	3.873.	
Clase de acciones puntuales 1 Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"	USD	6.920.779	17,50	13,54	13,05	121.102.105	145.736.892	182.330.	
Clase de acciones puntuales de acumulación "P"	USD	1.155.015	29,99	23,41	22,74	34.644.469	35.750.582	34.121.	
Clase de acciones puntuales de acumulación "R"	USD	155.733	29,53	23,00	22,74	4.599.331	3.665.087	8.039.	
	GBP								
Clase de acciones puntuales "R"	1	50.422	34,84	27,18	27,41	1.756.545	1.147.596	848.	
Clase de acciones puntuales "R"	USD	77.602	28,77	22,47	21,86	2.232.940	1.184.067	1.954.	
sia High Yield Bond Portfolio		100.051	00.04	100.10		10.000.100	70.400		
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	122.254	98,81	103,12	_	12.080.496	73.438		
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	54.877	90,96	101,12	_	4.991.556	3.229.179		
clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	714.004	90,24	101,01	_	64.431.189	683.637		
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis)	HKD	78.306	91,41	101,10	_	7.157.884	82.043		
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase cubierta n AUD)	AUD	1.567	90,70	101,05	_	142.084	102.524		
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase ubierta en AUD)	AUD	1.089	90,07	101,02	_	98.067	102.529		
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase ubierta en EUR)	EUR	829	89,30	100,69	_	74.046	102.197		
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase ubierta en GBP)	GBP	1.089	90,09	100,98	_	98.082	102.493		
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase ubierta en SGD)	SGD	29.926	90,20	100,96	_	2.699.485	143.456		
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	101	95,37	100,30	_	9.646	10.189		
Clase de acciones "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	6.231	95,28	100,74	_	593.716	10.189		
Clase de acciones de acumulación "I SD"	USD	1.078.305	98,84	100,74		106.576.817	1.592.514		
clase de acciones de acumulación "I SD" Clase de acciones "I SD"(b)	GBP	207.266	98,84 95,31	102,22	_	19.754.934	1.592.514		
	ı				_				
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) "I"(b)	USD	10.943	89,81	102 22	_	982.728	7 607 769		
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	774.391	99,71	103,33		77.217.074	7.697.768		
Clase de acciones "I"	GBP	1.392	96,17	100,02	_	133.835	10.014		
Clase de acciones "I" (Clase subjerte en EUDV(t)	USD	507.157	98,02	103,34	_	49.710.932	10.334		
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)(b)	EUR	394.696	91,69	_	_	36.189.637	_		
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)(b)	GBP	71	91,55	-	_	6.463			
Clase de acciones "IS"	USD	180	98,19	103,40	_	17.723	16.941.855		
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) "P"(b)	USD	22.399	89,72	—	_	2.009.558	_		
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	109.131	99,27	103,22	_	10.833.246	10.322		
Clase de acciones "P"	USD	9.817	97,68	103,23	_	958.990	10.323		
Clase de acciones "R"	GBP	899	96,15	100,02	_	86.465	10.014		
merging Markets Corporate Bond Portfolio									
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	2.487.028	168,26	167,15	156,78	418.463.104	216.544.442	169.829.	
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa e referencia	USD	336.862	94,71	98,61	97,29	31.903.204	16.070.146	28.114.	
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa e referencia	USD	339.375	101,42	104,20	101,34	34.420.771	29.331.086	38.442.	
Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa									
e referencia	USD	1.733.681	96,26	100,54	99,15	166.885.393	74.172.569	62.043.	
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	131.837	116,25	119,46	116,95	15.325.752	7.917.908	1.963.	
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase cubierta	HKD	315.639	100,76	104,42	104,06	31.803.061	49.879.959	65.681.	
n AUD)	AUD	59.790	99,31	103,74	103,64	5.937.763	6.645.046	6.492.	
	, , , , , ,	30.700	30,01	. 55,14		5.557.755			
	SGD	407 386	99 22	101 88	99 64	40 419 867	21,308,056	25 226	
(Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en SGD) Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta	SGD	407.386	99,22	101,88	99,64	40.419.867	21.308.056	25.226.	

	е	Acciones n circulación a	Valor liqu	uidativo po a <sup>(a)</sup>	r acción	Pa	trimonio neto a <sup>(</sup>	a)
	Divisa		30-nov-21		30-nov-19	30-nov-21	30-nov-20	30-nov-19
Emerging Markets Corporate Bond								
Portfolio (continuación)	1							
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR)	EUR	6.193	94,36	99,38	99,72	584.388	64.559	10.174
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase	LOIX	0.195	34,30	99,30	99,12	304.300	04.559	10.174
cubierta en GBP)	GBP	42.633	90,51	94,65	94,70	3.858.746	3.229.714	1.950.947
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase								
cubierta en SGD)	SGD	404.760	94,17	98,31	97,49	38.118.234	52.245.838	81.847.436
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	CHF EUR	356 553.486	100,21 149.38	100,58 149,63	142,92	35.688 82.681.739	35.822 63.040.770	25.006.720
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	57.009	102,55	106,00	105,81	5.846.000	8.285.980	10.832.196
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en GBP)	GBP	20.074	102,33	112,92	112,00	2.205.541	2.155.801	1.931.161
Clase de acciones "A"	USD	92.540	115,96	119,18	116,67	10.730.584	10.738.077	6.311.759
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	65.653	94,53	97,90	97,09	6.206.438	5.861.746	5.287.563
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	74.018	141,75	142,69	137,02	10.492.012	10.160.074	9.158.990
Clase de acciones (estable mensual) (Dis) "I"	USD	56.623	98,32	102,05	99,99	5.567.395	3.595.339	10.134
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	8.808.634	179,33	177,04	165,03	1.579.616.567	1.656.371.666	757.604.795
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en BRL) <sup>(b)</sup>	USD	16.467	97,63	_	_	1.607.762	_	_
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF)	CHF	16.667	101,35	101,09		1.689.128	15.984.811	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	3.655.339	159,25	158,52	150,48	582.095.219	377.375.027	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	36.787	134,54	132,99	125,73	4.949.486	6.603.033	83.117.380
Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	USD EUR	511.541 1.841.785	117,03 103,15	120,22 106.58	117,67 106,39	59.863.873 189.979.877	51.356.901 116.801.842	12.143.711 42.077.360
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	698.841	105,15	105,82	100,39	73.608.864	125.866.070	42.077.300
Clase de acciones de acumulación "IO"	JPY		,		12 956 74	7.211.776.552		6 466 500 686
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	643.000	145.46	142,60	132,00	93.533.165	101.248.504	99.020.166
Clase de acciones "IO"	USD	9.663	111,05	114,04	111,60	1.073.074	1.428.090	2.553.445
Clase de acciones de acumulación "IS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	3.518.924	112,80	112,00	106,06	396.923.344	262.003.775	162.214.937
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	145.002	146,03	144,67	135,33	21.174.838	16.979.363	20.420.480
Clase de acciones "P"	USD	67.679	105,38	108,31	105,98	7.131.694	681.029	1.453.392
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	525.233	151,29	149,46	139,42	79.460.517	45.379.788	23.440.800
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF)	CHF	4.354	101,20	101,02	400.07	440.569	484.743	0.040.004
Clase de acciones "R"  Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	USD GBP	193.307 87.425	106,07 100,13	108,98 102,85	106,67 102,01	20.504.005 8.754.074	9.212.709 7.049.796	3.313.984 5.825.451
Emerging Markets Debt Blend Portfolio	GBF	67.425	100,13	102,65	102,01	0.754.074	7.049.790	5.625.451
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	1.483	104,73	108,24	101,90	155.341	380.204	1.699.295
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	8.841	75,27	80,43	79,03	665.438	1.257.434	4.033.017
Clase de acciones de acumulación en otras divisas								
(Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	11.271	105,61	106,84	106,11	1.190.343	1.044.349	1.688.664
Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	1.734	75,28	78,65	81,56	130.564	134.938	110.90
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase parcialmente								
cubierta en EUR)	EUR	4.879	101,44	103,13	102,93	494.971	723.269	553.87
Clase de acciones de acumulación "I"  Clase de acciones de acumulación "I"	EUR USD	208.134 1.176.923	109,67	106,70	108,72 107,11	22.826.013 131.520.316	21.028.265 130.771.664	20.954.912 16.118.774
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente	บอบ	1.176.923	111,75	114,62	107,11	131.520.316	130.771.004	10.116.772
cubierta en EUR)	EUR	549.047	107,08	107,50	105,94	58.793.820	361.374.060	331.142.724
Clase de acciones "I"	USD	147	75,83	80,98	79,60	11.172	11.456	10.704
Clase de acciones "I" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	1.477	79,55	84,84	85,53	117.475	120.342	115.458
Clase de acciones "IO" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	3.302.258	97,94	104,37	99,65	323.407.090	344.659.299	328.369.218
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	100	111,17	114,09	106,67	11.117	11.409	10.667
Clase de acciones "R"	USD	1.197	75,78	80,94	79,51	90.682	96.393	94.158
Clase de acciones "R" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	2.093	79,46	84,74	85,43	166.309	151.955	167.26
Emerging Markets Debt Local Portfolio	LIOD	504.004	40.00	44.04	44.44	0.470.055	0.400.075	0.000.70
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD USD	591.384 1.504	10,96 5,39	11,81 6,00	11,41 6,01	6.479.055 8.105	9.102.675 8.748	8.802.794 8.443
Clase de acciones (mensual) (bis) denominada en la divisa de referencia	USD	144.764	5,65	6,29	6,36	817.587	935.389	944.564
Clase de acciones en otras divisas	GBP	22.934	6,77	7,53	7,89	155.214	243.587	255.680
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	239.331	10,57	11,42	11,06	2.528.733	1.928.927	2.042.42
Clase de acciones "A"	USD	602.470	5,80	6,46	6,53	3.491.952	4.289.263	4.542.826
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E"	EUR	605.163	6,87	7,25	7,93	4.154.845	4.096.835	4.012.408
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	303.075	12,45	12,77	13,48	3.773.850	4.409.637	5.735.085
Clase de acciones "E"	EUR	317.419	6,91	7,31	8,06	2.194.823	2.940.073	4.790.433
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "I"	EUR	4.684.914	7,22	7,63	8,35	33.832.019	34.930.307	36.455.800
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	20.265.265	13,18	13,35	13,93	267.090.231	263.266.848	242.831.945
Clase de acciones de acumulación "I"	GBP	801.337	11,36	12,12	12,02	9.099.997	8.761.389	105.996.185
	USD	29.961.656	12,44	13,29	12,71	372.801.059	420.630.084	531.792.789
Clase de acciones de acumulación "I"	LISD	5 912 933	8 UB	6 <b>7</b> 7	6 84	35 053 616	60 821 021	67 819 330
Clase de acciones "l"  Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) "IO"	USD USD	5.912.933 5.932.299	6,08 8,90	6,77 9,93	6,84 9,95	35.953.616 52.794.964	60.821.021 18.312.755	67.812.339 16.390.199

	е	Acciones en circulación a	Valor liqu	ıidativo poı a <sup>(a)</sup>	acción	Pa	trimonio neto a <sup>(a</sup>	ı)
	Divisa		30-nov-21		30-nov-19	30-nov-21	30-nov-20	30-nov
merging Markets Debt Local								
ortfolio (continuación)								
clase de acciones de acumulación "IO"	USD	4.893.268	13,79	14,62	13,89	67.472.933	46.670.991	42.378.7
clase de acciones "IO"	USD	4.877.234	6,24	6,94	7,01	30.419.151	9.780.141	9.288.7
clase de acciones "IS"	EUR	16.452.345	10,81	11,21	_	177.864.119	116.236.285	
clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IX"		143.212.776	1,58	1,94	2,17	226.793.945	371.539.627	455.473.2
clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO"	USD	27.397.748		2,61	2,17	58.105.590	98.500.703	114.326.6
, ,, ,, ,,	i		2,12	-	-			
clase de acciones de acumulación "P"	USD	1.262.530	12,19	13,09	12,59	15.383.944	17.843.223	15.449.5
clase de acciones "P"	USD	134.703	6,88	7,67	7,74	926.686	1.368.018	2.051.
lase de acciones de acumulación "R"	EUR	32.653	9,76	9,90	10,33	318.747	323.502	353.
lase de acciones de acumulación "R"	USD	1.838.265	8,54	9,12	8,73	15.691.562	2.174.096	2.558.
clase de acciones "R"	EUR	680	6,24	6,59	7,25	4.242	4.297	10.
lase de acciones "R"	GBP	9.806	6,60	7,34	7,68	64.682	243.036	324.
clase de acciones "R"	USD	224.600	5,45	6,08	6,14	1.225.022	1.418.561	264.
	OOD	224.000	3,43	0,00	0,14	1.225.022	1.410.501	204.
merging Markets Debt Portfolio clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	7.057.936	23,88	24,47	23,01	168.516.543	194.133.779	226.014.
clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	030	7.037.930	23,00	24,41	23,01	100.510.545	194.133.779	220.014.
Clase cubierta en duración)	USD	216.953	11,94	11,95	12,04	2.589.915	4.654.261	8.128.
clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase cubierta en EUR)	EUR	4.707.665	17,13	17,72	17,02	80.648.611	124.055.979	729.208.
clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa		4.07:	0.40	2.11	0.00	11.000	44.005	,.
e referencia	USD	1.374	8,49	9,11	9,06	11.663	11.960	11.
clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	12.959.478	10,03	10,62	10,41	130.011.033	197.212.610	251.802
clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa								
e referencia	USD	5.184.563	8,23	8,95	8,94	42.674.051	42.111.835	47.168
clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	4.967.745	13,45	14,32	14,20	66.815.996	77.455.877	84.388
clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta								
n duración)	USD	220.548	7,74	8,05	8,56	1.706.461	3.470.424	7.168
clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR)	EUR	392.431	7,85	8,39	8,40	3.080.465	5.499.064	4.349
clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en HKD)	HKD	442.610	86,21	91,36	89,28	38.158.468	46.971.824	60.032
clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase			,	- 1,	,			
ubierta en SGD)	SGD	7.167.865	8,01	8,71	8,76	57.411.027	68.201.174	86.469
clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta n CHF)	CHF	395.833	10,98	11,38	10,96	4.345.748	5.928.649	4.925
,	Cili	393.033	10,90	11,50	10,90	4.545.740	3.920.049	4.525
clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta n EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	38.098	10,54	10,64	10,95	401.460	559.091	1.030
	i			-				
clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	964.839	8,32	8,92	9,05	8.028.743	14.385.139	19.730
clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en SGD)	SGD	232.128	9,97	10,61	10,59	2.313.404	9.655.856	9.112
clase de acciones (mensual) (Dis) "A"	USD	2.766.997	9,90	10,49	10,28	27.403.055	33.977.334	39.206
clase de acciones de acumulación "A"	USD	473.037	10,93	11,23	10,59	5.171.379	6.493.250	5.629
Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)	PLN	1.306.281	11,43	11,79	11,27	14.934.575	16.430.677	28.771
clase de acciones "A"	USD	1.866.133	15,92	16,96	16,80	29.705.780	40.761.484	50.379
clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	3.234.686	8,84	9,45	9,52	28.607.618	40.686.375	52.559
	LUIX	3.234.000	0,04	3,43	3,32	20.007.010	40.000.373	32.333
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase cubierta en duración)	EUR	874.979	6,65	6,94	7,49	5.821.594	9.276.407	14.228
·	i			-				
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	5.791.423	26,95	26,33	27,13	156.063.606	166.232.355	169.953
clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	7.977.024	12,94	13,45	12,99	103.204.172	117.322.857	119.040
clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase cubierta en duración)	EUR	488.178	10,01	10,16	10,50	4.885.007	7.210.473	12.465
clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "l"								
Clase cubierta en EUR)	EUR	12.170	7,60	8,23	8,34	92.546	410.789	2.081
clase de acciones (trimestral) (Dis) "I"	GBP	26.512	8,84	9,34	9,54	234.257	84.499	3.240
clase de acciones (trimestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en CHF)	CHF	506.966	7,88	8,43	8.51	3.992.572	47.945.103	142.015
clase de acciones de acumulación "I"	USD	34.925.822	17,27	17,60	16,46	603.342.844	896.239.481	
	1							16.381
clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF)	CHF	595.845	11,32	11,66	11,17	6.742.835	11.009.499	
clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en duración)(b)	EUR	40.700.07:	-	10,56	11,54		9.973	10
clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	40.726.971	20,63	21,22	20,27	840.090.972	794.218.740	799.549
clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)								
Clase cubierta en duración)	EUR	5.120	9,85	9,89	10,12	50.431	1.315.605	2.343
clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en JPY)	JPY	32.622	1.029,10	1.054,94	1.005,80	33.571.312	13.504.202	12.875
clase de acciones "I"	EUR	334.972	9,61	9,71	10,49	3.220.050	2.768.259	7.017
clase de acciones "I"	USD	1.812.804	16,91	18,00	17,84	30.648.869	106.648.699	180.274
clase de acciones "I" (Clase cubierta en duración)	USD	195.618	8,54	8,89	9,46	1.671.408	1.739.065	1.849
clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	11.949.234	8,53	9,14	9,27	101.943.006	214.302.442	597.799
,	LUK	11.548.434	0,03	9,14	9,27	101.343.000	217.002.442	Ja1.199
clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta n duración)	EUR	4 000	7.00	7 22	7.07	20 570	20,000	2 642
,	i	4.080	7,00	7,33	7,97	28.570	29.909	3.613
clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	715.976	10,06	10,70	10,76	7.199.242	135.790.686	203.509
clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP) (Clase cubierta								
n duración)(b)	GBP	_	_	7,55	8,15	_	32.492	33
							10 001 100	45.000
clase de acciones (bruta mensual) (Dis) "IO"	USD	5.262.659	9,62	10,20	10,00	50.629.652	16.681.460	15.008
	USD GBP	5.262.659 63.021.475	9,62 11,30	10,20 11,42	10,00 10,99	50.629.652 712.309.994	749.600.614	15.008 100.822

	e	Acciones n circulación a	Valor liqu	uidativo po a <sup>(a)</sup>	r acción	Pa	trimonio neto a <sup>(a)</sup>	
	Divisa		30-nov-21		30-nov-19	30-nov-21	30-nov-20	30-nov
Emerging Markets Debt								
Portfolio (continuación)								
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	4.948.831	24,60	24,88	23,09	121.760.299	140.920.574	267.677.8
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en EUR)	EUR	4.426.561	11,22	11,46	10,86	49.684.006	36.688.928	31.257.3
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.150.301	22,08	22,36	21,08	25.403.364	11.642.607	6.331.7
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en JPY)	JPY	7.676.646			1.038,65		5.328.481.2651	
Clase de acciones "IO"	USD	3.959.412	11,92	12,68	12,57	47.199.512		46.339.
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "IS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	992	7,97	8,58	8,65	7.908		522.360.
Clase de acciones de acumulación "IS"	USD	3.838.207	11,13	11,31	10,54	42.733.713	37.128.576	33.719.
Clase de acciones de acumulación "IS" (Clase cubierta en CHF)	CHF	999	10,09	10,36	9,89	10.083	1.265.546	2.416.
Clase de acciones de acumulación "IS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	998.909	10,19	10,44	9,93	10.176.111	348.712.067	47.260.
Clase de acciones "IS"	USD	14.156.741	9,92	10,56	9,94	140.395.489	231.901.986	185.643.
Clase de acciones "IS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	173.738	9,62	10,30	9,90	1.671.654	30.395.626	52.356
Clase de acciones "IS" (Clase cubierta en GBP)	GBP	10.504.768	8,91	9,48	9,53	93.557.386	206.790.699	235.928.
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IX"	USD	845.678	3,86	4,47	4,81	3.261.137	4.023.717	4.731
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	50.390	11,14	11,38	10,68	561.146	1.582.167	1.119.
Clase de acciones "P"	USD	641.499	9,26	9,87	9,78	5.941.530	34.188	11.
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	217.846	15,39	14,88	15,19	3.351.574	2.556.020	2.386
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	4.113.826	13,49	13,76	12,87	55.512.962	62.889.330	81.487
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF)	CHF	595.530	11,41	11,76	11,28	6.793.882	11.596.800	28.114
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en duración)(b)	USD	_	· —	10,11	10,14	_	24.353	24
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	3.459.141	11,81	12,16	11,62	40.862.500	84.287.941	103.487
Clase de acciones "R"	USD	4.156.435	8,96	9,54	9,45	37.228.324	58.832.708	58.037
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	5.338.382	7,79	8,35	8,47	41.589.750	64.767.074	85.063
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	995.206	8,37	8,91	8,96	8.333.622	12.676.713	28.547
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) (Clase cubierta en	00.	000.200	0,01	0,01	0,00	0.000.022	12.070.710	20.0-17
duración)	GBP	2.130	7,21	7,50	8,10	15.366	15.985	17
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en SGD)	SGD	405.107	9,59	10,20	10,18	3.885.984	6.213.021	8.330
Clase de acciones de acumulación "RS"	USD	1.316.791	10,46	10,20	9,94	13.777.643	14.531.134	3.593
Clase de acciones de acumulación "RS"	030	1.510.791	10,40	10,04	3,34	13.777.043	14.551.154	3.393
	CHE	1 452 054	10.05	10.24	0.90	14 607 002	15 101 206	2 107
(Clase cubierta en CHF)	CHF	1.452.854	10,05	10,34	9,89	14.607.083	15.101.396	3.197
Clase de acciones de acumulación "RS"		0.40.450	40.40	40.00		0 400 705	0.040.004	4 000
(Clase cubierta en EUR)	EUR	642.159	10,10	10,38	9,90	6.488.785	6.948.861	1.920
Clase de acciones "RS"	USD	1.960.583	9,92	10,55	9,95	19.439.602	9.249.356	2.035
Clase de acciones "RS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	275.011	9,59	10,28	9,90	2.638.509	1.010.630	307
Clase de acciones "RS" (Clase cubierta en GBP)	GBP	379.979	9,74	10,36	9,92	3.699.357	3.374.971	4.941
ESG-Enhanced Emerging Markets Short Duration Bond Portfolio(b)								
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de								
referencia	USD	4.251	108,76	107,72	106,25	462.314	457.905	10
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	19.517	101,85	104,21	106,25	1.987.784	3.502.902	10
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta								
en EUR)	EUR	1.000	103,25	103,07	103,48	103.248	103.068	103
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.067	96,80	99,62	103,48	103.249	103.070	103
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	7.327	102,50	102,58	103,25	751.003	846.125	123
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	130.618	110,47	108,83	106,76	14.429.998	14.272.371	19.117
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	15.675	104,88	104,14	103,99	1.644.012	6.805.729	7.318
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.000	106,99	105,47	105,15	106.991	105.466	105
Clase de acciones "I"	USD	108	102,45	104,78	106,77	11.052	10.884	10
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.077	97,36	100,15	103,98	104.875	104.129	103
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	4.043	101,17	99,90	_	408.980	9.990	
Clase de acciones "P"	USD	38.403	99,40	101,69	100,48	3.817.257	7.408.162	1.767
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	3.500	96,82	99,60	100,15	338.892	109.659	110
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)	GBP	107	97,75	99,93	100,30	10.464	10.335	10
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	105.615	103,92	102,41	100,51	10.974.984	11.504.270	6.535
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	110.023	104,74	104,02	103,94	11.523.558	15.286.990	103
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EBP)	GBP	1.000	106.87	105.39	105,34	106.867	105.387	105
Clase de acciones de acumulación (Clase cubiena en GBF)	USD	25.931	99,61	103,39	100,51	2.582.873	1.167.700	563
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.076	97,32	101,69	100,51	104.754	104.050	103
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.076	99,37	100,12	105,94	106.903	105.387	105
	GBP	1.076	99,37	101,59	105,17	100.903	105.367	105
ESG-Enhanced Euro Short Duration Bond Plus Portfolio <sup>(b)</sup>	FUE	0.705.440	40.00	10.00	40.00	07.050.535	22.054.402	20 500
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	EUR	2.725.146	10,26	10,36	10,33	27.958.575	32.051.120	30.562
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	EUR	16.074	10,15	10,28	10,26	163.127	200.119	807
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	432.524	10,07	10,19	10,18	4.353.821	6.070.954	4.592
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	16.159.325	10,54	10,61	10,55	170.268.995	106.532.002	48.292
Clase de acciones "I"	EUR	6.475.607	10,18	10,31	10,31	65.936.147	30.038.371	38.811.
Clase de acciones de acumulación "P"	EUR	4.076.364	10,35	10,44	10,39	42.205.463	36.065.890	38.265
Clase de acciones "P"	EUR	514.716	10,09	10,21	10,21	5.192.553	6.633.502	6.347

	е	Acciones n circulación	Valor liqu	ıidativo poı a <sup>(a)</sup>	r acción	D-4	rimonio nata c(a)	
	<b>.</b> .	a					rimonio neto a <sup>(a)</sup>	
	Divisa	30-nov-21	30-nov-21	30-nov-20	30-nov-19	30-nov-21	30-nov-20	30-nov-1
ESG-Enhanced Euro Short Duration Bond Plus Portfolio(b) (continuación)								
	EUR	7.387.396	10,51	10,59	10,52	77.626.517	63.963.466	60.530.12
	EUR	1.301.148	10,31	10,33	10,32	13.244.201	14.951.968	13.611.01
ESG-Enhanced Europe High Yield Bond Portfolio <sup>(b)</sup>	EUK	1.301.140	10,16	10,31	10,30	13.244.201	14.931.900	13.011.01
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa	-LID	5.004	400.00	405.00	404.74	055.470	007.440	405.50
	EUR	5.084	128,86	125,23	121,71	655.179	267.142	135.59
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa		0.000	444.07	400.00	100.05	000 700	0.47.000	040.70
de referencia (Clase cubierta en USD)	USD	2.026	144,97	139,90	133,35	293.738	247.062	213.70
	EUR	9.632	104,68	104,81	104,94	1.008.269	63.046	14.79
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta	0514	0.457	4 400 77	4 000 00	4 004 00	0.500.050	0.000.045	4 500 05
en SEK)	SEK	3.157		1.093,08		3.566.959	2.286.315	1.589.95
Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)	PLN	35.941	132,81	128,71	124,30	4.773.338	5.520.101	7.252.14
	EUR	5.057	123,19	120,44	117,76	622.980	543.530	695.27
	EUR	543.134	134,30	129,81	125,49	72.941.625	40.429.507	34.653.40
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)	USD	118.478	104,55	100,32	_	12.386.701	10.032	-
Clase de acciones "I"	EUR	128	104,95	105,04	105,12	13.469	1.030.324	12.58
Clase de acciones (mensual) (Dis) "P" (Clase cubierta en USD)	USD	11.362	114,63	113,46	111,66	1.302.352	1.288.320	1.267.12
	EUR	46.554	131,82	127,73	123,77	6.136.816	5.558.207	3.969.0
	USD	25.026	148,15	142,54	135,46	3.707.640	4.512.316	7.495.53
	EUR	8.706	104,77	104,88	104,99	912.157	903.530	958.4
	EUR	43.844	133,69	129,28	125,02	5.861.511	6.024.195	7.304.2
	EUR	7.906	105,27	105,36	105,47	832.243	1.696.669	708.0
	GBP	2.614	111,06	110,52	110,32	290.279	386.611	2.002.0
ESG-Enhanced Global Income Bond Portfolio(b)	ODI	2.014	111,00	110,52	110,52	230.273	300.011	2.002.00
	USD	644	104,01	103,52		66.982	10.352	
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa	USD	044	104,01	103,32	_	00.902	10.332	
	USD	104	00.46	100.74		10 221	10.074	
			99,46	102,74	_	10.331	10.274	
	USD	103	101,03	103,06	_	10.376	10.331	
Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa								
	USD	104	99,69	103,18	_	10.339	10.318	
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis)	HKD	805	100,04	102,76	_	80.534	79.642	
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase cubierta								
en AUD)	AUD	1.467	99,15	102,73	_	145.405	145.061	
Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta								
en EUR)	EUR	1.027	100,08	102,89	_	102.768	103.141	
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase								
cubierta en SGD)	SGD	1.458	99,70	103,16	_	145.332	140.129	
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta			•					
	EUR	1.000	103,04	103,34	_	103.036	103.339	
	EUR	87	98,05	102,62	_	8.574	8.691	
	EUR	1.000	102,42	103,23	_	102.416	103.233	
	USD	103	101,04	103,06	_	10.439	10.338	
	USD	323.570	101,04	103,62	_	33.873.109	19.755.707	
	EUR	60.559				6.269.322		
			103,52	103,28	_		8.747	
	USD	103	101,02	103,06	_	10.410	10.335	
	USD	8.925	104,40	103,57	_	931.720	10.357	
	USD	103	101,02	103,06	_	10.433	10.337	
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.033	100,82	103,00	_	104.104	103.311	
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	1.247	104,64	103,61	_	130.485	10.361	
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.000	104,42	103,55	_	104.422	103.549	
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio(b)								
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	GBP	10.921	161,26	166,37	157,71	1.761.137	5.900.563	6.221.2
Clase de acciones "I"	GBP	104.416	156,46	161,40	152,97	16.337.027	8.908.016	3.984.7
Clase de acciones "P"	GBP	1.705	161,44	166,52	157,83	275.294	234.649	812.3
Clase de acciones de acumulación "R"	GBP	7.440	154,01	155,37	143.35	1.145.807	2.018.110	2.259.9
	GBP	72.620	122,27	126,13	119,55	8.879.347	13.321.472	16.010.8
Global Credit Portfolio (Hedged)	JDF	12.020	122,21	120,13	118,33	0.013.041	10.021.472	10.010.0
	Hen	1 577 010	10 24	10 20	16 60	28 727 000	21 847 226	14 075 (
	USD	1.577.818	18,21	18,38	16,60	28.727.909	21.847.226	14.875.9
	USD	290.521	12,50	12,84	11,85	3.630.768	3.337.002	2.952.3
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta	05:1		461-	400 0	446.55		4 56 : 5==	
en SEK)	SEK	12.850	121,74	123,34	113,33	1.564.370	1.584.977	751.4
	USD	110.171	12,56	12,91	11,92	1.383.772	2.360.985	382.6
	EUR	1.632.412	17,34	17,68	16,30	28.298.051	38.673.973	20.359.5
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en duración)	USD	13.790	10,17	10,20	9,85	140.267	140.468	135.3
	USD	13.968.053	16,15	16,20	14,54	225.645.050	253.195.050	85.968.5
					-,			
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF)	CHF	4.963.020	14,97	15,17	13,92	74.273.159	75.059.367	58.112.3

	e	Acciones en circulación a	Valor liqu	uidativo po a <sup>(a)</sup>	r acción	Pot	rimonio neto a <sup>(a</sup>	)
	Divisa	a 30-nov-21	30-nov-21		20 nov 10	30-nov-21	30-nov-20	30-nov-
Global Credit Portfolio (Hedged) (continuación)	DIVISA	30-1104-21	30-1104-21	30-1104-20	30-1104-13	30-1104-21	30-1104-20	30-1104-
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) (Clase								
cubierta en duración)	EUR	996	11,30	11,20	10,72	11.261	24.521	23.5
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) (Clase			,	,=-				
cubierta en duración) <sup>(b)</sup>	GBP	_	_	11,75	11,19	_	845.084	3.381.4
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	84.745	11,38	11,69	10,92	964.458	4.732.103	3.956.13
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	19.047.273	15,79	15,77	14,09	300.767.664	180.574.726	153.733.2
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP) (Clase	l							
cubierta en duración)(b)	GBP		-	11,69	11,09		8.732.882	8.282.4
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en SEK) <sup>(b)</sup> Clase de acciones "IO"	SEK	14.541.812 12.893.197	99,27 11,92	12.24	11,30	1.443.636.599 153.747.453	130.659.990	140.132.1
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO"	USD	2.611.429	8,02	8,91	8,92	20.945.155	30.811.259	17.468.6
Clase de acciones (mensuar) (Dis) (Cap) 170	USD	2.098.016	19,32	19.40	17.43	40.540.447	45.736.833	28.110.8
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en duración)	USD	3.002.734	12,57	12,38	11,65	37.744.780	44.089.870	46.662.9
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	948.154	19,47	19,71	18,03	18.458.812	18.433.049	15.902.1
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) (Clase	= 0.1	0.00.	.0,	.0,	.0,00	10.100.012	10.100.010	.0.002
cubierta en duración)	EUR	144.598	11,04	10,95	10,50	1.596.052	4.083.295	4.226.1
Clase de acciones "P"	USD	357.716	13,63	14,00	12,93	4.877.160	14.873.616	7.629.5
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	791.508	10,49	10,85	10,21	8.303.019	434.990	1.311.0
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)	GBP	172.558	10,11	10,40	9,71	1.745.069	2.027.765	3.558.5
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	1.020.023	14,96	15,01	13,47	15.259.040	27.585.954	14.390.5
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en duración)	USD	414.753	12,49	12,29	11,55	5.179.482	5.601.659	7.290.
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	578.333	13,27	13,42	12,27	7.675.805	9.656.335	16.585.6
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) (Clase								
cubierta en duración)	EUR	2.260.808	11,23	11,14	10,66	25.390.113	28.412.542	33.272.
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	466.752	12,08	12,12	11,02	5.636.959	1.019.791	473.
Clase de acciones "R"	USD	2.077.450	12,10	12,43	11,47	25.137.528	38.633.816	33.231.
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	66.503	10,46	10,82	10,18	695.765	3.723.770	5.429.6
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	605.865	11,47	11,77	11,00	6.947.283	7.246.590	4.772.
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) (Clase cubierta en	000	070.004	0.70	0.05	0.05	0.007.007	0.700.400	
duración)	GBP	376.934	9,78	9,85	9,65	3.687.087	3.720.480	6.326.
Global Fixed Income Portfolio	USD	410 207	16 51	17 20	15 50	6 000 166	20.050.161	11 222 1
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	418.307	16,51	17,30	15,50	6.908.166	20.059.161 1.346.797	11.332.2
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones "A"	USD	84.176 1.280.803	17,24 13,42	18,28 14,23	16,63 12,94	1.451.352 17.186.763	18.837.386	1.038. 16.765.
Clase de acciones "B"(b)	USD	1.200.003	13,42	14,23	12,94	17.100.703	1.703	10.703.
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	639.299	8,25	8,22	8,05	5.273.283	6.435.752	3.053.
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	372.027	19,81	19,55	18,99	7.370.258	15.126.910	9.494.
Clase de acciones de acumulación "I"(b)	USD	127.858	9,87	.0,00	.0,00	1.262.076	-	0.101.
Clase de acciones "I"	USD	1.894.074	14,53	15,40	14,00	27.521.405	46.856.556	45.731.
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	2.080.803	17,11	17,74	15,74	35.610.185	31.879.593	19.911.
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	637.599	15,12	15,74	14,02	9.639.812	11.772.127	7.942.
Clase de acciones "P"	USD	619.431	11,52	12,21	11,11	7.137.691	10.245.806	2.280.
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	155.053	11,85	12,33	10,98	1.837.523	4.835.796	2.054.
Clase de acciones "R"	USD	191.526	10,14	10,75	9,77	1.941.793	4.064.595	2.506.
Global Fixed Income Portfolio (Hedged)								
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	EUR	2.075.323	14,73	15,23	14,17	30.573.878	91.971.663	39.916.
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	EUR	65.335	11,76	12,28	11,55	768.429	2.220.164	98.
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	466.268	14,15	14,67	13,68	6.598.212	10.227.564	1.071.
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	12.684.506	15,73	16,15	14,91	199.489.616	248.160.885	70.911.
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en NOK)	NOK	7.903.137	117,80	119,98	109,68	931.019.589	611.564.389	468.255.
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)	USD	7.232.432	12,04	12,28	11,15	87.090.845	47.793.513	1.014.
Clase de acciones "I"	EUR	15.065.233	5,52	5,77	5,43	83.234.500	90.539.386	57.883.
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)	GBP	455.787	11,04	11,22	10,24	5.032.875	8.784	8.
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD)	USD	33.313.919	14,37	14,59	13,21	478.644.004	265.882.592	167.486.
Clase de acciones "IO" (Clase cubierta en USD)	USD	3.473.105	11,93	12,38	11,45	41.448.067	40.031.999	43.833.
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "P"	USD	4.070.974 2.741.536	6,84 15,33	7,67 15,76	7,68 14,56	27.825.944 42.035.301	34.425.385 39.736.784	29.402. 22.685.
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en CHF)	CHF	625.805	11,92	12,28	14,56	7.459.847	6.397.398	22.685. 5.334.
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en CHF)  Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD)	USD	768.338	10,01	12,28	11,36	7.459.847	7.083.233	ა.აა4.
Clase de acciones de acumulación P (Clase cubierta en USD)	EUR	123.792	12,41	12,96	12,19	1.536.499	2.268.988	2.174.
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)	GBP	181.636	12,41	12,96	12,19	2.260.818	2.200.900	7.709.
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en USD)	USD	400.874	12,43	13,44	12,04	5.198.259	17.905.075	3.241.
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	2.047.308	12,37	12,66	11,70	25.226.401	20.890.503	11.745.
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en USD)	USD	1.562.085	13,06	13,32	12,11	20.406.127	20.241.332	10.387.
Clase de acciones de accimiliación R (Clase cubierta en 03D)	EUR	737.640	10,77	11,24	10,58	7.942.466	5.009.258	4.197.
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en CHF)	CHF	920.247	10,77	10,90	10,38	9.587.550	5.494.400	3.608.
	1 0111	020.277	10,72	12,01	11,21	0.007.000	0.404.400	0.000.

		Acciones en circulación	Valor liqu	idativo por	acción	<b>D</b>	trimonio neto a <sup>(</sup>	3)
	Divisa	a 30-nov-21	30-nov-21	a <sup>(a)</sup>	30-nov-19	30-nov-21	trimonio neto av 30-nov-20	30-nov-19
Global Fixed Income Portfolio (Hedged) (continuación)	DIVISA	30-1104-21	30-1104-21	30-1104-20	30-1104-13	30-1104-21	30-1104-20	30-1104-13
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Global High Yield Portfolio	USD	1.514.858	12,12	12,58	11,63	18.364.056	19.952.221	18.809.716
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	3.472.498	23,46	22,78	21,54	81.450.618	119.081.460	143.761.529
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)	USD	2.235.922	13,89	13,34	13,09	31.052.824	37.748.344	56.046.244
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en SEK)	SEK	355.754	155,42	151,55	145,91	55.290.202	23.453.783	31.183.015
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de	USD	1.744	9,22	9,45	9,49	16.082	15.615	14.763
referencia  Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de  Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de	USD	717.851	9,42	9,53	9,44	6.759.705	16.539.017	18.261.256
referencia (Clase cubierta en duración)  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	635.153 5.629.573	8,26 7,95	8,27 8,07	8,51 8,04	5.248.055 44.757.162	6.561.909 52.531.532	12.538.280 77.180.639
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase	000	0.020.070	1,00	0,01	0,04	11.707.102	02.001.002	77.100.000
cubierta en duración)	USD	1.192.754	8,53	8,57	8,87	10.175.046	12.035.625	16.869.756
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta	HKD	941	98,89	100,77	102,11	93.098	89.874	85.801
en AUD) Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en	AUD	429.202	9,40	9,55	9,59	4.035.174	2.924.430	2.838.630
HKD) (Clase cubierta en duración) (b)  Clase de acciones en otras divisas (trimestral) (Dis) (Clase cubierta en	HKD	_	_	81,34	82,88	_	1.042.874	43.425.83
CHF) (Clase cubierta en duración) Clase de acciones en otras divisas (trimestral) (Dis) (Clase cubierta en	CHF	46.850	7,23	7,33	7,72	338.959	343.418	465.987
SGD) (Clase cubierta en duración) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en	SGD	119.481	8,28	8,30	8,61	989.782	991.320	1.114.65
CHF) (Clase cubierta en duración) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en	CHF	33.491	10,67	10,35	10,39	357.293	451.872	678.680
EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en	EUR	1.761.022	28,26	27,67	26,66	49.758.627	69.049.602	74.510.53
EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	194.838	12,31	11,92	11,91	2.397.820	2.527.542	4.724.04
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF)	CHF	96.410	8,12	8,31	8,47	782.472	1.442.116	1.604.58
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en GBP)	GBP	378.343	10,34	10,49	10,59	3.913.527	3.928.146	4.649.24 8.764.85
Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"  Clase de acciones "A"	USD	536.721 2.468.159	9,34 9,61	9,45 9,76	9,38 9,72	5.011.340 23.730.123	3.903.426 29.029.163	45.480.48
Clase de acciones "B"	USD	3.817	5,78	5,87	5,85	22.066	22.418	22.33
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase	EUR	1.014.170	8,41	8,60	8,70	8.530.422	12.342.389	14.491.49
cubierta en duración)	EUR	647.384	7,40	7,47	7,85	4.787.523	6.664.689	9.091.82
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	526.733	33,18	30,72	31,83	17.475.597	18.758.337	23.475.44
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase	EUR	1.231.265	15,16	14,92	14,44	18.665.918	20.286.848	24.440.47
cubierta en duración)	EUR	277.912	11,71	11,39	11,45	3.254.306	4.160.444	6.161.40
Clase de acciones "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "G"(b)	USD	6.584.614	5,99	6,11	6,21	39.433.047	39.663.211	45.103.53
Clase de acciones (mensual) (Dis) "I"	USD	32.961.523	9,05	11,11 9,16	11,06 9,08	298.321.019	2.633.467 371.400.970	2.462.76 263.639.57
Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.233	8,92	9,10	9,19	10.999	10.705	10.24
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	13.824.843	22,66	21,88	20,58	313.267.555	317.779.417	129.917.84
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en duración)	USD	40.698	15,89	15,18	14,82	646.824	617.850	7.144.98
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	15.516.089	19,48	18,96	18,16	302.214.952	36.723.612	58.871.49
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	477	24,46	23,64	22,56	11.666	281.466	258.90
Clase de acciones "I"	EUR	11.450.473	11,38	10,96	11,90	130.343.761	125.509.885	136.463.20
Clase de acciones "I"	USD	21.369.251	10,18	10,34	10,29	217.597.340	235.272.187	281.462.19
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	EUR GBP	472.129 194.735	10,62 8,89	10,83 9,02	11,01 9,10	5.013.809 1.732.124	8.258.454 1.679.406	8.786.07 997.53
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP) (Clase cubierta en duración)	GBP	54	8,02	8,10	8,48	429	434	112.73
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "IO" (Clase cubierta en AUD)	AUD	16.562	9,75	9,91	10,00	161.466	155.458	147.27
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	4.956.775	24,19	23,22	21,70	119.915.343	256.922.948	253.700.79
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en EUR)	EUR	3.922.250	21,52	20,83	19,83	84.408.975	61.068.891	87.759.30
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.923.563	22,56	21,68	20,56	43.401.092	17.807.539	10.254.64
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en JPY)	JPY	58.508.519	1.228,96	1.184,58	1.127,83	71.904.887.236		
Clase de acciones "IO"	USD	4.158.203	8,43	8,55	8,52	35.048.705	35.742.387	50.999.62
Clase de acciones de acumulación "IS"	USD	7.828.769	13,70	13,22	12,41	107.264.140	100.420.832	93.571.68
Clase de acciones de acumulación "IS" (Clase cubierta en CHF)	CHF	176.460	11,72	11,42	10,97	2.067.276	1.524.300	5.793.50
Clase de acciones de acumulación "IS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.675.555	12,16	11,82	11,31	20.371.117	18.485.860	16.993.80
Clase de acciones de acumulación "IS" (Clase cubierta en GBP)	GBP	583	12,89	12,44	11,86	7.519	11.911	123.08

	•	Acciones en circulación a	Valor liqu	idativo por a <sup>(a)</sup>	acción	Pat	rimonio neto a <sup>(a)</sup>	
	Divisa		30-nov-21 3		30-nov-19	30-nov-21	30-nov-20	30-nov
Global High Yield Portfolio (continuación)								
Clase de acciones "IS"	USD	5.530.959	9,47	9,61	9,57	52.381.667	79.660.389	76.967.2
Clase de acciones "IS" (Clase cubierta en GBP)	GBP	4.347.968	8,95	9,08	9,17	38.928.098	40.091.686	56.240.7
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	956.762	12,09	11,72	11,05	11.569.949	11.833	26.2
Clase de acciones "P"	USD	293.128	10,05	10,20	10,16	2.944.523	118.988	112.2
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en AUD)	AUD	41.190	9,86	10,01	10,06	405.981	318.655	438.3
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	2.623.701	15,29	14,78	13,91	40.129.371	41.879.813	58.771.2
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF)	CHF	59.207	12,08	11,80	11,35	715.077	693.874	208.1
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF) (Clase								
cubierta en duración)	CHF	75.348	11,13	10,75	10,73	838.472	1.090.022	1.306.3
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en duración)	USD	24.750	12,49	11,94	11,67	309.181	570.652	2.224.2
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	2.808.971	13,49	13,15	12,60	37.905.960	45.512.806	64.290.3
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) (Clase								
cubierta en duración)	EUR	240.012	11,78	11,35	11,29	2.827.612	2.809.304	5.110.6
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en SEK)	SEK	11.592	122,45	118,81	113,81	1.419.459	1.240.579	2.024.0
Clase de acciones "R"	USD	2.204.974	9,82	9,97	9,93	21.659.937	19.054.987	42.494.
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en CHF)	CHF	658.062	8,40	8,59	8,76	5.526.549	6.815.057	7.897.0
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en duración)	USD	649.156	8,55	8,58	8,88	5.547.415	6.273.122	11.723.
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	732.590	8,63	8,80	8,94	6.319.096	7.884.299	11.521.
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.452.138	9,21	9,34	9,43	13.373.912	16.778.910	83.950.
Global Sovereign Bond Portfolio			-, -	,-	, -			
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	2.696	110,34	117,94	109,88	297.531	314.302	274.
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	806	103,16	111,26	104,68	83.183	108.675	53.
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	19.379	115,09	122,26	113,20	2.230.277	3.446.245	11.
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta	000	10.070	110,00	122,20	110,20	2.200.277	0.110.210	
en EUR)	EUR	1.458.119	107,70	111,19	109,11	157.043.663	83.840.685	78.754.
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta	=0.1		,.	,.0	,	101.010.000	00.010.000	
en GBP)	GBP	2.088.676	126,35	134,22	127,34	263.894.355	368.257.259	552.023.
Clase de acciones "I"	USD	335	103,89	112,02	105,39	34.825	23.862	6.
Clase de acciones "I" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	92.309	116.05	125,15	120,57	10.712.203	12.427	11.
Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio	ODI	32.303	110,00	120, 10	120,57	10.7 12.203	12.721	
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	10.561	137,80	135,01	128,16	1.455.279	1.338.453	2.490.
Clase de acciones (trimestral) (Dis) denominada en la divisa de referencia	i	131	104,14	104,93	103,16	13.591	13.316	12.
, , ,					-			2.730.
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	12.859	105,27	106,59	104,70	1.353.727	1.369.987	2.730
Clase de acciones en otras divisas (trimestral) (Dis) (Clase cubierta en EUR)	EUR	754	91,29	92,68	92,73	68.842	8.349	3.
•	EUK	754	91,29	92,00	92,73	00.042	0.349	3.
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.579	122,18	120,62	116,45	192.868	25.284	172
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "A"	USD	9.081	102,79	103,57	101,80	933.468	975.787	919
	EUR		89,30					
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)		4.222		90,66	90,69	377.030	417.852	429
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	13.608	103,22	96,43	100,30	1.404.657	9.658	10
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	16.029	116,45	115,54	112,16	1.866.554	2.245.043	2.635
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	79	98,09	98,94	98,80	7.701	7.493	7
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	100	107,51	99,07	101,67	10.751	9.907	10
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	491.758	149,66	145,41	136,87	73.596.251	49.812.349	36.929
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	76.254	132,73	129,94	124,47	10.120.980	10.242.307	9.482
Clase de acciones "I"	USD	25.331	106,17	107,47	105,55	2.689.495	2.722.223	3.734
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO"(b)	USD	_	_	74,08	75,81	_	8.930.343	15.912
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "P"	USD	54.104	101,61	102,37	100,65	5.497.322	11.058.405	18.198
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	470.076	144,70	141,07	133,24	68.019.244	71.196.808	94.137
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	8.160	128,33	126,05	121,15	1.047.112	1.900.261	1.826
Clase de acciones "P"	USD	17.696	105,79	107,10	105,19	1.872.104	2.431.706	2.196
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	28	93,47	95,10	95,10	2.661	2.612	2
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)	GBP	46.094	100,03	101,27	100,81	4.610.986	4.500.170	4.465
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "R"	USD	8.974	99,32	100,07	98,40	891.328	917.711	744
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	103.625	139,92	136,01	128,07	14.499.740	6.812.574	8.992
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	24	125,77	123,07	117,71	2.988	2.924	936
Clase de acciones "R"	USD	20.623	102,25	103,49	101,64	2.108.624	2.344.247	2.470
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	3.640	91,12	92,69	92,76	331.710	479.042	593
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en CBP)	GBP	140	97,27	98,46	97,95	13.578	23.404	440
US Dollar Short Duration Bond Portfolio	551	140	J1,21	55,70	01,00	10.070	20.704	770
	Hen	2 511 200	110 60	111 24	107.05	277 062 117	200 674 572	248.107
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	2.511.306	110,68	111,24	107,05	277.962.117	200.671.572	
Clase de acciones "I"	USD	231.961	102,71	105,33	103,79	23.824.914	21.940.211	31
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	640.357	109,84	110,54	106,53	70.336.317	61.387.654	62.362
Clase de acciones "P"	USD	156.177	102,53	105,14	103,61	16.012.790	7.550.560	3.988
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	280.777	109,33	109,92	105,82	30.697.287	29.752.287	28.087
Clase de acciones "R"	USD	147.418	102,61	105,22	103,69	15.126.600	14.664.256	13.126
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	134.472	17,04	17,42	16,07	2.291.566	2.156.458	1.991
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	1.152	11,41	11,75	11,01	13.139	13.421	12.
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	237.255	11,82	12,26	11,56	2.805.283	2.121.267	2.539

	е	Acciones n circulación a	Valor liqu	idativo por a <sup>(a)</sup>	acción	Patr	rimonio neto a <sup>(a)</sup>	
	Divisa		30-nov-21 3		30-nov-19	30-nov-21	30-nov-20	30-nov
JS Fixed Income Portfolio								
Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"	USD	70.801	11,41	11,75	11,01	808.150	629.191	458.3
Clase de acciones "A"	USD	44.192	13,66	14,17	13,35	603.869	2.557.808	2.350.
Clase de acciones "B"	USD	1.022	11,91	12,36	11,65	12.168	12.592	11.
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	172.354	12,27	11,93	12,03	2.115.542	2.475.454	1.972.
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	8.803.587	17,82	18,09	16,58	156.884.766	79.935.777	36.796.
Clase de acciones "I"	USD	293.633	11,92	12,36	11,64	3.499.636	3.690.709	4.009
Clase de acciones (mensual) (Dis) "P"	USD	1.212	11,42	11,75	11,01	13.833	14.053	12
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	2.355.250	17,62	17,91	16,44	41.499.677	41.677.154	30.068
Clase de acciones "P"	USD	741	13,62	14,09	13,28	10.096	375.869	354
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	159.128	12,88	13,08	11,99	2.049.748	4.237.780	4.035
Clase de acciones "R"	USD	72.580	10,79	11,19	10,54	783.246	586.232	16
JS Mortgage Backed Securities Portfolio	000	72.000	10,70	11,10	10,04	700.240	000.202	
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	90.919	17,21	17,43	16,62	1.564.399	2.336.772	6.785
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	352.773	2,26	2,34	2,30	796.857	993.406	962
Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)	PLN	283.342	10,72	10,93	10,47	3.037.006	3.635.853	3.412
Clase de acciones "A"	USD	298.662	7,46	7,74	7,58	2.226.606	2.433.477	2.875
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	210.763	10,28	10,53	10,22	2.167.308	6.062.580	1.738
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	7.638.229	11,59	11,68	11,07	88.518.000	124.325.135	74.480
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	800.083	15,19	15,43	14,84	12.152.159	24.598.438	9.743
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	5.218	14,94	15,08	14,43	77.987	78.689	75
Clase de acciones "I"	USD	1.225.400	10,21	10,60	10,38	12.508.985	12.984.619	12.984
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IO"	USD	14.612.463	8,21	8,76	8,83	119.914.905	174.080.717	129.630
Clase de acciones "IO"	USD	2.844.830	10,43	10,83	10,60	29.672.229	24.866.993	38.432
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	1.117.088	15,26	15,41	14,65	17.048.497	15.351.420	15.753
Clase de acciones "P"	USD	28.051	11,40	11,83	11,59	319.743	473.974	2.611
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	233.338	12,36	12,46	11,82	2.884.232	5.959.493	17.348
Clase de acciones "R"	USD	33.877	9,89	10,26	10,03	334.941	861.149	1.402
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio								
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	7.759	109,94	110,35	96,80	853.000	473.148	1.647
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) denominada en la divisa de referencia	USD	33.814	90,16	95,14	87,75	3.048.622	4.811.758	13.093
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	14.901	96,01	99,37	90,27	1.430.593	2.632.427	5.630
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	160	98,00	99,53	88,68	15.631	15.693	13
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	105	104,43	106,25	95,03	10.998	11.040	9
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) denominada en otras divisas	000	100	10-1,-10	100,20	00,00	10.000	11.040	
Clase parcialmente cubierta en AUD)  Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) denominada en otras divisas	AUD	11.435	93,67	97,01	95,35	1.071.037	1.858.631	2.663
Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	6.539	90,47	92,13	90,63	591.587	461.785	212
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) denominada en otras divisas Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	11.384	88,78	93,61	89,21	1.010.726	1.348.633	1.109
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) denominada en otras divisas Clase parcialmente cubierta en SGD)	SGD	94.274	90,17	93,88	88,19	8.500.463	13.271.609	15.067
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis)	HKD	841	105,69	108,70	99,59	88.866	88.748	78
	TIND	041	105,09	100,70	99,39	00.000	00.740	70
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase	AUD	1.714	99,74	101 25	97,88	170.966	168.498	157
arcialmente cubierta en AUD) Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase	AOD	1.7 14	99,74	101,25	91,00	170.900	100.490	157
parcialmente cubierta en GBP) Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase	GBP	1.143	94,51	97,69	91,57	108.005	108.388	98
parcialmente cubierta en SGD)	SGD	32.221	96,11	98,09	90,65	3.096.728	3.911.614	4.721
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	285	109,40	104,76	100,82	31.130	44.136	32
Clase de acciones "E"	EUR	340	105,96	102,32	99,82	36.063	31.797	32
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	521	113,03	112,63	98,22	58.909	81.898	2.685
	i							
Clase de acciones "I"	USD	108	105,25	106,95	95,64	11.325	11.283	9
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	100	110,85	111,05	97,22	11.085	11.105	9
Clase de acciones "P"	USD	106	104,65	106,43	95,19	11.085	11.105	9
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	100	113,06	112,69	98,17	11.306	11.269	9
Clase de acciones "R"	USD	107	105,20	106,91	95,60	11.306	11.269	g
SG-Enhanced Global Multi-Asset Balanced Portfolio(b)								
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	106.740	145,75	130,89	119,50	15.557.070	11.368.533	14.590
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	5.627	140,03	125,76	115,49	787.950	449.907	3.913
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase parcialmente	l		-,	., .	.,			
ubierta en EUR)	EUR	98.007	127,00	113,34	107,52	12.447.086	6.655.748	5.423
Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta	1		,	-,	. ,			
n EUR)	EUR	25.035	138,02	123,17	117,50	3.455.235	3.254.455	5.156
n Ecty Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta n GBP)	GBP	39.937	146,90	132,04	124,09	5.866.643	6.558.681	8.039
en GBP)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase parcialmente cubierta	GBP	39.937	140,90	132,04	124,09	3.000.043	0.000.001	0.038
	EUD	E0 765	130 04	122 70	119.00	9 240 274	E 420 442	4 070
en EUR)	EUR	59.765	138,01	123,79	118,02	8.248.274	5.438.443	4.873
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	64.840	153,97	137,27	124,40	9.983.694	20.464.129	21.730
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta		<b>-</b>	, <del></del>		465			
en EUR)	EUR	3.784	127,75	113,17	106,56	483.341	237.655	10
Clase de acciones "I"	USD	8.587	141,23	126,68	116,30	1.212.786	830.438	1.390
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase parcialmente cubierta en	1							
					100 10		44.005	40
EUR)	EUR	1.663	127,56	113,05	106,49	212.138	11.305	10

	е	Acciones n circulación a	Valor liqu	idativo por a <sup>(a)</sup>	acción	Pat	rimonio neto a <sup>(a</sup>	)
	Divisa		30-nov-21		30-nov-19	30-nov-21	30-nov-20	30-nov-19
Global Multi-Asset Conservative Portfolio								
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase parcialmente	USD USD	116.954 5.268	132,20 123,69	126,81 119,62	115,86 110,75	15.461.801 651.630	8.203.087 250.629	5.991.446 1.000.058
cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta	EUR	124.674	117,12	112,34	105,85	14.601.423	7.039.572	6.667.750
en EUR)	EUR	855	116,98	113,17	108,01	100.050	553.781	662.788
Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	10.790	125,22	121,20	114,53	1.351.108	2.553.678	3.191.988
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase parcialmente cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I"	EUR USD	123.409 2.312.132	120,54 139,20	116,19 132,61	110,02 120,33	14.875.150 321.852.185	7.034.089 328.581.047	5.420.896 394.612.937
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	3.585	117,76	112,18	104,96	422.223	1.502.660	59.115
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	397.643	118,38	112,87	104,53	47.073.261	51.054.028	55.746.286
Clase de acciones "I" Clase de acciones de acumulación "R" (Clase parcialmente cubierta en	USD	112	124,58	120,43	111,46	13.939	13.277	12.043
EUR) Clase de acciones "R" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	EUR GBP	1.356 239.612	117,64 126,01	112,11 121,89	104,92 115,17	159.561 30.193.006	152.056 24.395.437	10.492 23.009.947
Global Multi-Asset Growth Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	34.170	154,32	133,80	122,99	5.273.316	6.413.106	18.613.609
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase parcialmente	USD	2.115	151,07	130,99	120,40	319.486	259.860	262.453
cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta	EUR	13.580	131,56	112,75	108,46	1.786.488	723.752	1.110.107
en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta	EUR	1.555	153,05	131,17	126,44	238.019	445.969	747.452
en GBP) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase parcialmente cubierta	GBP	8.217	163,10	141,51	133,69	1.340.220	1.594.091	2.360.229
en EUR) Clase de acciones de acumulación "I"	EUR USD	7.554 1.124.617	150,99 163,95	130,06 141,02	125,75 128,60	1.140.566 184.384.688	1.440.358 172.074.771	1.891.882 231.166.809
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en EUR) Clase de acciones "I"	EUR USD	100 107	132,96 152,70	113,03 131,80	107,85 121,36	13.296 16.390	11.303 14.096	10.785 12.853
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	107	132,70	112,89	107,76	13.272	11.289	10.776
Clase de acciones "R" (Clase parcialmente cubierta en GBP)  Global Multi-Asset Income Portfolio  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa	GBP	99.060	165,37	142,86	135,21	16.381.173	9.800.120	8.559.018
de referencia Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) denominada en la divisa	USD	10.605	145,49	134,57	127,29	1.542.992	893.943	364.750
de referencia Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa	USD	735.005	104,79	102,94	103,42	77.019.077	30.412.105	14.543.753
de referencia  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	1.998.668 53.178	101,02 121,68	98,14 115,19	99,61 112,21	201.902.898 6.470.752	31.670.788 3.961.943	6.037.204 1.832.808
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase cubierta	HKD	13.262.451	102,96	99,42		1.365.451.121	21.546.966	103.155
en AUD) Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase	AUD	673.565	100,54	97,93	101,41	67.723.221	1.707.882	167.674
cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase	EUR	678	97,33	95,60	97,53	65.964	26.969	118.191
cubierta en SGD) <sup>(b)</sup> Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta	SGD	2.328	102,65	_	_	238.987	_	_
en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR EUR	351 12.442	121,24 118,29	113,16 112,83	109,26 112,32	42.501 1.471.764	39.668 1.376.861	140.628 1.261.999
Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"  Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	USD EUR	20.201 62.842	110,69 94,03	105,98 92,11	106,03 95,91	2.235.982 5.909.316	1.671.832 728.265	1.133.768 477.397
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	77.548	109,43	105,77	108,06	8.485.949	5.919.810	5.032.035
Clase de acciones (estable mensual) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	37.771 33.647	94,09 135,46	92,98 127,19	95,44 123,54	3.553.845 4.557.788	188.510 4.102.537	263.904 4.552.292
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	13.822	153,47	140,97	132,42	2.121.145	2.060.316	28.692
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "I"	USD	9.526 437	141,79 122,16	131,43 115,83	126,02 112,97	1.350.646 53.379	1.537.629 54.806	1.528.443 73.677
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	100	148,36	136,85	129,11	14.836	13.685	12.911
Clase de acciones "P"	USD	122	121,17	114,84	112,48	14.836	13.685	12.911
Clase de acciones "R" (bruta mensual) (Dis) (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	GBP EUR	75.351 79	111,60 149,25	108,04 138,38	111,24 132,68	8.409.525 11.861	8.522.597 10.997	11.282.958 132.682
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	108	109,73	112,91	113,02	11.869	11.005	132.695
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	912	128,50	122,17	121,09	117.183	123.530	268.545

	е	Acciones n circulación	Valor liqu	uidativo po	r acción	n-	trimonic noto -1	a)
	Divisa	a 30-nov-21	30-nov-21	a <sup>(a)</sup>	20 nov 10	30-nov-21	trimonio neto a <sup>(</sup> 30-nov-20	30-nov-
US Real Estate Balanced Portfolio	Divisa	30-110V-21	30-1104-21	30-1104-20	30-1104-19	30-1104-21	30-1104-20	30-1104-
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	185.779	194,89	171,13	164,68	36.206.749	28.654.615	41.657.25
Clase de acciones (bruta mensual MBS) (Dis) (Cap) denominada en la divisa de referencia	USD	170	124,82	112,91	112,87	21.280	13.448	12.93
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Cap)	1							
(mensual MBS) (Dis)	USD	130.264 126	161,18 152,83	143,62 136,09	141,02 133,59	20.996.562 19.243		25.414.52 29.49
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones en otras divisas (Cap) (bruta mensual MBS) (Dis)	030	120	152,65	130,09	133,39	19.243	10.094	29.48
(Clase de acciones en otras divisas (Cap) (mensual MBS) (Dis) (Clase de acciones en otras divisas (Cap) (mensual MBS) (Dis) (Clase	SGD	1.717	121,62	110,06	110,86	208.865	183.393	177.88
cubierta en SGD)	SGD	19.663	158,88	141,60	140,16	3.124.023	2.375.638	2.297.6
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	8.146	164,38	146,37	144,48	1.339.061	1.183.642	2.284.0
Clase de acciones (mensual MBS) (Dis) (Cap) "I"	USD	138.906	158,57	141,29	138,74	22.026.899		21.213.1
Clase de acciones (mensual) (Dis) "I"	USD	8.616	152,88	136,17	133,67	1.317.176		57.4
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	78.072	213,11	185,50	176,96	16.637.681	15.387.777	47.213.4
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	112.687	173,36	152,27	148,27	19.535.018		13.469.1
Clase de acciones (mensual MBS) (Dis) (Cap) "P"	USD	201.546 126	160,94	143,40	140,81 133,53	32.437.637 19.177	37.184.637 16.740	69.419.2 16.0
Clase de acciones (mensual) (Dis) "P" Clase de acciones de acumulación "P"	USD	191.997	152,74 206,17	136,03 180,09	172,41	39.584.629		69.886.2
Clase de acciones (mensual MBS) (Dis) (Cap) "R"	USD	5.351	122,98	109,57	107,60	658.026		473.6
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R"	GBP	116	129,74	115,43	117,40	15.071	13.530	13.2
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	3.628	124,29	110,93	111,19	450.957	563.972	3.999.7
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	119.293	204,17	177,84	169,78	24.355.713		23.110.3
Clase de acciones "R"	USD	41.954	164,79	147,30	144,97	6.913.409		7.087.1
Emerging Markets Total Return Bond Portfolio			,.	,	,			
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	13.776	111,81	110,89	102,26	1.540.236	1.034.751	10.2
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	112	99,79	101,37	97,22	11.184	11.090	10.2
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	200	102,79	102,76	96,57	20.558	20.553	19.3
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	225	91,35	93,53	91,52	20.557	20.553	19.3
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	200	101,05	101,46	95,61	20.211	20.292	19.1
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	60.726	114,24	112,69	103,56	6.937.099	9.353.157	15.418.5
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	106	107,32	106,71	100,25	11.401	11.335	10.6
Clase de acciones "I"	USD	102	100,26	101,62	97,80	10.276	10.133	149.2
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en AUD)	AUD	1.350	115,20	113,03	103,84	155.524	152.587	140.1
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.050.000	110,52	108,25	99,66	116.050.112		104.641.1
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	200	104,90	104,35	97,75	20.981	20.870	19.5
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	500	108,35	107,00	99,91	54.174		49.9
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	229	91,80	93,76	92,01	20.982		19.5
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)  Global Absolute Return Portfolio	GBP	571	94,78	96,31	93,96	54.159	53.477	49.9
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	558	107,85	102,55	103,23	60.196	57.241	66.6
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	101	107,83	102,55	102,00	10.658		10.2
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	000	101	100,04	100,01	102,00	10.030	10.131	10.2
(Clase cubierta en EUR)	EUR	1.185	95,64	91,80	94,10	113.316	91.796	94.
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK)	SEK	8.459	95,69	91,32	93,60	809.440	746.138	764.
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	540	92,88	89,52	93,60	50.199		127.4
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	118.056	112,89	106,61	106,58	13.327.190		32.185.
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	400.939	100,14	95,45	97,18	40.148.266		48.978.2
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	4.241	105,65	100,03	101,47	448.069		753.4
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en JPY)	JPY		10.361,51		-		6.139.725.809	
Clase de acciones "I"	USD	100	109,40	103,42	104,96	10.973		10.3
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	76	97,50	93,04	95,86	7.449		97.4
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	500	99,69	94,51	97,00	49.844	56.610	117.2
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	101.590	117,61	110,40	109,71	11.947.619		12.171.
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)(b)	GBP	1.564.854	97,62	_	_	152.762.740	_	
Clase de acciones "IO"	USD	19	110,38	104,31	105,53	2.100	83.366.193	46.818.
Clase de acciones de acumulación "P"(b)	USD	_	_	104,59	104,80	_	10.459	10.4
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)(b)	EUR	_	_	93,81	95,58	_	5.282	95.5
Clase de acciones "P"(b)	USD	_	_	102,75	103,98	_	10.459	10.4
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	71	100,06	95,46	97,09	7.106		97.0
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	73	97,29	92,93	95,66	7.104	6.773	97.0
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	9.504	102,80	97,46	100,04	977.012	1.307.259	1.756.0

		Acciones						
	e	n circulación a	Valor liq	uidativo po a <sup>(a)</sup>	r acción	Pa	trimonio neto a	a)
	Divisa	-	30-nov-21		30-nov-19	30-nov-21	30-nov-20	30-nov-19
Global Dynamic Bond Portfolio(b)								
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	6.825	122,31	124,97	119,53	834.791	114.723	116.190
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de								
referencia (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.955	107,82		107,91	210.784	189.964	212.874
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	745	88,79	92,26	89,46	66.182	73.404	89.683
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase		050	00.04	00.00	05.00	50 700	100 711	100 50
cubierta en EUR)	EUR	652	82,31	86,20	85,03	53.700	120.714	199.581
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en GBP)	GBP	576	85,77	89,22	87,20	49.433	51.424	50.255
Clase de acciones "A"	USD	4.584	97,68		98,42	447.808	608.861	537.856
Clase de acciones A Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	8.657	100,59		101,19	870.790	607.668	180.793
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	100	122,48		119,41	12.248	12.459	11.941
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD)(b)	AUD	131	98.98	124,55	119,41	12.240	12.433	11.54
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AOD)"  Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	6.014	109.31	112.23	109.00	657.404	3.028.983	635.024
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	812	67,15		69,35	54.506	55.945	54.20
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)	GBP	3.336.479	126,33		122,81	421.511.442		
Clase de acciones "IO" (Clase cubierta en AUD)	AUD	239.659	103,27	107,46	105,01	24.748.821	24.968.493	
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	100	114,05	116,12	111,15	11.413	11.620	11.456
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	2.894	101,16		100.88	292.761	458.048	136.134
Clase de acciones "R"	USD	709	99,74		100,66	70.679	122.226	130.132
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.149	88,05	91,90	90,96	101.199	103.946	100.892
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.147	94,57	97,97	96,16	108.483	110.648	106.617
Global Dynamic Bond Plus Portfolio <sup>(b)</sup>	00.	1.1-11	04,01	01,01	50,10	100.400	110.040	100.017
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	179.342	123,05	127,60	117,83	22.067.781	25.944.346	31.308.455
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	7.794	96,80	103,55	98.69	754.493	899.651	3.583.104
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	161.198	99,89		101,69	16.102.398	22.226.743	25.882.295
Clase de acciones en otras divisas (trimestral) (Dis) (Clase cubierta	005		00,00	.00,.0	.0.,00	10.102.000		20.002.200
en SGD)	SGD	1.978	88,99	95,48	91,44	176.038	1.423.091	1.220.323
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta	005		00,00	00,.0	0.,	170.000	1.120.001	1.220.020
en CHF)	CHF	15.607	94,04	98,55	92,87	1.467.563	1.832.836	3.142.096
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta	0	.0.001	0.,0.	00,00	02,0.		1.002.000	0.1.12.000
en EUR)	EUR	78.696	109,21	114,21	107,25	8.594.457	11.339.076	12.760.406
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta		. 0.000	.00,2.	,	.0.,20	0.0001	11.000.010	12.700.700
en SEK)	SEK	50.199	96,94	100,98	94,72	4.866.407	6.875.814	6.412.135
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF)	CHF	1.244	81,20	87,59	85,15	101.006	105.870	99.764
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	167.821	82,30	88,56	85,84	13.811.953	20.985.261	23.775.234
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en GBP)	GBP	2.987	94,52		97,38	282.375	361.080	538.04
Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"	USD	16.596	96,74		98,64	1.605.482	2.180.070	2.879.85
Clase de acciones "A"	USD	67.422	99,65		101,45	6.718.741	9.282.320	
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	87.590	86,52		90,67	7.578.262	12.129.072	
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	99.715	103,73		102,89	10.343.225	14.848.985	
Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP)(b)	GBP	_	_	_	_	_	_	_
Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	2.000.119	91,91	98,49	95,01	183.822.552	197.001.445	190.028.04
Clase de acciones (semestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en JPY)	JPY	48.063	8.054,25	8.681,14	8.393,29	387.112.391	417.242.472	1.262.973.66
Clase de acciones de acumulación "I"(b)	JPY	599.950	9.959,18	_	_	5.975.007.978	_	_
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	407.725	132,49	136,48	125,19	54.018.271	45.056.702	46.411.73
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF)	CHF	29.040	99,52	103,61	96,99	2.890.045	3.717.076	3.963.25
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.476.260	117,89	122,46	114,23	174.036.599	227.109.535	220.637.82
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	866.815	106,42	109,80	101,95	92.248.535	98.414.517	91.353.01
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en JPY)	JPY	460.730	10.099,09	10.447,32	9.740,60	4.652.957.389	9.522.546.136	9.057.105.80
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK)	SEK	2.503	99,23	102,67	95,66	248.327	256.937	239.39
Clase de acciones "I"	EUR	5.247	109,62	111,13	115,41	575.209	650.760	835.65
Clase de acciones "I"	USD	44.449	100,51	107,42	102,35	4.467.372	5.008.921	167.500.66
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en AUD)	AUD	1.514	92,16	98,55	98,09	139.490	144.244	133.66
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	6.103	89,08	95,78	92,87	543.655	1.528.321	1.584.64
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	5.422	95,04		97,92	515.322	538.549	460.42
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.861.375	111,53		105,56	207.592.667	156.277.068	
Clase de acciones de acumulación "IS"(b)	USD	_	_	117,08	107,36	_	12.065	
Clase de acciones "IS"	USD	171	100,03		101,81	17.084	17.579	16.10
Clase de acciones "IS" (Clase cubierta en GBP)	GBP	126	95,20		98,01	12.041	12.403	11.50
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO"	USD	2.117.272	40,48	48,50	51,76	85.709.441	115.207.649	
Clase de acciones (mensual) (Dis) "P"	USD	7.390	96,74		98,65	714.861	495.716	461.00
	USD	103.125	129,01	133,22	122,51	13.304.145	11.747.175	
Clase de acciones de acumulación "P"	เบอบ							
Clase de acciones de acumulación "P" Clase de acciones de acumulación "P"	080	100.120	123,01	100,22	122,51	10.004.140	11.747.175	12.074.37

		Acciones						
		en circulación	Valor liqu	idativo poi	r acción	_		a)
		a		a <sup>(a)</sup>	<del></del>		trimonio neto a <sup>(i</sup>	
	Divisa	30-nov-21	30-nov-21	30-nov-20	30-nov-19	30-nov-21	30-nov-20	30-nov-19
Global Dynamic Bond Plus Portfolio <sup>(b)</sup> (continuación) Clase de acciones "P"	USD	17.085	100.32	107.22	102.10	1.713.943	3.398.315	4.548.978
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	17.005	86,15	92,70	91,29	8.582	8.938	8.354
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)	GBP	27.369	95,03	101,60	97,86	2.600.801	3.071.896	2.537.936
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R"	USD	4.852	91,56	97,96	93,37	444.249	475.330	775.76
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	196.338	119,80	123,48	113,34	23.521.868	21.226.218	20.110.480
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF)	CHF	781	97,87	101,97	95,51	76.428	79.630	74.58
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	37.690	107,33	111,57	104,14	4.045.168	7.745.017	9.557.849
Clase de acciones "R"	USD	43.642	95,92	102,51	97,62	4.186.058	4.244.285	3.651.776
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	53.339	85,59	92,04	89,22	4.565.419	7.006.908	7.798.38
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	15.998	91,39	97,70	94,09	1.462.082	3.475.070	5.719.54
Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)								
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	EUR	233.940	15,68	16,25	15,19	3.668.147	4.227.456	3.666.39
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa								
de referencia (Clase cubierta en USD)	USD	859.523	17,68	18,18	16,71	15.192.685	3.249.847	1.496.20
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	EUR	113.869	11,69	12,27	11,69	1.331.129	1.784.000	1.876.01
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase								
cubierta en USD)	USD	66.525	11,77	12,26	11,46	782.817	2.682.157	3.734.78
Clase de acciones "A"	EUR	243.145	12,09	12,70	12,07	2.940.042	1.970.922	2.046.71
Clase de acciones "A" (Clase cubierta en USD)	USD	560.023	13,68	14,26	13,33	7.661.674	8.026.440	7.883.07
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	161.566	14,74	15,31	14,35	2.380.873	1.329.236	1.187.15
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	22.642.509	16,23	16,72	15,54	367.385.655	279.083.413	201.037.33
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD)(b)	AUD	14.398	10,04	_	_	144.607	_	-
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)	USD	9.948.845	18,01	18,41	16,83	179.191.311	128.315.733	83.583.77
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	91.755	12,27	12,79	12,06	1.125.389	1.152.253	1.153.37
Clase de acciones (semestral) (Dis) "IO"(b)	EUR	109.186.468	9,61			1.049.773.890	<del></del>	
Clase de acciones de acumulación "IO"	EUR	1.000	17,48	17,93	16,58		1.037.242.199	774.416.87
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)	GBP	10.453	18,94	19,29	17,71	197.992	3.712.002	3.318.14
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en SEK)(b)	SEK	11.754.754	98,41	40.00	47.00	1.156.738.779	-	
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD)	USD	1.101.076	19,33	19,68	17,90	21.279.468	60.625.142	38.637.78
Clase de acciones "IO" (Clase cubierta en USD)	USD	7.345.527	11,63	12,12	11,32	85.412.364	92.297.229	107.877.81
Clase de acciones de acumulación "P"	EUR	156.449	16,21	16,77	15,64	2.536.294	3.491.057	1.249.15
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD)	USD GBP	2.216.790	18,04	18,51	16,97	39.986.076	25.629.277	16.498.96
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)	EUR	721 586.167	13,54	14,31	13,49	9.754	10.015 6.626.607	2.737.33
Clase de acciones de acumulación "R"  Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en USD)	USD	379.230	12,35 13,88	12,74 14,20	11,85 12,99	7.237.742 5.264.412	4.317.229	6.937.09 4.526.78
Clase de acciones "R"	EUR	262.144	10,74	11,27	10,71	2.814.958	2.359.377	1.514.10
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	225.624	11,54	12,04	11,35	2.604.613	2.803.085	4.030.13
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD)	USD	22.814	11,11	11,59	10,83	253.581	312.245	239.72
Global Strategic Macro Bond Portfolio	OOD	22.014	,	11,55	10,00	200.001	312.243	200.12
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa								
de referencia	USD	89.549	107,24	111,23	106,98	9.603.112	12.127.129	20.986.78
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa			- ,	, -	,			
de referencia en CHF)	CHF	5.006	89,94	94,29	92,29	450.258	577.271	586.23
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	6.944	94,08	100,88	99,26	653.305	433.037	521.19
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta								
en EUR)	EUR	87.130	95,44	99,83	97,52	8.315.580	12.433.903	19.523.03
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta	000	4.054	00.07	400.00	00.57	100.011	000 000	400.00
en GBP)	GBP	1.954	98,87	102,68	99,57	193.244	200.686	489.39
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK)	SEK	587.752	95,99	99.99	97.30	56.416.411	98.481.615	122.226.86
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	581	82,29	88,80	88,81	47.798	59.266	57.89
Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)	PLN	21.163	100,51	104,89	101,62	2.127.008	4.321.980	6.545.39
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	117.408	92,37	97,09	95,33	10.844.503	17.988.659	25.024.09
Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP) <sup>(b)</sup>	GBP	117.400	52,37	91,09	95,55	10.044.505	17.300.009	23.024.08
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	87.011	111,14	114.67	109.95	9.670.706	17.452.489	72.454.10
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF)	CHF	2.455	95,24	99,32	96,78	233.802	3.048.034	12.047.98
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.485.754	99,07	103,06	100,26	147.189.184	232.138.335	485.270.06
Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en EUR)	EUR	32.225	94,45	98.60	96,12	3.043.576	2.557.974	3.028.22
Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP)(b)	GBP	02.220	J-1,-13	107,92	104,39	0.0-10.070	4.232	4.09
		4.074	405.00			440.040		
	GBP	1 ()/1	105.32	100 02		117 840	5.4nn 4/3	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK)	GBP SEK	1.071 4.003.981	105,32 99,68	108,82 103,29	105,17 99,95	112.840 399.105.223	5.466.473 413.582.776	6.173.09 1.307.830.21

	,	Acciones en circulación	Valor liq	uidativo po	r acción			
		a		a <sup>(a)</sup>			rimonio neto a <sup>(a</sup>	
	Divisa	30-nov-21	30-nov-21	30-nov-20	30-nov-19	30-nov-21	30-nov-20	30-nov-1
Global Strategic Macro Bond Portfolio (continuación)	USD	104	98.65			10.269		
Clase de acciones "I"(b) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	25.928	84,64	91,24	91,33	2.194.603	1.977.848	75.923.98
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	53.038	118,85	122,00	116,08	6.303.761	6.180.623	5.266.28
Clase de acciones de accimulación 10  Clase de acciones "IO"	USD	670.842		100.71		62.998.756	26.001.412	22.389.54
			93,91		99,12			
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	8.395	109,04	112,82	108,18	915.472	1.262.703	2.950.43
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en CHF)	CHF	100	90,80	94,92	92,71	9.080	9.492	9.27
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	386	97,16	101,37	98,76	37.507	104.836	453.41
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en GBP)	GBP	58	96,82	100,24	96,89	5.587	5.784	5.59
Clase de acciones "P"	USD	105	94,57	101,38	99,76	9.932	607.228	254.01
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	27.426	104,67	108,02	103,43	2.870.791	3.745.285	7.316.01
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF)	CHF	4.210	92,07	96,03	93,54	387.623	834.524	6.971.49
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	75.960	98,83	102,86	100,03	7.507.469	8.596.826	11.847.95
Clase de acciones "R"	USD	57.812	91,73	98,27	96,77	5.303.126	5.678.734	7.514.04
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	5.228	84,59	91,23	91,25	442.243	710.495	1.384.26
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	12.696	89,86	96,29	95,57	1.140.836	1.582.680	1.767.19
Clase de acciones de acumulación "RS"	USD	28.903	103,45	106,63	102,23	2.989.959	3.199.427	401.8
Clase de acciones de acumulación "RS" (Clase cubierta en CHF)	CHF	33.593	100,09	104,25	101,74	3.362.234	4.673.484	1.383.4
Clase de acciones de acumulación "RS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	6.732	100,59	104,53	101,78	677.154	430.866	982.5
Clase de acciones "RS"	USD	9.354	99,51	106,32	102,22	930.849	994.045	11.1
Clase de acciones "RS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	3.245	96,96	104,23	101,78	314.645	406.893	397.3
Strategic Absolute Return Bond II Portfolio								
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	978	127,50	134,26	126,81	124.745	644.491	140.43
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia								
(Clase cubierta en EUR)	EUR	6.878	112.99	119.98	115.10	777.107	787.958	756.1
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	2.749	97,09	104,51	100,55	266.905	281.534	266.3
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	005	20	0.,00	,	.00,00	200.000	201.001	200.0
(Clase cubierta en EUR)	EUR	1.239	86,61	93,85	91,75	107.286	240.262	223.7
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia		1.200	00,01	00,00	0.,.0	.0200	2.0.202	220
(Clase cubierta en GBP)	GBP	45	94,32	101,53	98,75	4.215	26.902	72.8
Clase de acciones "A"	USD	4.082	100,87	108,59	104,48	411.774	506.197	582.7
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	3.262	102,17	109,00	105,11	333.251	666.323	1.130.7
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	78	139,15	145,63	137,05	10.873	16.331	10.7
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	7.656	124,52	131,37	125,26	953.279	4.086.109	3.896.2
Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP)	GBP	533.456	100,31	105,68	100,85	53.511.048	56.117.479	53.308.5
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)	GBP	546	139,96	145.98	137.92	76.403	79.692	75.2
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	780	113,64	118,98	111,98	88.643	92.803	87.3
Clase de acciones "R"	USD	119	95,56	102,66	98,90	11.366	816.685	786.5
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	30.676	90,06	96,99	94,32	2.762.618	2.972.451	2.888.3
Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio								
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	1.439.577	31,15	25,56	22,78	44.836.433	34.905.134	46.398.6
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	2.222.968	35,98	29,52	26,38	79.977.464	71.841.589	70.677.7
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	727.898	35,04	27,28	26,50	25.506.534	19.566.859	27.995.4
Clase de acciones "I"	USD	2.250.529	27,93	22,83	20,39	62.853.620	55.836.948	83.207.8
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	1.724.804	30,07	24,50	21,67	51.863.128	236.112.141	304.956.6
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	480.387	32,88	25,44	24,56	15.796.703	14.705.525	8.447.3
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	2.127.606	28,35	23,12	20,47	60.326.964	51.846.276	46.676.7
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	599.372	14,73	12,12	11,05	8.826.101	10.703.854	16.139.7
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.582.809	15,51	12,71	11,64	24.550.502	23.198.818	24.153.8
Clase de acciones "R"	USD	9.351.183	26,92	22,00	19,65	251.779.824	179.358.812	159.234.3
Global Corporate Portfolio (Hedged)			,	,	,			
Clase de acciones de acumulación "I"	NOK	93.618.190	183,51	185,57	174 54	17.179.988.9931	7 358 002 7491	4 856 694 8
Absolute Return Tracker Portfolio	11011	00.010.100	100,01	100,01	174,04	17.170.000.0001	7.000.002.7401	4.000.004.0
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	389.922	11,44	10,82	10,66	4.458.949	1.050.967	904.8
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta	030	309.922	11,44	10,02	10,00	4.430.343	1.030.907	304.0
en CHF)	CHF	289.239	10,48	10,03	10,07	3.031.790	4.665.047	1.263.2
	"	203.233	10,40	10,03	10,07	3.031.790	7.000.047	1.203.2
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	8.117.437	10,42	9,95	9,96	84.604.657	9.295.578	13.547.4
	LUK	0.117.437	10,42	9,95	9,90	04.004.037	a.280.010	10.047.4
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SGD)	SGD	14.000	11.59	10.97		162,246	153.579	
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	110.703	11,39	10,97	10,64	1.251.008	202.128	123.3
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	28.838	10,63	10,20	10,26	306.556	42.421	15.6
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	18.807.199	12,94	12,15	11,89	243.319.674	108.402.642	170.680.7
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD)	AUD	103	12,46	11,75	11,69	1.281	1.209	1.2
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF)	CHF	21.043.228	11,19	10.63	10.60	235.503.100	220.306.778	209.831.0

		Acciones en circulación a	Valor liq	uidativo po a <sup>(a)</sup>	r acción	Pa	trimonio neto a <sup>(</sup>	a)
	Divisa	30-nov-21	30-nov-21	30-nov-20	30-nov-19	30-nov-21	30-nov-20	30-nov-19
Absolute Return Tracker Portfolio (continuación)								
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	19.324.111	12,36	11,72	11,65	238.864.991	141.040.751	186.467.842
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	829.958	12,71	11,97	11,85	10.546.416	11.517.377	15.828.220
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en JPY)	JPY	5.631.525	1.086,38	1.024,01	1.014,31	6.118.004.673	3.581.122.944	3.548.401.962
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK)	SEK	1.648.487	109,98	104,00	104,09	181.305.245	110.652.214	116.272.798
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	1.385.620	11,74	11,07	10,87	16.270.334	13.111.525	14.304.580
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	234.089	11,49	10,93	10,91	2.689.950	1.662.627	1.310.307
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	6.857.525	10,64	10,09		72.989.589	46.686.011	55.555.612
Clase de acciones "R"	USD	6.843.042	12,49	11,74	11,58	85.461.699	50.699.236	46.738.703
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	2.238.043	11,91	11,23	11,20	26.656.306	21.650.512	22.215.534
Alternative Trend Portfolio								
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta	1							
en EUR)	EUR	237.647	9,23			2.192.861	1.308.131	234.324
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	53.196	10,86		10,51	577.457	177.002	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	4.251.289	10,04	9,65		42.677.272		
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	4.422.638	10,41	9,96		46.058.144	2.268.172	
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.945.375	11,04	10,56		21.482.398		
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	29.166.058	11,51	10,88		335.711.896	258.955.979	184.872.649
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en JPY)	JPY	696.562	1.054,00			734.178.755	204.919.705	
Clase de acciones "IO"	USD	3.194.559	10,73		10,56	34.291.769	40.232.681	45.458.075
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	14.237	9,90	9,46	9,93	140.881	101.542	69.279

<sup>(</sup>a) Consulte la Nota 3(k). (b) Consulte el Anexo III (sin auditar).

## 1 Organización

Goldman Sachs Funds (en lo sucesivo, el "Fondo") se constituyó el 5 de noviembre de 1992 con arreglo a la legislación del Gran Ducado de Luxemburgo, adoptando la forma de "Société d'Investissement à Capital Variable" ("SICAV"), por un periodo de tiempo indefinido. El Fondo está registrado de conformidad con la Ley de 17 de diciembre de 2010, en su versión modificada. El Fondo ha designado a Goldman Sachs Asset Management Fund Services Limited ("GSAMFSL") (la "Sociedad Gestora") como su Sociedad Gestora. GSAMFSL está autorizada y regulada por el Banco Central de Irlanda, y es una filial indirecta propiedad al 100 % de The Goldman Sachs Group Inc.

Consulte la Nota 6 para obtener más información sobre las funciones que la Sociedad Gestora ha delegado.

El Fondo ha nombrado a State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (el "Depositario") para que actúe como Depositario de los activos del Fondo.

A 30 de noviembre de 2021, el Fondo se compone de sesenta y cinco carteras diferentes ("las Carteras").

A 30 de noviembre de 2021, el Fondo ofrecía acciones en las Carteras, tal y como se detalla en el Anexo II (sin auditar).

Consulte el Anexo III (sin auditar) para conocer las Carteras y Clases de acciones que se lanzaron, fusionaron o cerraron durante el ejercicio.

Anteriormente, Goldman Sachs India Equity Portfolio ("India Equity Portfolio") invertía a través de una filial creada con fines especiales propiedad absoluta del Fondo, Goldman Sachs India Limited (en adelante, la "Filial"), una sociedad privada constituida en Isla Mauricio con responsabilidad limitada. La Filial está administrada por Intercontinental Trust Limited, con sede en Mauricio. Intercontinental Trust Limited ha subdelegado la función administrativa a State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch. Durante el ejercicio, se transfirieron las inversiones de la cartera de la Filial a India Equity Portfolio. Las inversiones que realizó la Filial en nombre de India Equity Portfolio se transfirieron desde la Filial para que India Equity Portfolio las mantuviera directamente. La transferencia se completó el 7 de octubre de 2021 (la "Fecha de transferencia") y, a partir del 30 de noviembre de 2021, no se mantiene ninguna inversión de India Equity Portfolio a través de la Filial.

La capacidad de India Equity Portfolio para continuar invirtiendo en India depende de que siga reuniendo los requisitos actuales y futuros que la Comisión de Valores y Bolsa de India ("SEBI") exige a inversores institucionales extranjeros. Si India Equity Portfolio (o el Asesor de inversiones) no lograra reunir en el futuro los requisitos aplicables en ese momento, dicha cartera ya no estaría autorizada a invertir directamente en valores indios y puede que le resulte imposible aplicar su estrategia principal, además de verse obligada al cierre y liquidación.

Los costes y gastos asumidos por la Filial se asignan a India Equity Portfolio, que anteriormente invertía su patrimonio a través de la Filial. Al tratarse de una filial totalmente participada por India Equity Portfolio, todos los activos, pasivos, ingresos y gastos de la misma se consolidan en el Balance de situación y en la Cuenta de pérdidas y ganancias de India Equity Portfolio, siendo eliminados todos los saldos y transacciones internas entre empresas.Las cuentas de la Filial son auditadas por PricewaterhouseCoopers, Ltd., radicada en Mauricio.

Durante su actividad inversora previa desarrollada en India durante el ejercicio, la Filial incurrió y pagó determinadas comisiones y gastos, entre ellos gastos de corretaje y comisiones, costes de transacción asociados a la conversión de divisas del dólar a la rupia india (y viceversa), comisiones incurridas por su apoderado permanente, comisiones de registro y corporativas e impuestos asociados a la constitución y las operaciones de la Filial.

Existe una intención firme de cerrar la Filial y no hay intención de que India Equity Portfolio vuelva a utilizar la Filial con el fin de invertir en la India. Actualmente, no se ha confirmado ninguna fecha de cierre. No se espera que dicho cierre provoque ninguna interrupción significativa de las actividades operativas de Goldman Sachs India Equity Portfolio.

# 2 Políticas y objetivos de inversión

Los principales objetivos de inversión de las Carteras se detallan en el Folleto y en los Suplementos pertinentes del mismo.

Nombre del Fondo	Nombre de la estrategia
Asia Equity Portfolio	•
All China Equity Portfolio	Carteras de renta variable global y regional
	Carteras de renta variable global y regional
Emerging Markets Equity ESG Portfolio	Carteras de renta variable global y regional
Emerging Markets Equity Portfolio	Carteras de renta variable global y regional
Global Environmental Impact Equity Portfolio	Carteras de renta variable global y regional
Global Equity Income Portfolio	Carteras de renta variable global y regional
Global Equity Partners ESG Portfolio	Carteras de renta variable global y regional
Global Equity Partners Portfolio	Carteras de renta variable global y regional
Global Future Health Care Equity Portfolio	Carteras de renta variable global y regional
Global Future Technology Leaders Equity Portfolio	Carteras de renta variable global y regional
Global Millennials Equity Portfolio	Carteras de renta variable global y regional
India Equity Portfolio	Carteras de renta variable global y regional
Japan Equity Partners Portfolio	Carteras de renta variable global y regional
Japan Equity Portfolio	Carteras de renta variable global y regional
US Equity Portfolio	Carteras de renta variable global y regional
US Focused Growth Equity Portfolio	Carteras de renta variable global y regional
US Small Cap Equity Portfolio	Carteras de renta variable global y regional
US Technology Opportunities Equity Portfolio	Carteras de renta variable global y regional
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	Carteras de renta variable por sectores
Global Infrastructure Equity Portfolio	Carteras de renta variable por sectores
Global Real Estate Equity Portfolio	Carteras de renta variable por sectores
North America Energy & Energy Infrastructure Equity Portfolio	Carteras de renta variable por sectores
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	Carteras de renta variable global y regional Core®
Europe CORE® Equity Portfolio	Global And Regional Core® Equity Portfolios
Eurozone CORE® Equity Portfolio	Carteras de renta variable global y regional Core®
Global CORE® Equity Portfolio	Global And Regional Core® Equity Portfolios
Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	Global And Regional Core® Equity Portfolios
US CORE® Equity Portfolio	Global And Regional Core® Equity Portfolios
US Small Cap CORE® Equity Portfolio	Global And Regional Core® Equity Portfolios
Asia High Yield Bond Portfolio	Carteras de renta fija
Emerging Markets Corporate Bond Portfolio	Carteras de renta fija
Emerging Markets Debt Blend Portfolio	Carteras de renta fija
Emerging Markets Debt Local Portfolio	Carteras de renta fija
Emerging Markets Debt Portfolio	Carteras de renta fija
ESG-Enhanced Emerging Markets Short Duration Bond Portfolio	Carteras de renta fija
ESG-Enhanced Euro Short Duration Bond Plus Portfolio	Carteras de renta fija
ESG-Enhanced Europe High Yield Bond Portfolio	0 1 1 1 1
I ESG-Ennanced Gional Income Bond Portfolio	Carteras de renta fija
ESG-Enhanced Global Income Bond Portfolio	Carteras de renta fija
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio	Carteras de renta fija Carteras de renta fija
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio Global Credit Portfolio (Hedged)	Carteras de renta fija Carteras de renta fija Carteras de renta fija
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio Global Credit Portfolio (Hedged) Global Fixed Income Portfolio	Carteras de renta fija Carteras de renta fija Carteras de renta fija Carteras de renta fija
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio Global Credit Portfolio (Hedged) Global Fixed Income Portfolio Global Fixed Income Portfolio (Hedged)	Carteras de renta fija
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio Global Credit Portfolio (Hedged) Global Fixed Income Portfolio Global Fixed Income Portfolio (Hedged) Global High Yield Portfolio	Carteras de renta fija
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio Global Credit Portfolio (Hedged) Global Fixed Income Portfolio Global Fixed Income Portfolio (Hedged) Global High Yield Portfolio Global Sovereign Bond Portfolio	Carteras de renta fija
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio Global Credit Portfolio (Hedged) Global Fixed Income Portfolio Global Fixed Income Portfolio (Hedged) Global High Yield Portfolio Global Sovereign Bond Portfolio Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio	Carteras de renta fija
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio Global Credit Portfolio (Hedged) Global Fixed Income Portfolio Global Fixed Income Portfolio (Hedged) Global Fixed Income Portfolio (Hedged) Global High Yield Portfolio Global Sovereign Bond Portfolio Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio US Dollar Short Duration Bond Portfolio	Carteras de renta fija
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio Global Credit Portfolio (Hedged) Global Fixed Income Portfolio Global Fixed Income Portfolio (Hedged) Global Fixed Income Portfolio (Hedged) Global High Yield Portfolio Global Sovereign Bond Portfolio Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio US Dollar Short Duration Bond Portfolio US Fixed Income Portfolio	Carteras de renta fija
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio Global Credit Portfolio (Hedged) Global Fixed Income Portfolio Global Fixed Income Portfolio (Hedged) Global Fixed Income Portfolio (Hedged) Global High Yield Portfolio Global Sovereign Bond Portfolio Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio US Dollar Short Duration Bond Portfolio	Carteras de renta fija
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio Global Credit Portfolio (Hedged) Global Fixed Income Portfolio Global Fixed Income Portfolio (Hedged) Global Fixed Income Portfolio (Hedged) Global High Yield Portfolio Global Sovereign Bond Portfolio Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio US Dollar Short Duration Bond Portfolio US Fixed Income Portfolio	Carteras de renta fija
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio Global Credit Portfolio (Hedged) Global Fixed Income Portfolio Global Fixed Income Portfolio (Hedged) Global High Yield Portfolio Global Sovereign Bond Portfolio Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio US Dollar Short Duration Bond Portfolio US Fixed Income Portfolio US Mortgage Backed Securities Portfolio	Carteras de renta fija

## 2 Políticas y objetivos de inversión (continuación)

Nombre del Fondo	Nombre de la estrategia
Global Multi-Asset Growth Portfolio	Carteras flexibles
Global Multi-Asset Income Portfolio	Carteras flexibles
US Real Estate Balanced Portfolio	Carteras flexibles
Emerging Markets Total Return Bond Portfolio	Carteras especializadas
Global Absolute Return Portfolio	Carteras especializadas
Global Dynamic Bond Portfolio	Carteras especializadas
Global Dynamic Bond Plus Portfolio	Carteras especializadas
Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)	Carteras especializadas
Global Strategic Macro Bond Portfolio	Carteras especializadas
Strategic Absolute Return Bond II Portfolio	Carteras especializadas
Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio	Global Manager Strategies Portfolios
Global Corporate Portfolio (Hedged)	Carteras selectas
Absolute Return Tracker Portfolio	Carteras alternativas
Alternative Trend Portfolio	Carteras alternativas

#### 3 Principales políticas contables

## (a) Criterio de elaboración de estados financieros

Los estados financieros de cada Cartera individual se presentan en su respectiva moneda de referencia, mientras que el Total combinado de todas ellas se presenta en dólares estadounidenses. El Consejo de Administración considera que las monedas de referencia de las Carteras son las que mejor representan los efectos económicos de las transacciones, los eventos y las condiciones subyacentes de las Carteras.

Los estados financieros han sido elaborados de conformidad con los requisitos legales y normativos de Luxemburgo relativos a los fondos de inversión. Los estados financieros se han elaborado con arreglo al criterio de empresa en funcionamiento (excepto en el caso de las carteras respecto de las cuales el Consejo de Administración ha decidido liquidar o cesar las operaciones) ya que los Consejeros consideran que el Fondo puede continuar operativa en el futuro inmediato.

La elaboración de los estados financieros exige al Consejo de Administración establecer estimaciones e hipótesis que pueden afectar a las cantidades declaradas en dichos estados, así como en las notas adjuntas. Consulte el Balance de situación y la Nota 4 en los que el Consejo de Administración se vio obligado a establecer ciertas estimaciones e hipótesis para determinar el valor. Por tanto, los importes reales pueden presentar variaciones respecto a dichas estimaciones.

## (b) Operaciones de inversión, ingresos generados por la inversión y gastos de explotación

Las operaciones de inversión se registran atendiendo a su fecha valor más un día contable. Las plusvalías y minusvalías materializadas se basan en el Método del coste medio ponderado. Los ingresos y gastos por dividendos se registran en la fecha "exdividendo", y los ingresos y gastos por intereses se devengan durante la vigencia de la inversión. Entre los ingresos por intereses se incluyen la acumulación de descuentos de mercado, descuentos iniciales de emisiones y la amortización de primas contabilizadas como ingresos durante la vigencia del instrumento subyacente. Los ingresos por intereses y por dividendos se contabilizan por sus importes brutos antes de la retención fiscal en origen, en su caso.

Los gastos de explotación se reflejan atendiendo al principio de devengo.

# (c) Costes de transacción

Los costes de transacción se contabilizan en la Cuenta de pérdidas y ganancias como Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente sobre valores de inversión y Plusvalía/(minusvalía) materializada neta sobre valores de inversión. Los costes de transacciones basadas en el Depositario están incluidos en los "Gastos de custodia", tal y como se indica en la Cuenta de pérdidas y ganancias.

Consulte la Nota 14 para obtener más información sobre las Carteras que han incurrido en costes de transacción identificables de manera separada.

## 3 Principales políticas contables (continuación)

#### (c) Costes de transacción (continuación)

Los costes de transacción para inversiones de renta fija, los contratos de divisas a plazo y otros contratos derivados no están identificados de manera separada. Para estas inversiones, los costes de transacción están incluidos en el precio de compra y venta, y son parte de la rentabilidad bruta de inversión de cada Cartera.

# (d) Inversiones financieras en títulos y valoración

#### i. Contabilización y baja contable

Las Carteras contabilizan los activos y pasivos financieros en la fecha en que suscriben las disposiciones contractuales de la inversión. Las compras y ventas de activos y pasivos financieros se contabilizan utilizando la contabilidad por fecha de operación más un día. A partir de esa fecha más un día, las plusvalías y minusvalías derivadas de cambios en el valor de los activos o pasivos financieros se registran en la Cuenta de pérdidas y ganancias.

Los activos financieros se dan de baja contable cuando se extingue el derecho a percibir flujos monetarios de las inversiones o cuando la Cartera ha transferido prácticamente todos los riesgos y compensaciones asociados a la titularidad de dichos activos.

## ii. Principios de contabilización por valor razonable

El valor de todos los títulos y derivados se determina con arreglo a las políticas siguientes:

#### (ii.1) Activos y pasivos cotizados en bolsa

El valor de inversiones financieras negociadas en bolsa, incluidos los valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa oficial o negociados en cualquier otro mercado regulado que funcione regularmente, que comprenden acciones ordinarias, bonos, derechos, warrants, fondos de inversión, acciones preferentes, opciones y contratos de futuros, se basa en los precios cotizados de mercado vigentes en la fecha de cierre del periodo, sin aplicar deducción alguna sobre futuros costes de transacción estimados.

## (ii.2) Títulos de deuda

Los títulos de deuda, que consisten en bonos, obligaciones con garantía de activos emitidos o garantizados por agencias y obligaciones con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias, se valoran a precio medio o de oferta, según la metodología del fondo, por terceros proveedores de servicios de fijación de precios, sin aplicar deducción alguna sobre futuros costes de transacción estimados.

Dentro de los títulos de deuda se incluyen los compromisos de valores con garantía hipotecaria por confirmar ("TBA"). Estos compromisos reflejan adquisiciones y ventas con fechas futuras de valores con garantía hipotecaria emitidos por agencias ("MBS"). Algunas Carteras utilizan estos compromisos a plazo para gestionar de forma eficiente la exposición a MBS. Además, algunas Carteras podrán celebrar transacciones de refinanciación en dólares estadounidenses, utilizando principalmente TBA, en las que las Carteras se comprometen a vender y a recomprar simultáneamente MBS para su entrega en meses futuros. Las Carteras deben mantener títulos líquidos con un valor que no sea inferior al precio de recompra (incluidos los intereses devengados) para dichos compromisos a plazo. El valor de mercado de los títulos que las Carteras se comprometen a comprar puede caer por debajo del precio de compra acordado de dichos títulos.

Cuando se determine que un título de deuda se encuentra en situación de impago, podrá suspenderse el devengo de intereses sobre dicho título y, previa confirmación de las partes interesadas, podrá cancelarse el importe adeudado.

# (ii.3) Certificados de depósito e Inversiones en el mercado monetario

Los certificados de depósito, que incluyen los depósitos a plazo y los efectos comerciales, así como las inversiones en el mercado monetario, se valoran al precio medio (o de oferta para los valores de renta fija en Global Corporate Portfolio (Hedged)) proporcionado por terceros proveedores de servicios o, en caso de que no se disponga de dicho servicio de fijación de precios, a un coste que se aproxime al valor de mercado.

## 3 Principales políticas contables (continuación)

### (d) Inversiones financieras en títulos y valoración (continuación)

ii. Principios de contabilización por valor razonable (continuación)

(ii.4) Acciones en organismos de inversión colectiva

El valor de las inversiones mantenidas en fondos de inversión de capital variable, incluidos los Fondos de inversión, se basa en los valores liquidativos por acción oficiales, según la última fecha disponible, suministrados por los fondos, de acuerdo con la política de valoración del fondo aplicable descrita en su folleto.

#### (ii.5) Derivados

Un derivado es un instrumento financiero cuyo valor se deriva de un instrumento subyacente, un índice de referencia o una combinación de ambos. Los instrumentos derivados pueden constituirse mediante contratos negociados de forma privada, en cuyo caso suelen denominarse derivados extrabursátiles ("OTC"), o bien pueden cotizar o negociarse en una bolsa. Los contratos de derivados pueden conllevar el compromiso futuro de comprar o vender instrumentos financieros o materias primas bajo condiciones específicas, en una fecha determinada, o bien el intercambio de pagos de intereses periódicos o divisas basado en un importe teórico o contractual.

Los contratos de derivados se expresan al valor de mercado y se registran como activos o pasivos en el Balance de situación. Las plusvalías o minusvalías que se deriven de un cambio en el valor de mercado se reflejan en la Cuenta de pérdidas y ganancias como componente de la variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente. Las plusvalías o minusvalías materializadas se registran al vencimiento del contrato o cuando se extinguen los pagos de flujos monetarios periódicos.

#### (ii.5) (a) Contratos de opciones

Las Carteras podrán formalizar contratos de opciones extrabursátiles (OTC) y cotizados en bolsa con diversas contrapartes. Cuando la Cartera adquiere una opción, se registra como activo un importe equivalente al valor de mercado basado en la prima pagada, cuyo valor se ajusta al precio de mercado diariamente. Cuando la Cartera suscribe una opción, se registra como pasivo un importe equivalente al valor de mercado basado en la prima recibida por la Cartera, ajustándose este al valor de mercado de la opción suscrita en cada fecha de valoración.

Cuando se cierran opciones, la diferencia entre la prima y el importe pagado o recibido, una vez deducidas las comisiones de intermediación, o el importe íntegro de la prima si el valor de la opción es nulo tras su vencimiento, se trata como una plusvalía o minusvalía materializada. El ejercicio de una opción suscrita por parte de la Cartera podría implicar que esta comprase o vendiese un instrumento financiero a un precio distinto al valor de mercado asignado en ese momento.

Se determina el valor razonable de un contrato de opciones extrabursátiles mediante el empleo de valoraciones proporcionadas por contrapartes, un servicio de determinación de precios independiente o modelos de valoración que utilizan datos de mercado proporcionados por un servicio externo de determinación de precios, y normalmente se valora a precio medio. El valor de una opción cotizada en bolsa se basa en los precios de liquidación, los últimos precios de compra o venta en bolsa o, si el último precio de liquidación no está disponible por cualquier motivo, en el punto medio entre los precios de oferta y demanda (o, en ausencia de operaciones de compra y venta, en el último precio de oferta para las posiciones largas y el último precio de demanda para las posiciones cortas), así como también en cotizaciones independientes proporcionadas por un servicio de determinación de precios o una contraparte.

# (ii.5) (b) Contratos de futuros

Los contratos de futuros son acuerdos que se celebran para comprar o vender una cantidad estandarizada de una materia prima, valor o índice específicos, y se valoran en función de los precios de liquidación, los últimos precios de compra o venta en bolsa, o cotizaciones de mercado independientes. Para negociar en el mercado de futuros se exige la entrega de un depósito de garantía inicial, en efectivo o en valores. Las plusvalías o minusvalías latentes generadas de contratos de futuros se contabilizan para reflejar el valor de mercado de los contratos y se incluyen en la Cuenta de pérdidas y ganancias de la Cartera como componente de dichas plusvalías o minusvalías. El margen de variación se percibe o se paga, en función de si se han producido plusvalías o minusvalías latentes. Cuando se extingue el contrato, la Cartera contabilizará una plusvalía o minusvalía materializada, que será igual a la diferencia entre el valor del contrato en la fecha de su firma y el momento en que quedó resuelto.

## 3 Principales políticas contables (continuación)

## (d) Inversiones financieras en títulos y valoración (continuación)

ii. Principios de contabilización por valor razonable (continuación)

(ii.5) Derivados (continuación)

(ii.5) (c) Contratos de permutas financieras

Los contratos de permutas financieras, incluidas las permutas de tipos de interés, de riesgo crediticio y de rendimiento total, pueden estar vinculados a una serie de inversiones e índices subyacentes, y sus condiciones pueden ser muy distintas entre uno y otro. Los flujos monetarios que generan se intercambian en función del subyacente. Los pagos por adelantado, que representan una prima de riesgo, se amortizan o devengan durante la vigencia del contrato. Los contratos de permutas financieras se contabilizan al valor de mercado, normalmente valorados a precio medio, el cual se establece por un precio facilitado por la contraparte, un servicio externo de determinación de precios o según un modelo de valoración. El modelo examina diversos factores, entre ellos el valor de mercado del subyacente, los riesgos asociados al mismo y las condiciones específicas del contrato. Con respecto a estos acuerdos, los títulos o el efectivo pueden ser identificados como garantías o márgenes de acuerdo con los términos de los respectivos contratos de permutas financieras para proporcionar activos de valor y recursos en caso de incumplimiento, quiebra o insolvencia. Esta garantía o margen está denominada principalmente en la divisa de referencia y se paga a través de la cuenta de depósito al intermediario financiero.

Durante el ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021, todas las garantías relacionadas con las permutas financieras de rendimiento total fueron pignoradas en forma de efectivo. Consulte la Nota 13 para obtener información sobre las garantías en efectivo y el Anexo VII (sin auditar) más información en general.

La Cartera formaliza contratos de permutas de rendimiento total y, en particular, las transacciones de derivados extrabursátiles mediante un contrato maestro de International Swaps and Derivatives Associations, Inc. ("Contrato maestro ISDA") u otro contrato similar. Un Contrato maestro ISDA es un acuerdo bilateral entre la Cartera y una contraparte que rige las transacciones de derivados extrabursátiles (incluidos contratos de permutas de rendimiento total) efectuadas por las partes.

Todas las rentabilidades de transacciones de derivados extrabursátiles se devengarán en la Cartera y no están sujetas a contratos de distribución de rentabilidades con el gestor de la Cartera u otros terceros.

# (ii.5) (d) Contratos de divisas a plazo

En un contrato de divisas a plazo, la Cartera acepta recibir o entregar una cantidad fija de una divisa a cambio de otra y a un precio predeterminado en una fecha futura. Las compras y ventas derivadas de contratos de divisas a plazo que tienen el mismo valor teórico, fecha de liquidación, contraparte y derecho de liquidación en importes netos generalmente se compensan (lo que produce una posición neta de divisas con la contraparte igual a cero), contabilizándose en la fecha valor más un día las plusvalías o minusvalías materializadas.

Los contratos de divisas a plazo son valorados según los precios medios de servicios externos de determinación de precios.

# (ii.5) (e) Contratos de bonos a plazo no entregables

Los contratos a plazo de bonos no entregables son instrumentos financieros derivados que se diferencian de los contratos de bonos a plazos normales en que no se realiza una liquidación física del título de referencia al vencimiento. En su lugar, se llevará a cabo una liquidación neta en efectivo (normalmente en dólares estadounidenses) de una parte a la otra en función del movimiento del título de referencia. Cualquier plusvalía y minusvalía materializada se reconoce a su fecha valor más un día. Los contratos de bonos a plazo no entregables son valorados según los precios medios por servicios externos de determinación de precios.

# (ii.5) (f) Valores hipotecarios a plazo cubiertos

Los valores con garantía hipotecaria a plazo cubiertos representan ventas por confirmar (TBA) cubiertas con posiciones largas de la Federal National Mortgage Association, y normalmente se valoran a precio medio.

## (ii.6) Todos los títulos y derivados

Si no puede obtenerse un precio de mercado cotizado por parte de un servicio externo de determinación de precios o de un agente de bolsa, o se considera que una cotización es sustancialmente errónea, el valor de mercado de

## 3 Principales políticas contables (continuación)

## (d) Inversiones financieras en títulos y valoración (continuación)

ii. Principios de contabilización por valor razonable (continuación)

(ii.6) Todos los títulos y derivados (continuación)

la inversión se determina usando diversas técnicas de valoración. Entre las técnicas utilizadas al efecto cabe destacar el uso de transacciones recientes de mercado, la referencia al valor de mercado vigente de otra inversión prácticamente igual, el análisis de los flujos de caja descontados o cualquier otra técnica que proporcione una estimación fiable de precios obtenidos en transacciones de mercado reales. Tales títulos y derivados se valoran según su valor de materialización probable determinado por un Tasador. Para más detalles, consulte la nota 4.

Las inversiones se han valorado atendiendo a los principios de contabilidad generalmente aceptados de Luxemburgo, que pueden requerir el uso de ciertas estimaciones e hipótesis para determinar el valor. Aunque estas estimaciones e hipótesis se basan en la mejor información disponible, los resultados reales podrían ser muy distintos a ellas.

Consulte la Nota 4 para saber en qué valores se recurrió al Tasador para determinar su valor probable de materialización.

#### (e) Tesorería

La tesorería se valora al coste, que se aproxima al valor de mercado.

## (f) Saldos a pagar por/a intermediarios financieros

La partida "Saldos a pagar por intermediarios" consiste principalmente en garantías de efectivo por cobrar de intermediarios de compensación de la Cartera y diversas contrapartes. La partida "Saldos a pagar a intermediarios" consiste principalmente en garantías de efectivo a pagar a intermediarios de compensación de la Cartera y diversas contrapartes.

Los saldos a pagar por/a intermediarios financieros se valoran al precio de coste, que se aproxima al valor de mercado. Para más información, consulte la Nota 13.

# (g) Conversión de divisas

Los libros y registros de todas las Carteras se llevan en sus respectivas monedas de referencia. Consulte el Anexo II (sin auditar) para obtener información sobre la moneda de referencia de cada Cartera. Las transacciones realizadas en divisas extranjeras se convierten al correspondiente tipo de cambio en vigor en la fecha de la transacción. Los activos y pasivos denominados en divisas extranjeras se convierten en la moneda de referencia al tipo de cambio de esa divisa vigente en la fecha de cierre del ejercicio. Las diferencias de cambio de divisas derivadas de la conversión y las plusvalías y minusvalías materializadas en enajenaciones o liquidaciones de activos y pasivos se contabilizan en la Cuenta de pérdidas y ganancias. Las plusvalías o minusvalías obtenidas por cambio de divisas relativas a inversiones, instrumentos financieros derivados y todas las demás plusvalías o minusvalías por cambio de divisas relativas a partidas monetarias, incluyendo el efectivo y los activos líquidos equivalentes, se reflejan como plusvalía/(minusvalía) neta materializada o como variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente en la Cuenta de pérdidas y ganancias.

# (h) Gastos

Los gastos incurridos por el Fondo que no estén específicamente relacionados con una determinada Cartera o Clase de acciones del Fondo se asignarán a las Carteras conforme al criterio de asignación en función de la naturaleza de dichos gastos. Los gastos que sean directamente atribuibles a una Cartera o Clase de acciones se imputan generalmente a esa Cartera o Clase de acciones.

## (i) Valoración "puntual" y "al cierre"

En el caso de determinadas Carteras, el Fondo podrá optar por emitir Clases de acciones que tengan diferentes Momentos de valoración, denominados "puntual" y "al cierre", donde el "puntual" adopta un valor distinto al fijado en el momento del cierre del mercado, y el denominado "al cierre" adopta el valor basado en los precios al cierre. En consecuencia, se prevé que los valores liquidativos y la rentabilidad por Acción de dichas Clases de acciones difieran entre sí como resultado de la aplicación de Momentos de valoración diferentes.

## 3 Principales políticas contables (continuación)

## (i) Valoración "puntual" y "al cierre" (continuación)

Durante el ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021, estas Clases de acciones "puntuales" y "al cierre" descritas anteriormente serán de aplicación a las carteras:

- · Japan Equity Partners Portfolio
- Japan Equity Portfolio
- · Emerging Markets CORE® Equity Portfolio
- Global CORE® Equity Portfolio
- Global Small Cap CORE® Equity Portfolio
- · US CORE® Equity Portfolio
- US Small Cap CORE® Equity Portfolio

El Balance de situación, la Cuenta de pérdidas y ganancias, el Estado de variaciones patrimoniales y los Estados de inversión se han presentado utilizando los precios "puntual" de todos los mercados a 30 de noviembre de 2021. Si los Estados de inversión, los Balances de situación, las Cuentas de pérdidas y ganancias y los Estados de variaciones patrimoniales se elaboraran utilizando los precios "al cierre", el valor total de mercado y el patrimonio neto variarían de la siguiente manera:

		Valor de mercado de las inversiones y divisas incluyendo plusvalías/minusvalías latentes sobre futuros		Patrimonio				
Carteras	Divisa	Puntual	AI cierre	Variación	Puntual	Al cierre	Variación	Variación porcentual
Japan Equity Partners Portfolio*	JPY	311.166.659	311.522.962	356.303	315.911.904	316.268.207	356.303	0,11 %
Japan Equity Portfolio*	JPY	185.211.799	185.577.711	365.912	189.227.791	189.593.703	365.912	0,19 %
Emerging Markets CORE <sup>®</sup> Equity Portfolio	USD	2.794.069.697	2.779.598.277	(14.471.420)	2.844.301.922	2.829.830.502	(14.471.420)	(0,51 %)
Global CORE® Equity Portfolio	USD	4.202.835.464	4.129.449.371	(73.386.093)	4.281.495.831	4.208.109.738	(73.386.093)	(1,71 %)
Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	717.090.438	707.093.842	(9.996.596)	714.592.577	704.595.981	(9.996.596)	(1,40 %)
US CORE® Equity Portfolio	USD	1.974.038.534	1.940.368.229	(33.670.305)	1.993.440.626	1.959.770.321	(33.670.305)	(1,69 %)
US Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	187.793.743	185.471.391	(2.322.352)	190.778.079	188.455.727	(2.322.352)	(1,22 %)

<sup>\*</sup> Expresado en miles.

## (j) Pactos de compensación de ingresos

Podrán aplicarse pactos de compensación de ingresos a algunas o todas las Carteras del Fondo. En caso de aplicarse, estos pactos están pensados para garantizar que los ingresos por Acción que se distribuyan o se entiendan distribuidos con respecto a un periodo de distribución no se vean afectados por variaciones en el número de Acciones emitidas durante ese periodo, y que la cuantía a la que asciende la primera distribución percibida por los Accionistas de una Cartera afectada después de la compra de Acciones de la misma represente, de un lado, una participación en los ingresos percibidos por la Cartera y, de otro, el rendimiento del capital (la "cuantía de compensación"). Las cuantías de compensación se incluyen en el epígrafe "producto derivado de las acciones emitidas" y el pago por las acciones reembolsadas en los Estados de variaciones patrimoniales.

## (k) Ajuste por dilución

En cualquier Día hábil, la Sociedad Gestora, previa consulta con su delegado designado, Goldman Sachs Asset Management International ("GSAMI"), en calidad de Asesor de inversiones, de conformidad con las directrices establecidas por el Consejo de Administración, podrá decidir aplicar el ajuste por dilución (que incluya cuantos factores razonables pueda estimar oportunos) para calcular el valor liquidativo por acción. Con este método de valoración del valor liquidativo se pretende trasladar a los Accionistas activos los costes estimados de la actividad de inversión subyacente de la Cartera mediante un ajuste del valor liquidativo de la correspondiente Acción; de este modo, se protege a los Accionistas a largo plazo de la Cartera frente a los costes asociados a órdenes continuas de suscripción y reembolso. Este proceso se realiza como un ajuste de capital.

El ajuste por dilución podrá tener en cuenta los diferenciales de negociación de las inversiones de la Cartera, el valor de los derechos y cargos incurridos como resultado de la negociación y podrá incluir una estimación

## 3 Principales políticas contables (continuación)

# (k) Ajuste por dilución (continuación)

del impacto en el mercado. Cuando GSAMI, vistas las condiciones de mercado predominantes y el volumen de suscripciones o reembolsos solicitado por los Accionistas actuales o potenciales con respecto al tamaño de la Cartera en cuestión, haya decidido aplicar, para una determinada Cartera, el ajuste por dilución, el valor liquidativo de la Cartera podrá valorarse según el precio demandado o el precio ofertado.

Como la elección de uno u otro precio para calcular el valor liquidativo de la Cartera se basa en la actividad negociadora neta que se registre en el día pertinente del cálculo, los Accionistas que realicen operaciones en sentido opuesto a la actividad negociadora neta de la Cartera podrían verse beneficiados a costa de los demás Accionistas de la misma. Por otro lado, el valor liquidativo de la Cartera y el rendimiento a corto plazo pueden experimentar una mayor volatilidad como consecuencia del ajuste por dilución.

Los inversores deberán ser conscientes de que el factor utilizado para aplicar el ajuste por dilución ("factor de dilución") no superará, en condiciones normales, el 2 % del valor liquidativo por acción de la Clase de acciones pertinente de la Cartera, a menos que se indique lo contrario en el Suplemento correspondiente. No obstante lo anterior, en caso de que se produzcan circunstancias excepcionales (incluida, entre otras, la ampliación de los diferenciales de la oferta y la demanda como resultado, por lo general, de una elevada volatilidad del mercado y/o falta de liquidez, condiciones excepcionales del mercado y perturbaciones del mercado), la Sociedad Gestora, previa consulta con el Consejo de Administración, podrá decidir, en el mejor interés de los Accionistas y de cualquier Cartera en particular y en cualquier Día Hábil, aplicar un factor de dilución superior al 2 %. Se informará a los Accionistas de dicha decisión a través de un aviso y/o una publicación que se divulgará en www.gsam.com. El factor de dilución aplicado a las Carteras individuales será revisado por el Asesor de inversiones de forma periódica con el fin de verificar su adecuación en función de las condiciones de mercado imperantes.

Las siguientes Carteras pueden aplicar un ajuste por dilución:

Asia Equity Portfolio	Emerging Markets Debt Blend Portfolio
All China Equity Portfolio	Emerging Markets Debt Local Portfolio
Emerging Markets Equity ESG Portfolio	Emerging Markets Debt Portfolio
Emerging Markets Equity Portfolio	ESG-Enhanced Emerging Markets Short Duration Bond Portfolio
Global Environmental Impact Equity Portfolio	ESG-Enhanced Euro Short Duration Bond Plus Portfolio
Global Equity Income Portfolio	ESG-Enhanced Europe High Yield Bond Portfolio
Global Equity Partners ESG Portfolio	ESG-Enhanced Global Income Bond Portfolio
Global Equity Partners Portfolio	ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio
Global Future Health Care Equity Portfolio	Global Credit Portfolio (Hedged)
Global Future Technology Leaders Equity Portfolio	Global Fixed Income Portfolio
Global Millennials Equity Portfolio	Global Fixed Income Portfolio (Hedged)
India Equity Portfolio	Global High Yield Portfolio
Japan Equity Partners Portfolio	Global Sovereign Bond Portfolio
Japan Equity Portfolio	Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio
US Equity Portfolio	US Dollar Short Duration Bond Portfolio
US Focused Growth Equity Portfolio	US Fixed Income Portfolio
US Small Cap Equity Portfolio	US Mortgage Backed Securities Portfolio
US Technology Opportunities Equity Portfolio	Emerging Markets Multi-Asset Portfolio
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	ESG-Enhanced Global Multi-Asset Balanced Portfolio
Global Infrastructure Equity Portfolio	Global Multi-Asset Income Portfolio
Global Real Estate Equity Portfolio	US Real Estate Balanced Portfolio
North America Energy & Energy Infrastructure Equity Portfolio	Emerging Markets Total Return Bond Portfolio
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	Global Absolute Return Portfolio
Europe CORE® Equity Portfolio	Global Dynamic Bond Portfolio
Eurozone CORE® Equity Portfolio	Global Dynamic Bond Plus Portfolio

## 3 Principales políticas contables (continuación)

## (k) Ajuste por dilución (continuación)

Global CORE® Equity Portfolio	Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)
Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	Global Strategic Macro Bond Portfolio
US CORE® Equity Portfolio	Strategic Absolute Return Bond II Portfolio
US Small Cap CORE® Equity Portfolio	Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio
Asia High Yield Bond Portfolio	Absolute Return Tracker Portfolio
Emerging Markets Corporate Bond Portfolio	Alternative Trend Portfolio

La anulación del método de cálculo de las variaciones del patrimonio neto que se presenta en el Estado de variaciones patrimoniales representa la anulación del importe aplicado a 30 de noviembre de 2020.

Consulte el Balance de situación y el Estado de variaciones patrimoniales para saber qué Carteras aplicaron el ajuste por dilución a 30 de noviembre de 2021.

# 4 Valoración determinada por el Tasador

El Tasador es nombrado por la Sociedad Gestora. El Tasador también es responsable directo de determinadas funciones de valoración ante el Consejo de Administración, que se recogen finalmente en los Estados financieros. Durante el ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021, el Tasador fue Goldman Sachs & Co. LLC y la función de valoración fue desempeñada por la División de Controladores de Goldman Sachs ("Controladores").

La siguiente tabla presenta los activos en los cuales se recurrió al Tasador para determinar el valor de materialización probable a 30 de noviembre de 2021.

A 30 de noviembre de 2021					
Carteras	Divisa	Número de activos valorados	Valor	% del patrimonio	
All China Equity Portfolio	USD	3	1.432.535	2,32 %	
Emerging Markets Equity ESG Portfolio	USD	1	2.449.459	0,32 %	
Emerging Markets Equity Portfolio	USD	1	6.207.863	0,12 %	
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	USD	1	11.428.151	0,40 %	
Global High Yield Portfolio	USD	2	933.378	0,03 %	
Global Absolute Return Portfolio	USD	1	193	0,00 %	

Los valores negociados en determinadas bolsas de Asia-Pacífico y Oriente Próximo pueden utilizar precios ajustados de renta variable internacional proporcionados por un servicio independiente de fijación de precios de terceros para reflejar con mayor precisión el valor de los valores negociados en los mercados que están cerrados en el momento de la valoración.

El servicio independiente de valoración tiene en cuenta diversos factores incluyendo, entre otros, movimientos en los mercados de valores, recibos de depósitos, contratos de futuros y tipos de cambio de moneda extranjera que hayan sucedido posteriormente al cierre de las bolsas de valores extranjeras. Estas inversiones no se incluyen en la tabla anterior.

# 5 Tributación

# Tributación — Luxemburgo

El Fondo no está obligado a declarar los beneficios o ingresos generados en ningún impuesto luxemburgués. Sin embargo, el Fondo está obligado a declarar en Luxemburgo un impuesto de suscripción anual (taxe d'abonnement) al tipo del 0,05 % anual, cuya base imponible es el patrimonio neto total del Fondo valorado en el último día de cada trimestre. No obstante, este tipo se reduce al 0,01 % anual en el caso de:

- organismos que tengan como único objeto la inversión colectiva en instrumentos del mercado monetario y la colocación de depósitos en entidades de crédito;
- organismos que tengan como único objeto la inversión colectiva en depósitos colocados en entidades de crédito; y
- determinados compartimentos de organismos de inversión colectiva ("OIC") con múltiples compartimentos a los que se refiere la ley de 17 de diciembre de 2010, en su versión modificada, así como determinadas clases de valores emitidas dentro de un OIC o de un compartimento de un OIC con múltiples compartimentos, siempre y cuando los valores integrados en esos compartimentos o clases estén reservados a uno o más inversores institucionales.

#### 5 Tributación (continuación)

#### Tributación — Bélgica

El Fondo puede estar sujeto a un impuesto de suscripción a un tipo del 0,0925 % con respecto a suscripciones realizadas a través de intermediarios ubicados en Bélgica en la medida en que haya acciones netas en circulación a 31 de diciembre del año anterior.

#### Tributación — Filial

Los Gobiernos de India y Mauricio firmaron un protocolo el 10 de mayo de 2016 por el cual las plusvalías de todas las inversiones indias hasta el 31 de marzo de 2017 seguirían estando exentas de tributar en India en virtud del Tratado India-Mauricio, independientemente de cuándo se vendan. A las plusvalías a corto plazo resultantes de la venta de acciones vendidas a partir del 1 de abril de 2019 inclusive se les aplicará el tipo completo del impuesto sobre las plusvalías de acuerdo con la legislación tributaria india. Las plusvalías a largo plazo estaban exentas hasta marzo de 2018, siempre que se negocien en el mercado de valores reconocido en India y estén sujetas al impuesto a las transacciones de valores. Con efecto a partir de abril de 2018, dichas plusvalías han sido gravadas a los tipos impositivos aplicables previstos en las leyes fiscales de la India.

Las inversiones que realizó la Filial en nombre de India Equity Portfolio se transfirieron desde la Filial para que India Equity Portfolio las mantuviera directamente. La transferencia se completó el 7 de octubre de 2021 y, a partir del 30 de noviembre de 2021, no se mantiene ninguna inversión de India Equity Portfolio a través de la Filial. Existe una intención firme de cerrar la Filial y no hay intención de que India Equity Portfolio vuelva a utilizar la Filial con el fin de invertir en la India.

#### Tributación — Aspectos generales

Cada Cartera puede estar sujeta a un impuesto sobre los incrementos patrimoniales, intereses y dividendos en determinadas jurisdicciones en las que invierte. La política de cada Cartera consiste en acumular cualquiera de dichos impuestos sobre los dividendos e intereses cuando se declaran dividendos, se devengan intereses o se materializan plusvalías. En cada fecha de valoración, los impuestos sobre la revalorización latente y materializada de los valores podrán acumularse a los tipos establecidos.

Los futuros inversores deberán consultar a sus propios asesores las consecuencias fiscales que podría tener la inversión en el Fondo según sus circunstancias personales, ya que estas pueden diferir de la información general mencionada anteriormente.

# 6 Principales acuerdos y partes vinculadas

## Sociedad Gestora

Tal y como se describe en la Nota 1, el Fondo nombró a GSAMFSL, una filial indirecta propiedad al 100 % de The Goldman Sachs Group, Inc., como su Sociedad Gestora.

Las Carteras pagan a la Sociedad Gestora una comisión anual que se devengará diariamente y generalmente se pagará al término de cada mes.

## Asesor y SubAsesor de inversiones

La Sociedad Gestora ha nombrado a GSAMI (el "Asesor de inversiones"), una parte vinculada al Fondo, como su delegado para prestar servicios de gestión de carteras.

GSAMI ha celebrado contratos de subdelegación con los siguientes Subasesores de inversiones afiliados\*:

- · Goldman Sachs Asset Management, L.P.
- · Goldman Sachs Asset Management (Hong Kong) Ltd.
- Goldman Sachs Asset Management (Singapore) Pte. Ltd.
- · Goldman Sachs Asset Management Co., Ltd.
- · Goldman Sachs Hedge Fund Strategies, LLC
- · Goldman Sachs International
- · GS Investment Strategies, LLC

## 6 Principales acuerdos y partes vinculadas (continuación)

## Asesor y SubAsesor de inversiones (continuación)

GSAMI ha celebrado contratos de subasesoramiento con cada uno de los siguientes Subasesores de inversiones externos (los "Gestores externos"):

Carteras	Gestores externos*
Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio	Artisan Partners UK LLP Bell Investment Advisors Eagle Capital Management LLC Harris Associates LP WCM Investment Management

<sup>\*</sup> Ninguno de estos asesores de inversión son filiales de GSAMI. Como contraprestación a los servicios prestados en virtud del Contrato de asesoramiento de inversiones, GSAMI percibe unos honorarios, pagaderos mensualmente, a una determinada tasa anual. Una parte de los honorarios del Asesor de inversiones se puede remitir al Subasesor.

#### Límite de gastos

GSAMI ha acordado voluntariamente limitar los gastos totales con respecto a ciertas Carteras y Clases de acciones. Por lo tanto, en la medida en que el total de gastos ordinarios exceda el límite de gastos, GSAMI ha acordado voluntariamente sufragar cualquier gasto operativo real que exceda cualquier límite de gastos, ya sea directamente mediante la renuncia a una parte de sus honorarios o mediante el reembolso a la cuenta de la Clase de acciones correspondiente. El Asesor de inversiones, si lo estima oportuno, podrá designar qué gastos del Fondo estarán sujetos al límite que imponga el Asesor de inversiones. El Límite de gastos no incluye el porcentaje de comisión de GSAMI pagado a Subasesores de inversión externos. No existe ninguna garantía de que la existencia o el nivel de estos límites de gastos vayan a mantenerse en el futuro, por lo que GSAMI no estará obligada a aplicar dicha limitación de los gastos totales del modo descrito. Asimismo, las Carteras no están obligadas a reembolsar a GSAMI los gastos incurridos en el ejercicio financiero anterior, si los hubiere.

La información sobre los tipos de los honorarios de asesoramiento y los límites de gastos a 30 de noviembre de 2021 se detalla en el Anexo II (sin auditar).

## Remuneración de los Consejeros

Doña Grainne Alexander y don Frank Ennis son Consejeros independientes y no desempeñan funciones directivas en el Asesor de inversiones o en sus entidades afiliadas. El Fondo paga a cada Consejero independiente una comisión anual por los servicios que presta al Fondo.

Don Jonathan Beinner, don Glenn Thorpe y doña Katherine Uniacke están afiliados al Asesor de inversiones y no perciben retribución alguna por parte del Fondo.

## Comisiones de rentabilidad

GSAMI tiene derecho a percibir una comisión de rentabilidad aplicable a determinadas Carteras. Para las Carteras Global Dynamic Bond Portfolio y Strategic Absolute Return Bond II Portfolio, la comisión de rentabilidad se devenga diariamente y se deduce anualmente del patrimonio atribuible a cada Clase de acciones de las Carteras. La comisión de rentabilidad asciende al 20 % de la diferencia entre el valor liquidativo por acción de la Clase y el valor por acción registrado por el índice de referencia de esa Clase, según se define en el Folleto.

En el caso de la Cartera Emerging Markets Total Return Bond Portfolio, la comisión de rentabilidad se devenga diariamente y se deduce anualmente del patrimonio atribuible a cada Clase de acciones de las Carteras. Asciende al 15 % de la diferencia entre el valor liquidativo por acción de la Clase y el valor liquidativo por acción registrado por el índice de referencia de esa Clase, según se define en el Folleto.

Para la cartera Global Strategic Macro Bond Portfolio, la comisión de rentabilidad se devenga diariamente y se deduce anualmente del patrimonio atribuible a cada Clase de acciones de las Carteras. La comisión de rentabilidad asciende al 10 % de la diferencia entre el valor liquidativo por acción de la Clase y el valor por acción registrado por el índice de referencia de esa Clase, según se define en el Folleto.

# 6 Principales acuerdos y partes vinculadas (continuación)

#### Comisiones de rentabilidad (continuación)

En el ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021, las comisiones de rentabilidad cobradas por clase de acciones fueron las siguientes:

	Divisa de referencia	Importe en la divisa de referencia	% del patrimonio*
Emerging Markets Total Return Bond Portfolio			
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	541	0,04
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	13	0,12
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	USD	24	0,10
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	USD	24	0,10
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	USD	6	0,03
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	13.701	0,20
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	USD	25	0,19
Clase de acciones "I"	USD	22	0,21
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	USD	45	0,19
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)	USD	146	0,20
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	USD	46	0,19
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	USD	150	0,21
Global Dynamic Bond Portfolio			
Clase de acciones de acumulación "l"	USD	1	0,01
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	USD	174	0,02
Clase de acciones "R"	USD	41	0,06
Global Strategic Macro Bond Portfolio			
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	1.652	0,02
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	USD	1.055	0,01
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK)	USD	47	0,00
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	504	0,01
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF)	USD	1.813	0,71
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	USD	39.758	0,02
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	USD	277	0,18
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	USD	6	0,00
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	449	0,02
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	USD	1.016	0,01
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	USD	16	0,00
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	USD	75	0,00
Clase de acciones de acumulación "RS" (Clase cubierta en CHF)	USD	696	0,02
Clase de acciones de acumulación "RS" (Clase cubierta en EUR)	USD	89	0,01
Strategic Absolute Return Bond II Portfolio			
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	USD	3.209	0,30
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	368	0,42

<sup>\*</sup> Porcentaje del importe en la divisa de referencia / patrimonio en la divisa de referencia de la clase al cerrar el ejercicio.

No se cobraron comisiones de rentabilidad en ninguna otra Clase de Acciones de las Carteras mencionadas en el ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021.

# Comisiones devengadas en otros fondos de Goldman Sachs Funds

En la medida en que lo permitan la legislación vigente y los términos del Folleto, todas las Carteras podrán invertir la totalidad o parte de sus inversiones de activos líquidos a corto plazo en cualquier fondo del mercado monetario u otro fondo de inversión recomendado o gestionado por Goldman Sachs (conjuntamente, "Goldman Sachs Funds"). Sin perjuicio de la legislación vigente y de los términos del Folleto, podrá exigirse al Fondo que asuma la parte proporcional de las comisiones establecidas (incluyendo la comisión de asesoramiento de inversión y de gestión) aplicable a su inversión en dichos fondos.

Para información más detallada sobre la inversiones en otros fondos de Goldman Sachs, consulte los Estados de inversiones.

Todas las Carteras invertidas en Goldman Sachs Funds se invirtieron en las clases de acciones que no devengan comisiones de asesoramiento de inversión. En consecuencia, durante el ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021, no se devengaron comisiones de Asesoramiento de inversión relativas a cada Cartera mantenida en Goldman Sachs Funds.

# Comisiones

En el curso normal de sus operaciones, cada Cartera podrá realizar transacciones con valores o contratos de futuros con Goldman Sachs Funds u otras empresas filiales de la misma (conjuntamente, "Empresas Filiales de Goldman Sachs").

## 6 Principales acuerdos y partes vinculadas (continuación)

### Comisiones (continuación)

Durante el ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021, se realizaron las siguientes transacciones con Empresas Filiales de Goldman Sachs, y las comisiones de intermediación totales pagadas a estas se repartieron entre las comisiones relacionadas con transacciones de valores y los contratos de futuros:

		Transaccione	es de valores	Comisiones de i	ntermediación	
Carteras	Divisa	Valor total*	Porcentaje del total de transacciones de valores	Valor total	Valor total de comisiones de intermediación	Comisiones por futuros**
Asia Equity Portfolio	USD	11.024.441	5,73 %	27.613	8,95 %	5.490
All China Equity Portfolio	USD	332.581	0,20 %	407	0,24 %	3.625
Emerging Markets Equity ESG Portfolio	USD	179.930	0,02 %	180	0,03 %	_
Emerging Markets Equity Portfolio	USD	67.993.961	1,27 %	163.828	3,33 %	_
Global Future Health Care Equity Portfolio	USD	820.755	0,23 %	1.158	1,07 %	_
Global Future Technology Leaders Equity Portfolio	USD	137.784.065	2,52 %	27.328	1,08 %	_
India Equity Portfolio	USD	1.015.147	0,03 %	811	0,05 %	102.117
Japan Equity Partners Portfolio***	JPY	22.455.434	7,07 %	6.606	4,70 %	1.783
Japan Equity Portfolio***	JPY	37.397.135	12,12 %	24.164	12,34 %	1.760
US Equity Portfolio	USD	1.760.952	0,21 %	1.123	0,56 %	_
US Focused Growth Equity Portfolio	USD	186.225	0,77 %	19	0,55 %	_
US Small Cap Equity Portfolio	USD	287.503	0,18 %	70	0,13 %	_
US Technology Opportunities Equity Portfolio	USD	20.492.250	2,89 %	2.894	3,21 %	_
Global Infrastructure Equity Portfolio	USD	718.801	1,19 %	786	3,08 %	_
North America Energy & Energy Infrastructure Equity Portfolio	USD	24.889	0,03 %	12	0,02 %	_
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	USD	286.815	0,00 %	287	0,01 %	10.954
Europe CORE® Equity Portfolio	EUR	_	_	_	_	12.260
Global CORE® Equity Portfolio	USD	_	_	_	_	5.417
US Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	_	_	_	_	737
Emerging Markets Corporate Bond Portfolio	USD	_	_	_	_	206.332
Emerging Markets Debt Local Portfolio	USD	_	_	_	_	59.506
Emerging Markets Debt Portfolio	USD	_	_	_	_	348.277
ESG-Enhanced Euro Short Duration Bond Plus Portfolio	EUR	6.932.234	0,10 %	_	_	31.749
ESG-Enhanced Europe High Yield Bond Portfolio	EUR	2.338.035	0,72 %	_	_	579
ESG-Enhanced Global Income Bond Portfolio	USD	2.092.521	0,58 %	_		_
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio	GBP	823.239	0,08 %	_		1.525
Global Credit Portfolio (Hedged)	USD	20.370.544	0,05 %	_		104.948
Global Fixed Income Portfolio	USD	3.432.643	0,04 %	_		20.237
Global Fixed Income Portfolio (Hedged)	EUR	_	_	_		115.787
Global High Yield Portfolio	USD	3.819.000	0,06 %	_	_	97.077
Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio	USD	_	_	_	_	3.279
US Fixed Income Portfolio	USD	_	_	_		13.243
US Mortgage Backed Securities Portfolio	USD	_	_	_		12.685
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio	USD	4.997	0,02 %	5	0,05 %	_
ESG-Enhanced Global Multi-Asset Balanced Portfolio	USD	1.012.418	0,22 %	_	_	_
US Real Estate Balanced Portfolio	USD	_	_	_	_	12.308
Global Absolute Return Portfolio	USD	75.167	0,00 %	37	0,09 %	_
Global Dynamic Bond Portfolio	USD	_	_	_	_	83.657
Global Dynamic Bond Plus Portfolio	USD	_	_	_	_	293.764

### 6 Principales acuerdos y partes vinculadas (continuación)

#### Comisiones (continuación)

		Transaccione	es de valores	Comisiones de i	ntermediación	
Carteras	Divisa	Valor total*	Porcentaje del total de transacciones de valores	Valor total	Valor total de comisiones de intermediación	Comisiones por futuros**
Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)	EUR	1.394.470	0,00 %	_		210.191
Strategic Absolute Return Bond II Portfolio	USD	_	_	_	_	32.004
Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio	USD	30.679.829	4,09 %	5.093	2,48 %	_
Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I"	NOK		_	_	_	1.043.373
Total (en USD)****		867.345.926		513.955		2.012.918

<sup>\*</sup> Equivale al coste de valores (excluyendo transacciones de futuros e inversiones en Goldman Sachs Liquid Reserves Funds) correspondiente a las operaciones celebradas con Empresas Filiales de Goldman Sachs.

Durante el ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021, no se realizaron transacciones con Empresas Filiales de Goldman Sachs para todas las Carteras restantes.

Todas estas transacciones, incluidas las celebradas con las Empresas Filiales de Goldman Sachs se realizaron en el curso normal del negocio y en condiciones comerciales normales.

#### Préstamos de valores

Goldman Sachs Agency Lending ("GSAL"), una filial de Goldman Sachs, es el agente de préstamo de valores. Los prestatarios aprobados de GSAL pueden incluir Goldman Sachs International ("GSI"), filial del Asesor de inversiones, así como otros terceros. Las Carteras pueden prestar parte de sus inversiones a terceros, percibiendo a cambio una comisión que se negocia para cada transacción. Las Carteras reciben títulos de los Gobiernos del G-10 (excepto Italia, Japón y Estados Unidos) como garantía de los títulos prestados. El G-10 está compuesto por once países industrializados (Bélgica, Canadá, Francia, Alemania, Italia, Japón, Países Bajos, Suecia, Suiza, Reino Unido y Estados Unidos) que realizan consultas entre sí y cooperan en asuntos económicos, financieros y monetarios. Esta garantía se mantiene durante toda la vigencia del préstamo por un importe no inferior al 105 % del valor de los títulos prestados, contabilizándose cualquier margen posterior en la forma de los mencionados títulos del Estado o en efectivo. En general, los préstamos podrán efectuarse a través de instituciones financieras de primer nivel especializadas en dichas actividades y del modo en que estas especifiquen.

Las garantías recibidas por las Carteras en forma de valores gubernamentales o efectivo del G-10 (excluidos Italia, Japón y Estados Unidos), denominados en sus respectivas monedas, son mantenidas por el gestor de garantías tripartito designado en cuentas segregadas.

A continuación, figura un resumen de los valores cedidos en préstamo a 30 de noviembre de 2021, así como de los ingresos percibidos por cada Cartera y las comisiones devengadas por el Agente de préstamo de valores en el marco del programa de Préstamo de valores:

Carteras	Divisa	Valor de mercado de los valores prestados a 30 de noviembre de 2021			de 30 de noviembre	del valor de mercado de los valores prestados a	brutos percibidos durante el ejercicio cerrado a 30 de noviembre	aplicadas en el ejercicio cerrado a 30 de noviembre	Rendimientos netos percibidos durante el
Asia Equity Portfolio	USD	607.037	0,25 %	0,26 %	669.259	110 %	6.534	635	5.899
Emerging Markets Equity Portfolio	USD	16.817.200	0,33 %	0,33 %	18.540.963	110 %	362.728	31.375	331.353
Global Equity Income Portfolio	USD	-	_		_	_	1.391	181	1.210
Global Equity Partners Portfolio	USD	_	_	_	_	=	11.778	800	10.978
Global Millennials Equity Portfolio	USD	3.710.466	0,13 %	0,13 %	4.090.788	110 %	89.609	8.179	81.430
Japan Equity Partners Portfolio**	JPY	_	_	_	_	_	19.508	1.206	18.302
Japan Equity Portfolio**	JPY	370.517	0,20 %	0,20 %	408.496	110 %	25.347	778	24.569
US Equity Portfolio	USD	_	_	_	_	_	2.384	216	2.168

<sup>\*\*</sup> Todas las transacciones de futuros que se muestran en esta tabla se realizaron a través de Goldman Sachs.

<sup>\*\*\*</sup> Expresado en miles.

<sup>\*\*\*\*</sup> El importe se calcula utilizando el tipo de cambio medio indicado en la Nota 10.

### 6 Principales acuerdos y partes vinculadas (continuación)

#### Préstamos de valores (continuación)

Carteras	Divisa	Valor de mercado de los valores prestados a 30 de noviembre de 2021		% del total de activos disponibles para préstamo*	de 30 de	Garantía como porcentaje del valor de mercado de los valores prestados a 30 de noviembre de 2021	brutos percibidos durante el ejercicio cerrado a 30 de noviembre	aplicadas en el ejercicio cerrado a 30 de noviembre	Rendimientos netos percibidos durante el ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021
North America Energy & Energy Infrastructure Equity Portfolio	USD	_	_	_	-	-	9.097	968	8.129
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	USD	16.878.020	0,59 %	0,60 %	18.608.017	110 %	489.684	39.917	449.767
Europe CORE® Equity Portfolio	EUR	7.012.731	0,40 %	0,41 %	7.731.538	110 %	206.590	16.924	189.666
Global CORE® Equity Portfolio	USD	_	_	_	_	=	461.727	25.498	436.229
Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	1.906.895	0,27 %	0,27 %	2.102.357	110 %	31.302	2.992	28.310
US CORE® Equity Portfolio	USD	_	_	_	_	_	150.531	13.983	136.548
US Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	885.413	0,46 %	0,47 %	976.167	110 %	3.886	148	3.738
Global High Yield Portfolio	USD	53.602.827	1,75 %	1,81 %	59.097.116	110 %	307.469	27.720	279.749
Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio	USD	_	_	_		_	1.193	123	1.070
Total (en USD)***							2.586.663	191.075	2.395.588

<sup>\*</sup> Los activos susceptibles de préstamo se definen como el valor de mercado agregado de la renta variable y los bonos mantenidos en la cartera.

### Administrador, Agente de domiciliaciones y de cotizaciones

La Sociedad Gestora ha nombrado a State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch como agente de la administración central del Fondo. El Fondo ha nombrado a State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch como su agente domiciliario y corporativo, agente de pagos y como su agente de cotizaciones en Luxemburgo.

Por sus servicios como Administrador, Agente de domiciliaciones y de cotizaciones, State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch percibe una comisión a mes vencido que se calcula en función del Patrimonio neto medio mensual de cada Cartera.

Con respecto a la cartera India Equity Portfolio, State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch percibe una comisión fija de 25.000 USD por sus servicios como Administrador. State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch también puede percibir comisiones de custodia sobre los activos residuales mantenidos por India Equity Portfolio.

Por sus servicios de elaboración de informes financieros, State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch percibe una comisión fija anual por Cartera pagadera al término de cada mes.

### Depositario

El Fondo ha nombrado a State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch como Depositario. Por sus servicios como Depositario, State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch aplica una comisión que corresponde a unos honorarios en puntos básicos por los activos mantenidos y una comisión basada en la transacción que depende del país de la misma.

### Distribuidor

El Fondo ha designado a la Sociedad Gestora como distribuidor principal y la Sociedad Gestora designará a los subdistribuidores y los supervisará. GSAMFSL podrá recibir una parte de la comisión de venta impuesta a la venta de las acciones de la Cartera. En la tabla adjunta a continuación se detalla el valor de las comisiones de venta retenidas por Cartera.

<sup>\*\*</sup> Expresado en miles.

<sup>\*\*\*</sup> El importe se calcula utilizando el tipo de cambio medio indicado en la Nota 10.

### 6 Principales acuerdos y partes vinculadas (continuación)

### Distribuidor (continuación)

Carteras	Divisa	Comisiones de venta retenidas
Emerging Markets Equity Portfolio	USD	11.312
Global Millennials Equity Portfolio	USD	1.310.613
Global CORE® Equity Portfolio	USD	283.059
Asia High Yield Bond Portfolio	USD	13.492
Emerging Markets Corporate Bond Portfolio	USD	29.083
Global Multi-Asset Income Portfolio	USD	5.806.317
US Real Estate Balanced Portfolio	USD	31
Total (en USD)		7.453.907

Durante el ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021, no existieron comisiones de venta retenidas para el resto de Carteras.

Consulte el Folleto para obtener más información sobre las comisiones de distribución.

Con las comisiones que perciba, el Distribuidor deberá remunerar a los terceros que designe como subdistribuidores

#### Agente de transferencias

La Sociedad Gestora ha nombrado a RBC Investor Services Bank S.A. (el "Agente de transferencias") para que desempeñe las funciones de registrador y agente de transferencias con respecto al Fondo, de conformidad con el Contrato de registrador y agente de transferencias celebrado entre el Fondo, la Sociedad Gestora y el Agente de transferencias.

Los servicios diarios que el Agente de transferencias presta al Fondo incluyen la recepción y el procesamiento de las órdenes de suscripción y reembolso, la adjudicación y emisión de acciones, y el mantenimiento del registro de accionistas para las acciones. El Agente de transferencias recibe al término de cada trimestre una comisión con cargo al patrimonio neto de las Carteras. La comisión del Agente de transferencias está compuesta por una comisión fija y otra variable.

La primera se compone de una comisión anual de mantenimiento y de los gastos originados por la cuenta del accionista. La comisión variable se determina en función del volumen de transacciones registrado en cada Cartera.

#### **Tasador**

La Sociedad Gestora ha nombrado a Goldman Sachs & Co. LLC como su delegado para que actúe en calidad de Tasador, y la función de valoración la llevaron a cabo los Controladores durante el ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021. Consulte también la Nota 4.

### 7 Capital social

A continuación figura un resumen de los movimientos de las acciones de cada Cartera durante el ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021.

	Divisa	Saldo a 30-nov-2020	Suscripciones	Reembolsos	Saldo a 30-nov-2021
Asia Equity Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	80.568	857.126	95.555	842.139
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	176.239	48.428	32.993	191.674
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	6.541	4.412	1.715	9.238
Clase de acciones "A"	USD	71.914	18.787	10.985	79.716
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	219.375	128.111	38.983	308.503
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	1.712.044	3.070.638	1.410.506	3.372.176
Clase de acciones "I"	GBP	781	7.003	_	7.784
Clase de acciones "I"	USD	425.811	26.558	220.410	231.959
Clase de acciones de acumulación "IO"	JPY	4.988.865	518.553	2.407.074	3.100.344
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	182.375	1.427.251	93.906	1.515.720
Clase de acciones "P"	USD	63.869	_	24.298	39.571
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	2.384	_	_	2.384
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	1.142.772	490.935	217.511	1.416.196
Clase de acciones "R"	GBP	20.884	19.672	9.282	31.274
Clase de acciones "R"	USD	177.224	175.075	35.722	316.577
Total de Asia Equity Portfolio		9.271.646	6.792.549	4.598.940	11.465.255

	Divisa	Saldo a 30-nov-2020	Suscripciones	Reembolsos	Saldo a 30-nov-202
All China Equity Portfolio*					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	45.457	99.365	39.932	104.890
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	8.897	12.324	7.176	14.04
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	2.387.724	611.800	2.283.311	716.21
Clase de acciones "I"	USD	707	2		70
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	555.512	863.272	214.221	1.204.56
Clase de acciones "P" Clase de acciones de accumulación "R"	USD USD	6.984	49.598 8.487	28.295	56.58
Clase de acciones de acumulación R  Clase de acciones "R"	GBP	150.726 29.689	17.558	25.649	130.91 21.59
Clase de acciones "R"	USD	122.498		25.049	
	030		184.195 1.846.601		306.69
Total de All China Equity Portfolio		3.308.194	1.846.601	2.598.584	2.556.21
Emerging Markets Equity ESG Portfolio	HeD	2.042.005	2 155 770	245 444	4.052.22
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD USD	2.042.905 21.985	3.155.778 455	245.444 5.437	4.953.23 17.00
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	1.831	33.451	2.755	32.52
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "I"	USD	2.346.200	33.431	2.755	2.346.20
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	231.701	19.137.703	1.219.236	18.150.16
Clase de acciones de acumulación "l"	GBP	98.691	2.312.718	57.289	2.354.12
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	6.151.286	13.105.513	1.825.922	17.430.87
Clase de acciones de acumulación i	USD	32.022	686.528	24.242	694.30
	EUR	570.121	000.320	24.242	
Clase de acciones de acumulación "IO"		570.121	667.051	_	570.12
Clase de acciones "IO"*	USD		667.951	_	667.95
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	1.000	177.761		178.76
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	1.000	259.690	126.964	133.72
Clase de acciones "R" Clase de acciones "R"	GBP USD	523.783 7.191	1.978.437 5.523	380.370 481	2.121.85 12.23
Total de Emerging Markets Equity ESG Portfolio	03D	12.029.716	41.521.508	3.888.140	49.663.08
Emerging Markets Equity Portfolio		12.023.710	41.321.300	3.000.140	43.003.00
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	12.282.320	5.334.431	3.303.611	14.313.14
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	618.179	343.005	145.389	815.79
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	CHF	53.058	3.001	1.500	54.55
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	13.774.856	1.675.792	2.194.226	13.256.42
Clase de acciones puntuales en otras divisas	GBP	29.658	67.528	11.316	85.87
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	528.661	106.930	145.448	490.14
Clase de acciones "A" Clase de acciones "B"	USD USD	282.732	25.667	50.332	258.06 1.10
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	1.107 2.975.715	447.641	526.909	2.896.44
Clase de acciones "G"*	USD	2.975.715	122.449	96.041	26.40
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	9.771.088	7.082.630	3.798.390	13.055.32
Clase de acciones de acumulación "l"	SEK	4.645.162	1.099	4.645.526	73
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	64.604.376	40.176.277	28.805.609	75.975.04
Clase de acciones "I"	EUR	3.531.269	1.840.004		5.371.27
Clase de acciones "I"	GBP	6.596.501	6.561.005	4.193.383	8.964.12
Clase de acciones "I"	USD	3.665.021	892.258	1.362.667	3.194.61
Clase de acciones de acumulación "IO"	GBP	435.040	220.595	200.854	454.78
Clase de acciones de acumulación "IO"*	SEK	_	17.680.413	_	17.680.41
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	17.205.341	3.154.237	941.530	19.418.04
Clase de acciones "IS" (Dis) (estable semestral)	EUR	6.075.952	3.010.186	39.800	9.046.33
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IX"	USD	428.025	67.667	159.362	336.33
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	2.591.412	1.552.437	783.896	3.359.95
Clase de acciones "P"	USD	182.997	139.275	47.117	275.15
Clase de acciones de acumulación "R"	CHF	163.508	20.837	141.599	42.74
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	1.200.639	585.781	241.679	1.544.74
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	10.830.470	6.147.172	3.949.443	13.028.19
Clase de acciones "R"	GBP	4.210.177	4.587.219	2.646.592	6.150.80
Clase de acciones "R"	USD	913.938	497.688	295.655	1.115.97
Total de Emerging Markets Equity Portfolio		167.597.202	102.343.224	58.727.874	211.212.55
Global Environmental Impact Equity Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	537.363	965.480	436.740	1.066.10
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas*	USD	2.609	17.734	_	20.34
Clase de acciones de acumulación en otras divisas*  Clase de acciones de acumulación "E"	EUR EUR	272 225	2.650	720 447	2.65 4.616.11
Clase de acciones de acumulación "E"  Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	273.335 932	5.074.893 2.392.723	732.117 493.834	1.899.82
Clase de acciones de acumulación "I"	GBP	341.620	298.286	493.034	590.82
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	9.160.585	17.135.699	2.063.564	24.232.72
Clase de acciones de acumulación 1	AUD	9.100.505	2.055.408		2.055.40
Clase de acciones "I"	GBP	3.300	6.946	_	10.24
Clase de acciones "I"	USD	109	2.475.954	72.050	2.404.01
Clase de acciones "IO"*	USD	_	37.749.435	_	37.749.43
Clase de acciones de acumulación "P"	GBP	187.691	585.540	248.309	524.92
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	3.718.932	5.017.587	861.487	7.875.03
Clase de acciones "P"	GBP	1.000	_	_	1.00
Clase de acciones "P"	USD	100	_	_	10
Clase de acciones de acumulación "R"	GBP	62.513	422.501	83.077	401.93
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	2.363.350	4.154.474	1.201.979	5.315.84
Clase de acciones "R"	GBP	56.024	2.863.084	63.478	2.855.63
Clase de acciones "R"	USD	100	151.521		151.62
		16.709.563	81.369.915	6.305.712	91.773.76

	Divisa	Saldo a 30-nov-2020	Suscripciones	Reembolsos	Saldo a 30-nov-202
Global Equity Income Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	1.421			1.42
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	202.705	6.905	11.593	198.01
Clase de acciones "A"	USD	17.797	736	3.264	15.26 28.67
Clase de acciones de acumulación "E"  Clase de acciones de acumulación "I"	EUR USD	21.738 965	9.975 153.505	3.039	154.47
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	221.756	422.783	149.544	494.99
Clase de acciones "P"	USD	668	6	-	67
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "R"	USD	1.053	26	_	1.07
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	71.233	7.877	_	79.11
Clase de acciones "R"	GBP	26.052	27.048	165	52.93
Clase de acciones "R"	USD	2.535	2.524		5.05
Total de Global Equity Income Portfolio		567.923	631.385	167.605	1.031.70
Global Equity Partners ESG Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	4.778	488	24	5.24
Clase de acciones en otras divisas	GBP	1.005	4.006	_	5.01
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	20.861	21.581	11.045	31.39
Clase de acciones "A"	USD	14.853	2.836	585	17.10
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	44.188	85.527	13.631	116.08
Clase de acciones "E"	EUR	42.090	19.216	19.112	42.19
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	94.897	966.443	80.377	980.96
Clase de acciones de acumulación "P"	EUR	89.556	17.642		107.19
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	273.953	55.385	42.176	287.16
Clase de acciones "P"	EUR	640	_	_	64
Clase de acciones "P"	USD	72.696	389.747	395.318	67.12
Clase de acciones "R"	USD	609.412	1.361.913	1.092.814	878.51
Total de Global Equity Partners ESG Portfolio		1.268.929	2.924.784	1.655.082	2.538.63
Global Equity Partners Portfolio		-			
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	287.930	8.121	20.074	275.97
(Clase cubierta en USD)	USD	4.643	2.488	_	7.13
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	544.276	17.207	27.648	533.83
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)	USD	1.000	_	_	1.00
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	670.238	327.135	78.923	918.45
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	GBP	239.628	300.529	75.141	465.01
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	12.865		514	12.35
Clase de acciones en otras divisas	GBP	306.102	183.907	41.039	448.97
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	10.661			10.66
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	62.403	9.525	12.732	59.19
Clase de acciones "A"	USD	62.328	1.725	8.078	55.97
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	133.198	9.010	10.774	131.43
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	924.413	388.140	1.081	1.311.47
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	13.918.115	5.199.014	4.056.668	15.060.46
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	4.086.918	1.388.573	790.230	4.685.26
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)	USD	1.066	0.400	44 000	1.06
Clase de acciones "I"	GBP	10.256	8.400	11.283	7.37
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en USD)	USD	1.412.824	3.187	526.435	889.57
Clase de acciones de acumulación "IO"	GBP	1.484.973	685.773	288.412	1.882.33
Clase de acciones de acumulación "IO"*	SEK	2 410 242	19.525.333	722.004	19.525.33
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	2.419.242 1.033.921	1.696.969	722.884	3.393.32
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD)	USD		1.357.210	359.123	2.032.00
Clase de acciones "IO"	USD	2.871.135	90.099	1.167.510	1.793.72
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	1.406.040	738.675	352.934	1.791.78
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones "P"	USD	127.858	111.888 341.563	3.090	236.65
	USD	793.345	341.563	246.999	887.90
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en USD)  Clase de acciones de accumulación "R"	USD EUR	1.067	3 700 000	1 1.761.056	3 772 44
	GBP	1.824.536	3.708.960		3.772.44
Clase de acciones de acumulación "R"  Clase de acciones de acumulación "R"	USD	314.576 1.308.419	254.763 1.045.745	7.234 687.850	562.10 1.666.31
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	939.487	384.748	19.413	1.304.82
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones "R"	USD GBP	93.451	6.754	60.548 338.538	39.65 2.206.10
Clase de acciones "R"	USD	1.731.083	813.561	1.424.575	7.792.04
		6.073.569	3.143.052	1.424.075	
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD)	EUR USD	11.413 154.048	11 110.417	26.657	11.42 237.80
Total de Global Equity Partners Portfolio	000	45.277.027	41.862.482	13.127.444	74.012.06
Global Future Health Care Equity Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	1.000	1.225.576	118.051	1.108.52
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	1.000	4.016	_	5.01
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	893	115.801	3.108	113.58
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	1.016	1.403.355	122.376	1.281.99
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	1.861.196	12.109.017	1.961.638	12.008.57
Clase de acciones "I"	USD	1.000	580.502	187.679	393.82
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	1.670.172	5.726.220	1.282.825	6.113.56
Clase de acciones "P"	USD	331.694	1.335.293	455.352	1.211.63
Clase de acciones de acumulación "R"	GBP	35.319	89.105	44.804	79.62
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	392.002	4.645.157	615.167	4.421.99
Clase de acciones "R"	GBP	10.000	293.158	39.007	264.15
Clase de acciones "R"	USD	1.000	686.117	1.000	686.11
Clase de acciones ix					

		Saldo a			Saldo a
	Divisa	30-nov-2020	Suscripciones	Reembolsos	30-nov-202
Global Future Technology Leaders Equity Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	15.772	170.272	14.814	171.230
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas	USD EUR	20.669 15.068	12.158 292.834	15.771 39.956	17.056
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	14.424	130.713	19.874	267.946 125.263
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	7.428.530	13.885.845	1.128.199	20.186.17
Clase de acciones "I"*	GBP		800	-	80
Clase de acciones "I"	USD	652.683	161.237	78.698	735.22
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	195.725.435	70.304.658		250.943.58
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	4.399.060	2.970.747	1.337.561	6.032.24
Clase de acciones "P"	USD	238.452	423.721	121.731	540.44
Clase de acciones de acumulación "R"	GBP	4.930	358.516	36.571	326.87
Clase de acciones de acumulación "R"*	USD		1.358.633	101.514	1.257.11
Clase de acciones "R"	EUR	155.694	1.095.970	148.821	1.102.84
Clase de acciones "R"  Clase de acciones "R"	GBP USD	1.000	1 500 573	226 911	1.00
Total de Global Future Technology Leaders Equity Portfolio	030	372.968 <b>209.044.685</b>	1.599.573 92.765.677	236.811 18.366.833	1.735.73 283.443.52
Global Millennials Equity Portfolio		203.044.003	92.705.077	10.300.033	203.443.32
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	4.486.310	12.199.213	4.478.039	12.207.48
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	150.097	883.635	347.211	686.52
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	439.999	1.648.280	547.211	1.540.60
Clase de acciones de acumulación en otras divisas  Clase de acciones de acumulación en otras divisas	HKD	794	2.584.855	1.337.178	1.248.47
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	SGD	1.371	8.631.821	1.874.978	6.758.21
Clase de acciones en otras divisas	EUR	550	114.457	61.435	53.57
			3.584.323		
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	1.887.163	3.584.323	1.240.114	4.231.37
Clase de acciones "E"  Clase de acciones de acumulación "I"	EUR EUR	4.968.278 7.409.923		1.976.605 3.793.483	6.229.92
Clase de acciones de acumulación "I"	GBP	274.142	14.462.855 375.464	116.768	18.079.29 532.83
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	9.463.870	19.448.631	7.339.034	21.573.46
Clase de acciones de acumulación 1	GBP	379.228	55.301	213.474	221.05
Clase de acciones "I"	USD	6.912.149	851.405	724.648	7.038.90
Clase de acciones "IO"	USD	1.441.275	4.588.245	143.665	5.885.85
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	3.190.449	3.651.376	1.314.427	5.527.39
Clase de acciones "P"	USD	458.648	1.064.499	227.137	1.296.01
Clase de acciones de acumulación "R"	GBP	221.976	353.824	78.335	497.46
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	3.452.418	3.140.212	1.607.300	4.985.33
Clase de acciones "R"	GBP	1.055.695	829.970	234.400	1.651.26
Clase de acciones "R"	USD	4.005.764	1.401.433	1.152.678	4.254.51
Total de Global Millennials Equity Portfolio		50.200.099	83.108.054	28.808.586	104.499.56
India Equity Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	17.874.307	5.410.873	6.889.801	16.395.37
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	2.522.737	649.784	943.124	2.229.39
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	SEK	1.087.805	276.857	295.126	1.069.53
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	SGD	11.308	55.811	19.009	48.11
Clase de acciones en otras divisas	GBP	19.863	87.165	3.408	103.62
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	81.948	84.171	64.736	101.38
Clase de acciones "A"	USD	680.370	212.751	195.317	697.80
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	2.868.652	1.673.241	1.277.681	3.264.21
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	324.728	713.995	175.809	862.91
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	14.474.379	10.892.081	5.448.830	19.917.63
Clase de acciones "I"	GBP	6.971.792	1.329.705	2.001.337	6.300.16
Clase de acciones "I"	USD	972.825	744.001	513.181	1.203.64
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	6.125.585	8.792.960	4.926.561	9.991.98
Clase de acciones de acumulación "P"	EUR	1.974	20	916	1.07
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	938.192	731.698	502.369	1.167.52
Clase de acciones "P"	USD	69.332	209.913	149.664	129.58
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	1.142.192	934.707	341.778	1.735.12
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	4.018.814	1.296.953	1.337.821	3.977.94
Clase de acciones "R"	GBP	2.322.713	1.171.280	1.069.037	2.424.95
Clase de acciones "R"	USD	1.091.926	362.563	309.849	1.144.64
Total de India Equity Portfolio		63.601.442	35.630.529	26.465.354	72.766.61
Japan Equity Partners Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	JPY	44.670	427.837	114.921	357.58
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	925	58.087	21.777	37.23
Clase de acciones de acumulación en otras divisas*	USD	923	999	-1.77	99
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF)	CHF	29.738	30.041	2.007	57.77
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHP)  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	59.410	46.719	26.684	79.44
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en USD)*	USD		999		99
Clase de acciones de acumulación en oras divisas (clase dubletta en obb)	JPY	818.336	65.600	109.314	774.62
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	7.326.231	4.101.832	2.501.891	8.926.17
Clase de acciones de acumulación "l"	GBP	255.333	894.421	135.612	1.014.14
Clase de acciones de acumulación "l"  Clase de acciones de acumulación "l"	JPY	4.724.462	5.334.526	3.154.386	6.904.60
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.734.538	810.144	1.135.816	1.408.86
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EDR)  Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.734.536	913.172	36.251	2.403.38
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)					
Clase de acciones de acumulación 1 (Clase cubierta en USD)  Clase de acciones "I"	USD	4.130.298	6.965.381	854.598 227.166	10.241.08
	GBP	1.349.264	610.553	227.166	1.732.65
Clase de acciones de acumulación "IO"	JPY	1.016.796	498.719	66 740	1.515.51
Clase de acciones de acumulación "IO"  Clase de acciones de acumulación "P"	USD JPY	1.102	10.864.088	66.748 29.822	10.798.44 464.46
		305.122	189.167	29.822	404 4

	Divisa	Saldo a	Quantizata	Doomhalas	Saldo a
Japan Equity Partners Portfolio (continuación)	DIVISA	30-nov-2020	Suscripciones	Keembolsos	30-nov-202
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD)	USD	2.420.346	817.876	688.907	2.549.31
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)	GBP	147.091	65.244	37.436	174.899
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en USD)	USD	1.645.200	1.096.868	65.412	2.676.65
Clase de acciones de acumulación "R"	JPY	530.549	211.697	41.803	700.44
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.617.077	418.789	295.602	1.740.26
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	66.002	98.011	12.761	151.25
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en USD)	USD	1.434.270	918.462	648.878	1.703.85
Clase de acciones "R" Clase de acciones "R"*	GBP JPY	1.073	13.381	1.056	1.07 12.32
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.681.134	772.349	244.469	2.209.01
Total de Japan Equity Partners Portfolio	OBI	32.865.434	36.224.962	10.453.317	58.637.07
Japan Equity Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	JPY	168.738	82.119	45.443	205.41
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	JPY	780.788	32.465	82.843	730.41
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	977.800	521.397	288.583	1.210.61
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK)	SEK	38.180	3.105	9.573	31.71
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en USD)	USD	50.018	188.606	32.377	206.24
Clase de acciones en otras divisas	GBP	1.567	1.473	329	2.71
Clase de acciones en otras divisas	USD	228.995	214.158	111.974	331.17
Clase de acciones "A"	USD	262.789	140.732	60.537	342.98
Clase de acciones "B"	USD	8.021	_	_	8.02
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	3.497.321	1.204.140	2.770.954	1.930.50
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.820.961	636.633	394.022	2.063.57
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	JPY	9.409.746	2.186.309	4.393.984	7.202.07
Clase de acciones de acumulación "I"	JPY	4.169.650	1.921.579	715.004	5.376.22
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	2.269.696	4.889.655	2.174.807	4.984.54
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)	USD	493.530	410.017	234.363	669.18
Clase de acciones "I"	JPY	727.978	137.780	254.340	611.41
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	4.399.231	443.615	1.335.154	3.507.69
Clase de acciones puntuales de acumulación "IS"*	EUR	_	12.075.202	299.452	11.775.75
Clase de acciones puntuales de acumulación "IS"*	JPY	_	105.809	36.839	68.97
Clase de acciones puntuales de acumulación "IS" (Clase cubierta en EUR)*	EUR	-	5.504.199	5.463.153	41.04
Clase de acciones de acumulación "P"	JPY	19.035	13	1.424	17.62
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD)  Clase de acciones "P"	USD	440.034	15.343	48.153	407.22
	JPY	26.079	15	1.059	25.03
Clase de acciones puntuales de acumulación "R"	JPY	418.327	396.278	193.763	620.84
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP GBP	9.636	721	1.647	8.71
Clase de acciones puntuales "R"	JPY	232.411	37.155	116.140	153.42
Clase de acciones puntuales "R"	USD	73.119	7.211 5.062	353	79.97
Clase de acciones puntuales "R"  Clase de acciones puntuales de acumulación "RS" (Clase cubierta en EUR)*	EUR	4.057	881		9.11
Total de Japan Equity Portfolio	LUK	30.527.707	31.161.672	19.066.270	42.623.10
US Equity Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	14.824.400	4.341.445	3.742.214	15.423.63
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	228.736	14.851	35.100	208.48
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	14.862	4.096	995	17.96
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	4.425.963	157.901	433,185	4.150.67
Clase de acciones en otras divisas	GBP	20.135	3.304	4.024	19.41
Clase de acciones en otras divisas	SGD	28.119	_	_	28.11
Clase de acciones "A"	USD	425.763	3.115	6.890	421.98
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	166.838	41.885	18.956	189.76
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	8.576	1.317	1.402	8.49
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	14.168	_	3.932	10.23
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	132.656	14.158	61.846	84.96
Clase de acciones "I"	GBP	66.904	259	10.473	56.69
Clase de acciones "I"	USD	163.202	647	10.275	153.57
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	180.183	182.915	141.300	221.79
Clase de acciones "IS"	GBP	1.202.272	_	261.584	940.68
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	292.791	10.605	33.693	269.70
Clase de acciones "P"	USD	112.815	_	68.799	44.01
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	227.572	59.475	29.385	257.66
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	58.824	77.865	3.650	133.03
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	384.294	116.455	39.677	461.07
Clase de acciones "R"	GBP	36.510	8.819	12.907	32.42
Clase de acciones "R"	USD	162.079	15.758	50.134	127.70
Total de US Equity Portfolio		23.177.662	5.054.870	4.970.421	23.262.11
US Focused Growth Equity Portfolio  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	164.917	67.775	54.720	177.97
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	277.594	17.866	95.450	200.01
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones "A"	USD	351.417	5.083	10.224	346.27
Clase de acciones 'A' Clase de acciones "B"			3.003	10.224	
	USD	5.124	46 140	20.240	5.12
Clase de acciones de acumulación "E"  Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	23.819	46.140 15.145	20.340 18.627	49.61
Clase de acciones de acumulación I	USD USD	17.113 1.151	15.145		13.6: 3
Orașe de audiories i	USD	205.637	1	811	
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	200.037	_	_	205.63 1.00
Clase de acciones de acumulación "P"		4 000			
Clase de acciones "P"	USD	1.000	9 200		
Clase de acciones "P" Clase de acciones de acumulación "R"	USD USD	13.439	8.300 30.404	600	21.13
Clase de acciones "P"	USD		8.300 30.404 79.311		

US Small Cap Equity Portfolio*  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia  Ul clase de acciones denominada en la divisa de referencia  Ul clase de acciones de acumulación "E"  Clase de acciones de acumulación "I"  Ul clase de acciones "I"  Ul clase de acciones "I"  Ul clase de acciones de acumulación "P"  Clase de acciones de acumulación "P"  Ul clase de acciones de acumulación "P"  Ul clase de acciones de acumulación "R"  Ul clase de acciones "R"  Gase de acciones "R"  Ul clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)  Ul clase de acciones "R"  Ul clase de acciones	ISD UR IS	116 116 6.532 115 100 96.714 998 6.502 1.788.145	39.869 746.943 84.866 180.972 31.871 9.456	7.818 — — 31.815	30-nov-2021 116 116 38.583 747.058
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Ulase de acciones denominada en la divisa de referencia Ulase de acciones de acumulación "E" Clase de acciones de acumulación "I" Ulase de acciones de acumulación "I" Ulase de acciones de acumulación "P" Ulase de acciones de acumulación "P" Ulase de acciones de acumulación "P" Ulase de acciones de acumulación "R" Ulase de acciones de acumulación "R" Ulase de acciones de acumulación "R" Ulase de accio	SD UR SD SD UR SD SD UR SD UR SBP	116 6.532 115 100 96.714 998 6.502 1.788.145	746.943 84.866 180.972 31.871	_	116 38.583 747.058
Clase de acciones de acumulación "E"  Clase de acciones de acumulación "I"  Clase de acciones "I"  Clase de acciones "I"  Clase de acciones de acumulación "P"  Clase de acciones de acumulación "P"  Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones "P"  Clase de acciones de acumulación "R"  Clase de acciones de acumulación "R"  Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)  Elicase de acciones "R"  Clase de acciones "R"  Clase de acciones "R"  UTotal de US Small Cap Equity Portfolio  US Technology Opportunities Equity Portfolio  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	UR ISD ISD UR ISD ISD UR ISD UR ISB	6.532 115 100 96.714 998 6.502 1.788.145	746.943 84.866 180.972 31.871	_	38.583 747.058
Clase de acciones de acumulación "I"  Clase de acciones "I"  Clase de acciones de acumulación "P"  Clase de acciones de acumulación "P"  Clase de acciones de acumulación "P"  Clase de acciones "P"  Uclase de acciones de acumulación "R"  Clase de acciones "R"  Glase de acciones "R"  Glase de acciones "R"  UTotal de US Small Cap Equity Portfolio  US Technology Opportunities Equity Portfolio  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia  US Technology Opportunities Equity Portfolio	ISD ISD UR ISD ISD ISD UR ISP	115 100 96.714 998 6.502 1.788.145	746.943 84.866 180.972 31.871	_	747.058
Clase de acciones "I"  Clase de acciones de acumulación "P"  Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones "P"  Clase de acciones "P"  Clase de acciones de acumulación "R"  Clase de acciones de acumulación "R"  Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones "R"  Glase de acciones "R"  Glase de acciones "R"  UU  Total de US Small Cap Equity Portfolio  US Technology Opportunities Equity Portfolio  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia  U	ISD ISD UR ISD ISD UR ISBP	100 96.714 998 6.502 1.788.145	84.866 180.972 31.871	— — 31.815	
Clase de acciones de acumulación "P" U. Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) El Clase de acciones "P" U. Clase de acciones "P" U. Clase de acciones de acumulación "R" U. Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) El Clase de acciones "R" G. Clase de acciones "R" G. Clase de acciones "R" U. Total de US Small Cap Equity Portfolio  US Technology Opportunities Equity Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia U.	ISD UR ISD ISD UR ISBP	96.714 998 6.502 1.788.145	180.972 31.871	31.815	
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones "P"  U:  Clase de acciones de acumulación "R"  Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)  Elicase de acciones "R"  Clase de acciones "R"  Clase de acciones "R"  U:  Total de US Small Cap Equity Portfolio  US Technology Opportunities Equity Portfolio  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia  U:	UR ISD ISD UR IBP	998 6.502 1.788.145	31.871		84.966 245.87
Clase de acciones "P"  Clase de acciones de acumulación "R"  Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)  El Clase de acciones "R"  Glase de acciones "R"  Clase de acciones "R"  UTotal de US Small Cap Equity Portfolio  US Technology Opportunities Equity Portfolio  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia  U	ISD ISD UR BBP	6.502 1.788.145			32.869
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones "R"  Clase de acciones "R"  USTacla de US Small Cap Equity Portfolio  US Technology Opportunities Equity Portfolio  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia  USTACHORIOGIA DE COMPANION DE CLASE DE COMPANION DE CLASE DE COMPANION DE CLASE DE CLA	UR BP		0.700	_	15.958
Clase de acciones "R" G Clase de acciones "R" U  Total de US Small Cap Equity Portfolio US Technology Opportunities Equity Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia U	BP		1.365.216	191.958	2.961.403
Clase de acciones "R" U  Total de US Small Cap Equity Portfolio  US Technology Opportunities Equity Portfolio  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia U.		122.147	_	89.117	33.030
Total de US Small Cap Equity Portfolio  US Technology Opportunities Equity Portfolio  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia  U	SD	765	_	_	765
US Technology Opportunities Equity Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia U.		1.003.089	498.083	173.167	1.328.005
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia U		3.025.339	2.957.276	493.875	5.488.740
	SD	1.000			1.000
Olade de deciones denominada en la divida de referencia	ISD	1.000	1.937	_	2.937
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	UR	850	1.557	_	850
	UR	850	343	_	1.193
Clase de acciones de acumulación "I"	BP	2.300	_	_	2.300
Clase de acciones de acumulación "I"	SD	3.000	4.333.331	186.428	4.149.903
	SD	3.000	31.111	_	34.11
	SD	7.607.075	29.031.639	6.617.481	30.021.233
	ISD	10.000	614.292	174.752	449.540
	BP SD	750 1.000	22.193 64.436	2.429	20.514 65.436
	SD	1.000	04.430		1.000
Total de US Technology Opportunities Equity Portfolio	OD	7.631.825	34.099.282	6.981.090	34.750.017
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio*					
• • • • • • • • • • • • • • • • • • • •	SD	_	1.000	_	1.000
	SD	_	1.000	_	1.000
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia*	SD	_	1.000	_	1.000
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis)*	IKD	_	1.000	_	1.000
	UR	_	1.000	_	1.000
	KD	_	1.000	_	1.000
	UR	_	1.000		1.000
	ISD	_	1.000	_	1.000
	UR ISD	_	1.000 480.876		1.000 479.876
	BP		1.000	1.000	1.000
	SD	_	1.000	_	1.000
	SD	_	1.000	_	1.000
	SD	_	1.000	_	1.000
Clase de acciones de acumulación "R"*	UR	_	1.000	_	1.000
Clase de acciones de acumulación "R"*	SD	_	1.000	_	1.000
	UR	_	1.000	_	1.000
	BP	_	1.000	_	1.000
	SD		1.000	—————	1.000
Total de Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio			498.876	1.000	497.876
Global Infrastructure Equity Portfolio					
	SD	116.954		104.051	244.770
	SD	90			_
	ISD	2.552			3.022
	UR UR	93 18.354			58.777
	UR	82	01.202	40.659	82
	UR	13.110	10.224	9.247	14.087
	UR	159.331	1.074.619	323.415	910.535
	UR	13.520			21.990
	BP	92	2	94	_
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "I"*	SD	86	2	88	_
	BP	81	_	_	81
	SD	481.559	344.712	271.484	554.787
	BP	86		_	87
	SD	79		_	70.70
	ISD	970			131.914
	ISD	154.373			833.980
	ISD	20.245			145.36
	BP SD	92 86			-
Grade de acciones (didia unitestal) (Dis) IN	BP	81	7		8
Clase de acciones de acumulación "R"		16.164			130.23
	SD		114 0/16	JJ4	100.20
Clase de acciones de acumulación "R"	SD				241
Clase de acciones de acumulación "R"  Clase de acciones "R"  G	ISD BP ISD	393 1.637		48	345 1.638

	Divisa	Saldo a 30-nov-2020	Suscripciones	Reembolsos	Saldo a 30-nov-202
Global Real Estate Equity Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	146.937	105.377	18.954	233.360
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	1.249 1.071	6.661	1.794	6.116
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones en otras divisas (bruta trimestral) (Dis)*	USD EUR	1.071	23 33	1.206	1.094
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	404.705	459.755	355.556	508.90
Clase de acciones en otras divisas*	EUR	1.071	23	1.094	_
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "E"	EUR	10.138	43	7.427	2.75
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	7.859	7.132	1.929	13.06
Clase de acciones "E"	EUR	13.363	14	4.253	9.12
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "I"*	GBP	956	27	983	-
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "I"	USD	655.695	4.780		660.47
Clase de acciones de acumulación "I"*	GBP	817		817	4 007 47
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	1.462.753	588.411	753.694	1.297.47
Clase de acciones "I"*	GBP	894	27	921	-
Clase de acciones "I"	USD	1.096	33		1.12
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "P"	USD	854.830	4.939	265.037	594.73
Clase de acciones de acumulación "P"  Clase de acciones "P"	USD USD	491.339 83.990	81.975 27	101.426 48.023	471.88 35.99
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "R"	GBP	1.700	35	46.023	1.73
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "R"*	USD	1.173	33	1.206	1.73
Clase de acciones de acumulación "R"*	GBP	817	_	817	
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	1.000	_	_	1.00
Clase de acciones "R"*	GBP	893	26	919	
				313	4.40
Clase de acciones "R"	USD	1.095	32		1.12
Total de Global Real Estate Equity Portfolio		4.146.614	1.259.406	1.566.056	3.839.96
North America Energy & Energy Infrastructure Equity Portfolio	1100	0.700.700	500.040	770 554	0.400.00
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	2.706.768	500.010	770.551	2.436.22
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones "A"	USD USD	209.756 3.992	119.448 44.103	73.301 37	255.90 48.05
Clase de acciones A  Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	286.768	1.749.997	1.050.559	986.20
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	173.412	243.806	260.596	156.62
Clase de acciones "I"	USD	361	12	200.550	37
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	3.913.687	393.574	1.416.732	2.890.52
Clase de acciones "P"	USD	662.634	19.064	59.117	622.58
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	429	20.990	10.800	10.61
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	172.607	110.090	9.153	273.54
Clase de acciones "R"	USD	22.655		16.651	6.00
Total de North America Energy & Energy Infrastructure Equity Portfolio		8.153.069	3.201.094	3.667.497	7.686.66
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio					
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en la divisa de referencia	USD	10.069.337	3.830.408	2.862.633	11.037.11
Clase de acciones puntuales de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	386.570	75.848	297.826	164.59
Clase de acciones puntuales denominada en la divisa de referencia	USD EUR	19.667	9.684	17.999 2.053.032	11.35
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas (Long	EUR	3.112.557	2.669.853	2.053.032	3.729.37
Emerging Markets CCY vs. USD)	CHF	9.800	17.978	400	27.37
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas (Long	EUR	12.000	13.220	_	25.22
Emerging Markets CCY vs. USD)  Clase de acciones puntuales de acumulación "A" (Long Emerging Markets CCY vs. USD)	PLN	38.079	_	2.955	35.12
Clase de acciones puntuales de acumulación A (Long Emerging Markets CC+ vs. 05D)  Clase de acciones puntuales "A" *	USD	36.079	1.004	2.955	1.00
Clase de acciones de acumulación "E" al cierre	EUR	69.987	21.471	38.100	53.35
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	EUR	13.825.325	7.906.194	1.997.839	19.733.68
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	USD	71.698.783	26.374.987	34.561.652	63.512.11
Clase de acciones puntuales de acumulación "I"	GBP	4.324.407	2.787.546	850.898	6.261.05
Clase de acciones "I" al cierre	EUR	3.593.162	1.099.570	14.192	4.678.54
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	GBP	244.225	13.260	1.430	256.05
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	JPY	4.518.979	43.474	306.327	4.256.12
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	USD	13.300.613	624.646	1.688.473	12.236.78
Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"*	JPY	_	1.096	_	1.09
Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"	USD	3.997.679	128.300	1.325.597	2.800.38
Clase de acciones puntuales "IO"	USD	3.083.820	1.631.415	423.419	4.291.81
Clase de acciones de acumulación "P" al cierre	USD	1.556.376	226.628	402.026	1.380.97
Clase de acciones "P" al cierre	USD	116.964	48.159	26.956	138.16
Clase de acciones de acumulación "R" al cierre	USD	3.850.417	2.183.630	2.402.915	3.631.13
Clase de acciones de acumulación "R" al cierre (Long Emerging Markets CCY vs. USD)	EUR	13.436	114.584	69.398	58.62 6.919.10
Clase de acciones "R" al cierre Clase de acciones "R" al cierre	GBP USD	4.630.083 816.508	3.382.775 423.896	1.093.750 131.634	1.108.77
Total de Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	OOD	143.288.774	53.629.626	50.569.451	146.348.94
Europe CORE® Equity Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	EUR	4.946.200	1.541.174	1.905.907	4.581.46
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	EUR	2.047.354	94.292	482.779	1.658.86
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	USD	53.300	36.951	9.400	80.85
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en USD)	USD	14.708	14.828	7.910	21.62
Clase de acciones en otras divisas	GBP	4.223	43.902	8.023	40.10

	Divisa	Saldo a 30-nov-2020	Suscripciones	Reembolsos	Saldo a 30-nov-202
Europe CORE® Equity Portfolio (continuación)					
Clase de acciones de acumulación "A"	EUR	78.539	99.579	7.904	170.214
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	621.397	177.853	240.263	558.987
Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)	PLN	38.079	99.713		137.792
Clase de acciones "A"	EUR	1.406.542	151.381	410.432	1.147.49
Clase de acciones "A"	USD	764.155	16.730	48.462 1.498.798	732.423
Clase de acciones de acumulación "E"  Clase de acciones de acumulación "I"	EUR CHF	4.213.545	1.537.131 191	11.869	4.251.878
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	12.783 50.458.159	12.854.931	29.586.957	1.105 33.726.133
Clase de acciones de acumulación "l"	USD	2.878.949	2.494.254	1.550.904	3.822.29
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF)	CHF	18.137	90.845	11.617	97.36
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	3.780.381	90.045	204.994	3.575.38
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)	USD	10.000		204.554	10.00
Clase de acciones "I"	EUR	7.796.515	935.369	4.788.734	3.943.15
Clase de acciones de acumulación "IO"	EUR	1.294.960	21.899	54.094	1.262.76
Clase de acciones de acumulación "IO" (Long European CCY vs. EUR)	SGD	31.736.935	_	2.145.512	29.591.42
Clase de acciones de acumulación "IS"*	EUR	_	1.983.617	248.470	1.735.14
Clase de acciones de acumulación "P"	EUR	4.250.382	307.737	570.448	3.987.67
Clase de acciones "P"	EUR	156.257	1.126.626	17.619	1.265.26
Clase de acciones "P"	GBP	38.969	2.915	1.121	40.76
Clase de acciones "P"	USD	177.000	104.737	6.265	275.47
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	6.136.181	1.558.188	4.375.870	3.318.49
Clase de acciones "R"	EUR	2.328.487	287.455	1.459.891	1.156.05
Clase de acciones "R"	GBP	260.818	42.338	192.332	110.82
Clase de acciones "R"	USD	344.665	94.773	207.473	231.96
Total de Europe CORE® Equity Portfolio		125.928.737	25.741.297	50.067.955	
Eurozone CORE® Equity Portfolio*					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia*	EUR	_	1.000	_	1.00
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia*	EUR		1.000		1.00
Clase de acciones de acumulación en otras divisas*	USD	_	1.000	_	1.00
Clase de acciones de acumulación "E"*	EUR	_	1.000	_	1.00
Clase de acciones de acumulación "I"*	EUR	_	294.140	_	294.14
Clase de acciones "I"*	EUR	_	100.000	_	100.00
Clase de acciones de acumulación "R"*	EUR	_	1.000	_	1.00
Clase de acciones "R"*	EUR	_	1.000	_	1.00
Total de Eurozone CORE® Equity Portfolio			400.140		400.14
Global CORE® Equity Portfolio					
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en la divisa de referencia	USD	1.756.740	1.219.437	741.608	2.234.56
Clase de acciones puntuales de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	2.402.208	540.220	915.818	2.026.61
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) al cierre denominada en la divisa de	USD	917	12		92
referencia				_	
Clase de acciones al cierre denominada en la divisa de referencia	USD	456.910	119.091	135.697	440.30
Clase de acciones puntuales denominada en la divisa de referencia	USD	734.703	116.269	230.606	620.36
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas	HKD	34.410	244.664	172.090	106.98
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas	SGD	238.740	78.271	81.386	235.62
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas	AUD	89.566	442.748	412.941	119.37
(Clase cubierta en AUD)  Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas					
(Clase cubierta en SGD)	SGD	260.576	459.213	490.792	228.99
Clase de acciones puntuales de acumulación en otras divisas	EUR	2.797.900	1.446.478	1.419.922	2.824.45
Clase de acciones puntuales de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	15.304	147.398	20.105	142.59
Clase de acciones puntuales "A"	USD	465.008	122.326	232.350	354.98
Clase de acciones de acumulación "E" al cierre	EUR	3.407.776	366.320	854.247	2.919.84
Clase de acciones puntuales de acumulación "E"	EUR	4.275.224	410.544	1.053.456	3.632.31
Clase de acciones puntuales de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.645.831	407.390	1.032.362	1.020.85
Clase de acciones puntuales "G"*	USD	_	177.604		177.60
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	EUR	15.214.905	4.617.420	4.361.705	15.470.62
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	USD	27.996.279	10.192.309	12.307.108	25.881.48
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre (Clase cubierta en CHF)	CHF	6.908	_	1.914	4.99
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.289.016	163.360	449.353	1.003.02
Clase de acciones puntuales de acumulación "l"*	GBP	_	11.865	2	11.86
Clase de acciones puntuales de acumulación "I"*	SEK	_	910	_	91
Clase de acciones puntuales de acumulación "I"	USD	1.348.929	6.554.367	1.159.553	6.743.74
Clase de acciones puntuales de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.627.723	241.442	1.037.801	831.36
Clase de acciones "I" al cierre	GBP	16.310	7.152	8.481	14.98
Clase de acciones "I" al cierre	USD	2.242.340	77.000	285.000	2.034.34
Clase de acciones puntuales "I"	USD	1.920.000	1.410.907	1.014.507	2.316.40
Clase de acciones puntuales (mensual) (Dis) (Cap) "IO"	USD	21.079	60.028	14.516	66.59
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	EUR	2.294.542	62.136	283.614	2.073.06
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre*	GBP	214	_	214	
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	USD	3.459.253	1.834.509	1.109.363	4.184.39
Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"*	SEK	_	19.665.758	_	19.665.75
Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"	USD	83.887.357	823.073	23.032.712	61.677.7
Clase de acciones puntuales "IO"	USD	9.872.153	3.324.808	2.249.371	10.947.59
Clase de acciones puntuales de acumulación "IS"*	EUR	_	858	_	85
	USD	_	1.004	_	1.00
Clase de acciones puntuales de acumulación "IS"*					
Clase de acciones puntuales de acumulación "IS"  Clase de acciones puntuales de acumulación "IS"  Clase de acciones puntuales de acumulación "P"	EUR	_	858 71.497	 551.728	85 3.248.00

cobal CORE® Equity Portfolio (continuación)  Clase de acciones puntuales "P"  Clase de acciones de acumulación "R" al cierre (Clase cubierta en CHF)  Clase de acciones puntuales de acumulación "R"  Clase de acciones puntuales de acumulación "R"  Clase de acciones puntuales de acumulación "R"  Clase de acciones "R" al cierre  Clase de acciones puntuales "R"  al de Global CORE® Equity Portfolio	USD CHF EUR	276.541 2.202	24.610 4.382	Reembolsos 52.187	30-nov-202 <sup>-</sup> 248.964
Clase de acciones puntuales "P" Clase de acciones de acumulación "R" al cierre (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones puntuales de acumulación "R" Clase de acciones puntuales de acumulación "R" Clase de acciones "R" al cierre Clase de acciones puntuales "R"	CHF EUR			52.187	248 964
Clase de acciones puntuales de acumulación "R" Clase de acciones puntuales de acumulación "R" Clase de acciones "R" al cierre Clase de acciones puntuales "R"	EUR	2.202	4 382		
Clase de acciones puntuales de acumulación "R"  Clase de acciones "R" al cierre  Clase de acciones puntuales "R"			7.502	_	6.584
Clase de acciones "R" al cierre Clase de acciones puntuales "R"		199.981	78.360	157.782	120.559
Clase de acciones puntuales "R"	USD	2.838.053	289.491	1.908.785	1.218.759
	GBP	247.683	50.120	135.306	162.49
al de Global CORES Equity Portfolio	USD	891.871	269.240	136.929	1.024.182
obal Small Cap CORE® Equity Portfolio		177.963.391	56.135.449	58.051.311	176.047.529
Clase de acciones al cierre denominada en la divisa de referencia	USD	641.732	414.358	184.597	871.49
Clase de acciones puntuales denominada en la divisa de referencia	USD	7.292.138	433.019	728.128	6.997.029
Clase de acciones puntuales de acumulación en otras divisas	EUR	125.098	177.855	85.401	217.55
Clase de acciones puntuales de acumulación en otras divisas	SEK	13.163	3.094	663	15.59
Clase de acciones "A" al cierre	USD	40.934	11.317	19.912	32.33
Clase de acciones puntuales "A"	USD	35.525	15.304	5.176	45.65
Clase de acciones de acumulación "E" al cierre	EUR	527.540	103.846	219.706	411.68
Clase de acciones puntuales de acumulación "E"	EUR	547.063	169.349	167.343	549.06
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	GBP	830	412	518	72
Clase de acciones puntuales de acumulación "I"	EUR	1.719.108	4.788.924	4.523.251	1.984.78
Clase de acciones puntuales de acumulación "I"	USD	1.632.159	451.963	1.115.490	968.63
Clase de acciones "I" al cierre	GBP	796.571	90.195	152.726	734.04
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	GBP	5.685	2.456	943	7.19
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	JPY	4.926.618		1.187.836	3.738.78
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	USD	967.863	414.106	365.740	1.016.22
Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"*	SEK		13.045.364		13.045.36
Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"	USD	886.739	196.264	335.785	747.21
Clase de acciones puntuales "IO" Clase de acciones puntuales de accumulación "P"	USD	3.943.739	2.218.868	779.598	5.383.00
Clase de acciones puntuales de acumulación "P"	USD USD	141.769 134.054	24.517 84.611	1.869 91.242	164.41 127.42
Clase de acciones puntuales de acumulación 100 Clase de acciones puntuales "R"	GBP	152.358	87.681	164.758	75.28
Clase de acciones puntuales "R"	USD	57.816	4.488	5.951	56.35
al de Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	005	24.588.502	22.737.991	10.136.633	37.189.86
CORE® Equity Portfolio					
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en la divisa de referencia	USD	1.167.555	585.371	636.445	1.116.48
Clase de acciones puntuales de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	1.556.375	1.307.242	269.771	2.593.84
Clase de acciones al cierre denominada en la divisa de referencia	USD	171.812	6.797	20.053	158.55
Clase de acciones puntuales denominada en la divisa de referencia	USD	1.137.044	209.985	263.610	1.083.41
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas	HKD	889			88
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas	SGD	68.120	166.738	14.850	220.00
Clase de acciones puntuales "A"	USD	739.763	385.547	135.822	989.48
Clase de acciones puntuales de acumulación "E"	EUR	4.216.487	1.320.846	1.268.987	4.268.34
Clase de acciones puntuales de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	EUR HKD	737.367 788	633.636	605.219	765.78 78
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	USD	15.579.643	9.358.364	7.904.556	17.033.45
Clase de acciones puntuales de acumulación "I"	USD	36.281.116	23.515.149	39.106.963	20.689.30
Clase de acciones puntuales de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	5.467.518	2.316.212	2.255.693	5.528.03
Clase de acciones puntuales "I"	USD	6.426.420	3.040.482	1.414.391	8.052.51
Clase de acciones puntuales de acumulación "P"	USD	1.580.048	278.697	150.345	1.708.40
Clase de acciones puntuales "P"	USD	19.581	628.663	_	648.24
Clase de acciones puntuales de acumulación "R"	USD	1.762.716	75.336	218.634	1.619.41
Clase de acciones puntuales "R"	GBP	60.473	8.262	6.726	62.00
Clase de acciones puntuales "R"	USD	2.585.707	240.286	1.611.134	1.214.85
Clase de acciones "U" al cierre	USD	141.230			141.23
al de US CORE® Equity Portfolio		79.700.652	44.077.613	55.883.199	67.895.06
Small Cap CORE® Equity Portfolio	1100	00.054	00.000	55.000	05.40
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en la divisa de referencia Clase de acciones puntuales de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD USD	62.051 16.514	29.020 14.209	55.890 10.434	35.18 20.28
Clase de acciones puntuales de acumulación denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones puntuales denominada en la divisa de referencia	USD	17.409	3.567	2.295	18.68
Clase de acciones "A" al cierre	USD	77.570	109.569	13.005	174.13
Clase de acciones de acumulación "E" al cierre	EUR	27.450	14.117	11.551	30.01
Clase de acciones puntuales de acumulación "E"	EUR	52.841	139.160	59.414	132.58
Clase de acciones puntuales de acumulación "I"	USD	445.602	68.294	405.661	108.23
Clase de acciones puntuales "I"	USD	413.779	75.382	209.060	280.10
Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"	USD	10.763.380	439.775	4.282.376	6.920.77
Clase de acciones puntuales de acumulación "P"	USD	1.527.389	138.248	510.622	1.155.01
Clase de acciones puntuales de acumulación "R"	USD	159.360	337.580	341.207	155.73
Clase de acciones puntuales "R"	GBP	42.224	41.023	32.825	50.42
Clase de acciones puntuales "R"	USD	52.703	35.661	10.762	77.60
al de US Small Cap CORE® Equity Portfolio		13.658.272	1.445.605	5.945.102	9.158.77
ia High Yield Bond Portfolio		740	400.00:	0.000	400.0-
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	712	123.824	2.282	122.25
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	31.934	51.437	28.494	54.87
Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	6.768	743.561	36.325	714.00
	HKD	811	78.343	848	78.30
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis)	ALID	1 017	EEO		
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase cubierta en AUD)	AUD	1.015	552 74	_	1.56
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis)	AUD AUD EUR	1.015 1.015 1.015	552 74 68	  254	1.56 1.08 82

	Divisa	Saldo a 30-nov-2020	Suscripciones	Reembolsos	Saldo a 30-nov-2021
Asia High Yield Bond Portfolio (continuación)					
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en SGD)	SGD	1.421	37.249	8.744	29.926
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR EUR	101 101	6 120	_	101 6.231
Clase de acciones "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de accumulación "I SD"	USD	15.580	6.130 1.251.566	188.841	1.078.305
Clase de acciones "I SD"*	GBP	15.500	230.620	23.354	207.266
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) "I"*	USD	_	10.943		10.943
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	74.494	788.925	89.028	774.391
Clase de acciones "I"	GBP	100	174.101	172.809	1.392
Clase de acciones "I"	USD	100	555.613	48.556	507.157
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)*	EUR	_	404.598	9.902	394.696
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)*	GBP	400.054	71	400 704	71
Clase de acciones "IS"  Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) "P"*	USD	163.851	3.033 22.399	166.704	180 22.399
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	100	138.379	29.348	109.131
Clase de acciones "P"	USD	100	9.819	102	9.817
Clase de acciones "R"	GBP	100	799	_	899
Total de Asia High Yield Bond Portfolio		300.333	4.632.178	805.591	4.126.920
Emerging Markets Corporate Bond Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	1.295.506	1.803.188	611.666	2.487.028
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	162.960	257.636	83.734	336.862
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	281.492	114.292	56.409	339.375
Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	737.746	1.505.157	509.222	1.733.681
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	66.280	77.980	12.423	131.837
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis)	HKD	477.705	169.771	331.837	315.639
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase cubierta en AUD)	AUD	64.052	8.696	12.958	59.790
Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en SGD)	SGD	209.140	269.501	71.255	407.386
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR)	AUD EUR	43.539 650	8.280 7.879	11.299 2.336	40.520 6.193
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en CBP)	GBP	34.122	21.540	13.029	42.633
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en SGD)	SGD	531.466	51.288	177.994	404.760
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF)	CHF	356	_	_	356
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	421.317	338.840	206.671	553.486
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	78.168	763.214	784.373	57.009
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en GBP)	GBP	19.092	8.863	7.881	20.074
Clase de acciones "A"	USD	90.098	60.012	57.570	92.540
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	59.877	15.846	10.070	65.653
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	71.202	26.032	23.216	74.018
Clase de acciones (estable mensual) (Dis) "I"	USD	35.232	108.989	87.598	56.623
Clase de acciones de acumulación "I"  Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en BRL)*	USD USD	9.356.151	5.039.505 25.502	5.587.022 9.035	8.808.634 16.467
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF)	CHF	158.131	12.502	153.966	16.667
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	2.380.575	2.241.532	966.768	3.655.339
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	49.651	11.508	24.372	36.787
Clase de acciones "I"	USD	427.182	239.596	155.237	511.541
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.095.930	868.843	122.988	1.841.785
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.189.406	81.995	572.560	698.841
Clase de acciones de acumulación "IO"	JPY	527.121	_	35.656	491.465
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	710.000		67.000	643.000
Clase de acciones "IO"	USD	12.523	595	3.455	9.663
Clase de acciones de acumulación "IS" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P"	EUR USD	2.339.246	1.381.085	201.407	3.518.924 145.002
Clase de acciones de acumulación P  Clase de acciones "P"	USD	117.364 6.288	96.966 61.391	69.328	67.679
Clase de acciones P  Clase de acciones de acumulación "R"	USD	303.616	359.828	138.211	525.233
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF)	CHF	4.799	3.241	3.686	4.354
Clase de acciones "R"	USD	84.537	130.254	21.484	193.307
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	68.545	26.944	8.064	87.425
Total de Emerging Markets Corporate Bond Portfolio		23.511.065	16.198.291	11.211.780	28.497.576
Emerging Markets Debt Blend Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	3.513	_	2.030	1.483
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	15.634	1.125	7.918	8.841
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	9.775	2.146	650	11.271
Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	1.716	44	26	1.734
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase parcialmente cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	7.013 197.071	319	2.453	4.879
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR USD	1.140.903	12.875 181.615	1.812 145.595	208.134 1.176.923
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	3.361.551	59.935	2.872.439	549.047
Clase de acciones "I"	USD	141	6		147
Clase de acciones "I" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	1.418	59	_	1.477
Clase de acciones "IO" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	3.302.258	_	_	3.302.258
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	100	_	_	100
Clase de acciones "R"	USD	1.191	6	_	1.197
Clase de acciones "R" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	1.793	1.002	702	2.093
Total de Emerging Markets Debt Blend Portfolio		8.044.077	259.132	3.033.625	5.269.584
Emerging Markets Debt Local Portfolio	1100	770 400	4.000	100 474	E04.004
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	770.466	4.092	183.174	591.384
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	HIGH				
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD USD	1.457 148.595	47 11.474	15.305	1.504 144.764

Clase de acciones en ortas divisas   GBP   32.331   Clase de acciones de acumulación 'A'   USD   168.858   Clase de acciones (de acumulación 'A'   USD   658.858   Clase de acciones (mestral) (Dis) 'E'   EUR   564.887   Clase de acciones (timestral) (Dis) 'E'   EUR   345.333   Clase de acciones de acumulación 'E'   EUR   345.333   Clase de acciones de acumulación 'E'   EUR   345.333   Clase de acciones de acumulación 'B'   EUR   4.578.872   Clase de acciones de acumulación 'I'   EUR   4.578.872   Clase de acciones de acumulación 'I'   EUR   4.578.872   Clase de acciones de acumulación 'I'   GBP   723.103   Clase de acciones de acumulación 'I'   USD   1362.619   Clase de acciones de acumulación 'I'   USD   3.691.803   Clase de acciones de acumulación 'I'   USD   3.891.903   Clase de acciones de acumulación 'I'   USD   3.891.903   Clase de acciones de acumulación 'I'   USD   3.191.415   Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) 'IX'   USD   191.066 (26   Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) 'IX'   USD   191.066 (26   Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) 'IX'   USD   191.066 (26   Clase de acciones de acumulación 'R'   USD   37.679.731   USD   178.457   USD   178.4	3 104.717 3.875 109.974 37.652 3.113 192.064 2.928.663 396.603 2.595.823 213.116 4.088.259 — 1.720.063 3,790.666 6.747.877 24.104.011 5,701.794 249.973 2.834 102 1.913.650 28 1.883 22.618 54.944.974 1.587.176 — 1.323.868 62 1.176.365 2.980.119 813.800	9.400 34.244 65.239 69.698 79.910 87.771 86.022 2.380.430 318.369 4.286.786 3.282.086 421.103 18.210 322.618 660.685 72.197.861 15.983.777 350.364 46.588 313.712 25.210 31.522 2463.491 172.612 3.616.643 6.778.383 2.502.814	22.934 239.331 602.470 605.163 303.075 317.419 4.684.914 20.265.265 801.337 29.961.656 5.912.933 5.932.299 10.674.108 4.893.268 4.877.234 16.452.345 143.212.776 27.397.748 1.262.530 134.703 32.653 1.838.265 680 9.806 224.600 281.397.164
Clase de acciones de acumulación "A"   USD   168.858	104.717 3.875 109.974 37.652 3.113 192.064 2.928.663 396.603 2.595.823 213.116 4.088.259 — 1.720.063 3.790.666 6.747.877 24.104.011 5.701.794 249.973 2.834 102 1.913.650 28 1.883 22.618 54.944.974  1.587.176 — 1.323.868 62 1.176.365 2.980.119	34.244 65.239 69.698 79.910 87.771 86.022 2.380.430 318.369 4.286.786 3.282.086 421.103 322.618 660.685 72.197.861 15.983.777 350.364 46.588 138 313.712	239.331 602.470 605.163 303.075 317.419 4.684.914 20.265.265 801.337 29.961.656 5.912.933 5.932.299 10.674.108 4.893.268 4.877.234 16.452.345 143.212.776 27.397.748 1.262.530 134.703 32.653 1.838.265 680 9.806 224.600 281.397.164
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E"   EUR   345.333     Clase de acciones de acumulación "E"   EUR   345.333     Clase de acciones de acumulación "I"   EUR   345.333     Clase de acciones (trimestral) (Dis) "I"   EUR   402.077     Clase de acciones de acumulación "I"   EUR   19.717.032     Clase de acciones de acumulación "I"   EUR   19.717.032     Clase de acciones de acumulación "I"   EUR   19.717.032     Clase de acciones de acumulación "I"   USD   31.652.619     Clase de acciones de acumulación "I"   USD   31.652.619     Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) "IO"   USD   1.844.040     Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) "IO"   USD   1.844.040     Clase de acciones de acumulación "IO"   USD   1.849.140     Clase de acciones de acumulación "IO"   USD   1.849.140     Clase de acciones de acumulación "IO"   USD   1.849.140     Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IX"   USD   1.849.140     Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IX"   USD   1.859.151     Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO"   USD   1.869.151     Clase de acciones de acumulación "P"   USD   1.862.513     Clase de acciones de acumulación "P"   USD   1.862.513     Clase de acciones de acumulación "R"   USD   1.862.513     Clase de acciones de acumulación "R"   USD   1.829.212     Clase de acciones de acumulación "R"   USD   233.327     Clase de acciones de acumulación "R"   USD   233.504     Clase de acciones "P"   USD   33.935     Clase de acciones de acumulación enominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración   USD   33.935     Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (USE en Usida en USD   33.935     Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (USE en Usida en USD   33.935     Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (USE en Usida en USD   33.935     Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (USE en Usida en USD   33.935     Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de refe	3.875 109.974 37.652 3.113 192.064 2.928.663 386.603 2.595.823 213.116 4.088.259 — 1.720.063 3.790.666 6.747.877 24.104.011 5.701.794 249.973 2.834 102 1.913.650 28 1.883 22.618 54.944.974  1.587.176 — 1.323.868 62 1.176.365 2.980.119	65.239 69.698 79.910 87.771 86.022 2.380.430 318.369 4.286.786 3.282.086 421.103 18.210 322.618 660.685 72.197.861 15.983.777 350.364 46.588 313.712 25.210 21.522 2101.270.222	602.470 605.163 303.075 317.419 4.684.914 20.265.265 801.337 29.961.656 5.912.933 10.674.108 4.893.268 4.877.234 16.452.345 143.212.776 27.397.748 1.262.530 134.703 32.653 1.838.265 680 9.806 224.600 281.397.164
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E"   EUR   564.887	109.974 37.652 3.113 192.064 2.928.663 396.603 2.595.823 213.116 4.088.259 — 1.720.063 3.790.666 6.747.877 24.104.011 5.701.794 249.973 2.834 102 1.913.650 28 3.26.18 54.944.974  1.587.176 — 1.323.868 62 1.176.365 2.980.119	69.698 79.910 87.771 86.022 2.380.430 318.369 4.286.786 3.282.086 421.103 18.210 322.618 660.685 72.197.861 15.983.777 350.364 46.588 138 313.712 — 25.210 31.522 101.270.222 2.463.491 172.612 3.616.643 — 6.778.383 2.502.814	605.163 303.075 317.419 4.684.914 20.265.265 801.337 29.961.656 5.912.933 5.932.299 10.674.108 4.893.268 4.877.234 1.262.5234 1.342.12.776 27.397.748 1.262.5345 134.703 32.653 1.838.265 680 9.806 224.600 281.397.164
Clase de acciones de acumulación "E"   EUR   345.333	37.652 3.113 192.064 2.928.663 396.603 2.595.823 213.116 4.088.259 — 1.720.063 3.790.666 6.747.877 24.104.011 5.701.794 249.973 2.834 102 1.913.650 28 1.883 22.618 54.944.974  1.587.176 — 1.323.868 62 2.980.119	79.910 87.771 86.022 2.380.430 318.369 4.286.786 3.282.086 421.103 322.618 660.685 72.197.861 15.983.777 350.364 46.588 138 313.712	303.075 317.419 4.684.914 20.265.265 801.337 29.961.656 5.912.933 5.932.299 10.674.108 4.893.268 4.877.234 1.6452.345 143.212.776 27.397.748 1.262.530 32.653 1.838.265 680 9.806 224.600 281.397.164
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "I"   EUR   4.578.872	3.113 192.064 2.928.663 396.603 2.595.823 213.116 4.088.259 — 1.720.063 3.790.666 6.747.877 24.104.011 5.701.794 249.973 2.834 102 1.913.650 28 1.883 22.618 54.944.974  1.587.176 — 1.323.868 62 2.1176.365 2.980.119	87.771 86.022 2.380,430 318.369 4.286.786 3.282.086 421.103 18.210 322.618 660.685 72.197.861 15.983.777 350.364 46.588 43.88 313.712	317.419 4.684.914 20.265.265 801.337 29.961.656 5.912.933 5.932.299 10.674.108 4.893.268 4.877.234 16.452.345 143.212.776 27.397.748 1.262.530 134.703 32.653 1.838.265 680 9.806 224.600 281.397.164
Clase de acciones de acumulación "I"	192.064 2.928.663 3.96.603 2.595.823 213.116 4.088.259 — 1.720.063 3.790.666 6.747.877 24.104.011 5.701.794 249.973 2.834 102 1.913.650 28 8.22.618 54.944.974  1.587.176 — 1.323.868 62 2.980.119	86.022 2.380.430 318.369 4.286.786 3.282.086 421.103 18.210 322.618 660.685 72.197.861 15.983.777 350.364 46.588 313.712	4.684.914 20.265.265 801.337 29.961.656 5.912.933 10.674.108 4.893.268 4.877.234 1.6452.345 143.212.776 27.397.748 1.262.530 134.703 32.653 1.838.265 680 9.806 224.600 281.397.164
Clase de acciones de acumulación "I"	2.928.663 396.603 2.595.823 213.116 4.088.259 1.720.063 3.790.666 6.747.877 24.104.011 5.701.794 249.973 2.834 102 1.913.650 28 1.883 22.618 54.944.974 1.587.176 — 1.323.868 62 2.980.119	2.380.430 318.369 4.286.786 3.282.086 — 421.103 322.618 660.685 72.197.861 15.983.777 350.364 46.588 138 313.712 — 25.210 31.522 101.270.222  2.463.491 172.612 3.616.643 — 6.778.383 2.502.814	20.265.265 801.337 29.961.656 5.912.933 5.932.299 10.674.108 4.893.268 4.877.234 16.452.345 143.212.776 27.397.748 1.262.530 32.653 1.838.265 680 9.806 224.600 281.397.164
Clase de acciones de acumulación "1"	396.603 2.595.823 213.116 4.088.259 — 1.720.063 3.790.666 6.747.877 24.104.011 5.701.794 249.973 2.834 102 1.913.650 28 1.883 22.618 54.944.974  1.587.176 — 1.323.868 62 2.116.365 2.980.119	318.369 4.286.786 3.282.086 421.103 18.210 322.618 660.685 72.197.861 15.983.777 350.364 46.588 138 313.712	801.337 29.961.656 5.912.933 5.932.299 10.674.108 4.893.268 4.877.234 16.452.345 143.212.776 27.397.748 1.262.530 134.703 32.653 1.838.265 680 9.806 224.600 281.397.164
Clase de acciones de acumulación "I"   USD   31,652,e19	2.595.823 213.116 4.088.259 — 1.720.063 3.790.666 6.747.877 24.104.011 5.701.794 249.973 2.834 102 1.913.650 28 1.883 22.618 54.944.974 1.587.176 — 1.323.868 62 1.116.365 2.980.119	4.286.786 3.282.086 421.103 18.210 322.618 660.685 72.197.861 15.983.777 350.364 46.588 313.712 25.210 31.522 2.463.491 172.612 3.616.643 6.778.383 2.502.814	29.961.656 5.912.933 5.932.299 10.674.108 4.893.268 4.877.234 16.452.345 143.212.776 27.397.748 1.262.530 33.653 1.838.265 680 9.806 224.6000 281.397.164 7.057.936 216.953 4.707.665 1.374
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) "10"   USD   1.844.040	213.116 4.088.259 — 1.720.063 3.790.666 6.747.877 24.104.011 5.701.794 249.973 2.834 102 1.913.650 28 3.2.618 54.944.974  1.587.176 — 1.323.868 62 2.980.119	3.282.086 421.103 18.210 322.618 660.685 72.197.861 15.983.777 350.364 46.588 138 313.712 ————————————————————————————————————	5.912.933 5.932.299 10.674.108 4.893.268 4.877.234 16.452.345 143.212.776 27.397.748 1.262.530 32.653 1.838.265 680 9.806 224.600 281.397.164
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) "10"	4.088.259 — 1.720.063 3.790.666 6.747.877 24.104.011 5.701.794 249.973 2.834 102 1.913.650 28 1.883 22.618 54.944.974 1.587.176 — 1.323.868 62 2.116.365 2.980.119	421.103 18.210 322.618 660.685 72.197.861 15.983.777 350.364 46.588 138 313.712	5.932.299 10.674.108 4.893.268 4.877.234 16.452.345 143.212.776 27.397.748 1.262.530 134.703 32.653 1.838.265 680 9.806 224.600 281.397.164 7.057.936 216.953 4.707.665 1.374
Clase de acciones de acumulación "10"   USD   3.191.415	1.720.63 3.790.666 6.747.877 24.104.011 5.701.794 249.973 2.834 102 1.913.650 28 1.883 22.618 54.944.974 1.587.176 — 1.323.868 62 1.116.365 2.980.119	18.210 322.618 660.685 72.197.861 15.983.777 350.364 46.588 138 313.712 25.210 31.522 101.270.222 2.463.491 172.612 3.616.643 6.778.383 2.502.814	10.674.108 4.893.268 4.877.234 16.452.345 143.212.776 27.397.748 1.262.530 134.703 32.653 1.838.265 680 9.806 224.6000 281.397.164 7.057.936 216.953 4.707.665 1.374
Clase de acciones de acumulación "IO"   USD   1.409.186   Clase de acciones "IO"   USD   1.409.186   Clase de acciones "IO"   USD   1.409.186   Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IX"   USD   191.306.626   Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO"   USD   191.306.626   Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO"   USD   37.679.731   Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO"   USD   1.362.921   Clase de acciones "P"   USD   178.457   USD   1.362.921   Clase de acciones de acumulación "R"   USD   238.327   Clase de acciones de acumulación "R"   USD   238.327   Clase de acciones "R"   USD   238.327   Clase de acciones "R"   USD   238.327   USD   238.328   USD   23	3.790.666 6.747.877 24.104.011 5.701.794 249.973 2.834 102 1.913.650 28 3.883 22.618 54.944.974 1.587.176 — 1.323.868 62 1.176.365 2.980.119	18.210 322.618 660.685 72.197.861 15.983.777 350.364 46.588 138 313.712 25.210 31.522 101.270.222 2.463.491 172.612 3.616.643 6.778.383 2.502.814	4.893.268 4.877.234 16.452.345 143.212.776 27.397.748 1.262.530 32.653 1.838.265 680 9.806 224.600 281.397.164 7.057.936 216.953 4.707.665 1.374
Clase de acciones "IS"         EUR         10.365.153           Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IX"         USD         191.306.626           Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO"         USD         191.306.626           Clase de acciones de acumulación "P"         USD         1.362.921           Clase de acciones de acumulación "R"         USD         178.457           Clase de acciones de acumulación "R"         USD         236.327           Clase de acciones "R"         GBP         33.133           Clase de acciones "R"         GBP         33.133           Clase de acciones "R"         USD         233.504           Total de Emerging Markets Debt Local Portfolio           Emerging Markets Debt Portfolio           Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia         USD         7.934.251           Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)         USD         389.565           Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia         USD         7.934.251           Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia         USD         4.00.261           Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia         USD         4.707.258	6.747.877 24.104.011 5.701.794 249.973 2.834 102 1.913.650 28 1.883 22.618 54.944.974  1.587.176 — 1.323.868 62 1.176.365 2.980.119	660.685 72.197.861 15.983.777 350.364 46.588 313.712 — 25.210 31.522 101.270.222 2.463.491 172.612 3.616.643 — 6.778.383 2.502.814	16.452.345 143.212.776 27.397.748 1.262.530 134.703 32.653 1.838.265 9.806 9.806 224.600 281.397.164 7.057.936 216.953 4.707.665 1.374
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IX"         USD         37.679.731           Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO"         USD         37.679.731           Clase de acciones de acumulación "P"         USD         1.362.921           Clase de acciones de acumulación "R"         USD         178.457           Clase de acciones de acumulación "R"         USD         238.327           Clase de acciones "R"         USD         33.133           Clase de acciones "R"         USD         33.133           Clase de acciones "R"         USD         233.504           Total de Emerging Markets Debt Local Portfolio         USD         233.504           Total de Emerging Markets Debt Portfolio         USD         7.934.251           Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia         USD         7.934.251           Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)         USD         389.565           Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia         USD         1.312           Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia         USD         4.707.258           Clase de acciones (enesual) (Dis) denominada en la divisa de referencia         USD         4.707.258           Clase de acciones (enesual	24.104.011 5.701.794 249.973 2.834 102 1.913.650 28 1.883 22.618 54.944.974 1.587.176 — 1.323.868 62 1.176.365 2.980.119	72.197.861 15.983.777 350.364 46.588 138 313.712 25.210 31.522 101.270.222 2.463.491 172.612 3.616.643 6.778.383 2.502.814	143.212.776 27.397.748 1.262.530 134.703 32.653 1.838.265 680 9.806 224.600 281.397.164 7.057.936 216.953 4.707.665
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO" USD 1.362.921 Clase de acciones de acumulación "P" USD 1.362.921 Clase de acciones de acumulación "R" USD 1.362.921 Clase de acciones de acumulación "R" USD 228.327 Clase de acciones de acumulación "R" USD 228.327 Clase de acciones de acumulación "R" USD 238.327 Clase de acciones "R" CBP CIASE DESTRICIONES COMPANIONES COMPAN	5.701.794 249.973 2.834 102 1.913.650 28 2.618 54.944.974 1.587.176 — 1.323.868 62 1.176.365 2.980.119	15.983.777 350.364 46.588 138 313.712 25.210 31.522 101.270.222 2.463.491 172.612 3.616.643 6.778.383 2.502.814	27.397.748 1.262.530 134.703 32.653 1.838.265 680 9.806 224.600 281.397.164 7.057.936 216.953 4.707.665 1.374
Clase de acciones de acumulación "P" Clase de acciones "P" Clase de acciones "P" Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración) Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación	249.973 2.834 102 1.913.650 28 1.883 22.618 54.944.974 1.587.176 — 1.323.868 62 2.116.365 2.980.119	350.364 46.588 138 313.712 — 25.210 31.522 101.270.222 2.463.491 172.612 3.616.643 — 6.778.383 2.502.814	1.262.530 134.703 32.653 1.838.265 680 9.806 224.600 281.397.164 7.057.936 216.953 4.707.665
Clase de acciones "P" Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración) Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en UR) Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de ac	2.834 102 1.913.650 28 1.883 22.618 54.944.974 1.587.176 — 1.323.868 61.176.365 2.980.119	46.588 138 313.712 25.210 31.522 101.270.222 2.463.491 172.612 3.616.643 6.778.383 2.502.814	134.703 32.653 1.838.265 680 9.806 224.600 281.397.164 7.057.936 216.953 4.707.665
Clase de acciones de acumulación "R"	102 1.913.650 28 1.883 22.618 54.944.974 1.587.176 — 1.323.868 62 1.176.365 2.980.119	138 313.712 25.210 31.522 101.270.222 2.463.491 172.612 3.616.643 6.778.383 2.502.814	32.653 1.838.265 680 9.806 224.600 <b>281.397.164</b> 7.057.936 216.953 4.707.665 1.374
Clase de acciones "R"	1.913.650 28 1.883 22.618 <b>54.944.974</b> 1.587.176 — 1.323.868 62 1.176.365 2.980.119	313.712 — 25.210 31.522 101.270.222 2.463.491 172.612 3.616.643 — 6.778.383 2.502.814	1.838.265 680 9.806 224.600 <b>281.397.164</b> 7.057.936 216.953 4.707.665 1.374
Clase de acciones "R" GBP 33.133 Clase de acciones "R" USD 233.504  Total de Emerging Markets Debt Local Portfolio USD 233.504  Total de Emerging Markets Debt Local Portfolio USD 233.504  Emerging Markets Debt Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase cubierta en duración) USD 389.565 Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR) USD 389.565 Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR) EUR 7.000.440 Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia (USD 13.122 Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia USD 14.707.258 Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia USD 14.707.258 Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia USD 5.407.150 Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en UsD 5.407.150 Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en UsD 5.407.150 Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en UR) USD 5.407.150 Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR) EUR 655.134 Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en HKD) HKD 514.141 Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) CHF 521.051 Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 52.535 Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 52.535 Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 578.132 Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) (EUR 1.336.626 Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) EUR 6.314.348 Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) (EUR 6.314.348 Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en E	1.587.176 	25.210 31.522 101.270.222 2.463.491 172.612 3.616.643 — 6.778.383 2.502.814	9.806 224.600 281.397.164 7.057.936 216.953 4.707.665 1.374
Clase de acciones "R"         GBP (clase de acciones "R")         33.133 (233.504)           Total de Emerging Markets Debt Local Portfolio         323.504           Emerging Markets Debt Portfolio           Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia         USD (232.421)           Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)         USD (238.565)           Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR)         EUR (200.440)           Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia         USD (200.440)           Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia         USD (200.47.258)           Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia         USD (200.47.258)           Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (200.47.258)         USD (200.47.258)           Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (200.47.258)         USD (200.47.258)           Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (200.47.258)         USD (200.47.258)           Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (200.47.258)         USD (200.47.258)           Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR)         EUR (200.47.241)           Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (200.47.258)         USD	1.883 22.618 54.944.974 1.587.176 — 1.323.868 62 1.176.365 2.980.119	31.522 101.270.222 2.463.491 172.612 3.616.643 — 6.778.383 2.502.814	9.806 224.600 <b>281.397.164</b> 7.057.936 216.953 4.707.665 1.374
Clase de acciones "R"  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en HKD)  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (mensual) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones	22.618 54.944.974 1.587.176 — 1.323.868 62 1.176.365 2.980.119	31.522 101.270.222 2.463.491 172.612 3.616.643 — 6.778.383 2.502.814	224.600 281.397.164 7.057.936 216.953 4.707.665 1.374
Total de Emerging Markets Debt Local Portfolio  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración) Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración) Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia USD 1.312 Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia USD 4.707.258 Clase de acciones denominada en la divisa de referencia USD 5.407.150 Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración) USD 430.891 Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en SGD) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" USD 3.239.527 Clase de acciones de acumulación "A" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acc	1.587.176 — 1.323.868 62 1.176.365 2.980.119	2.463.491 172.612 3.616.643 — 6.778.383 2.502.814	7.057.936 216.953 4.707.665 1.374
Emerging Markets Debt Portfolio  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración) USD 389.565  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración) USD 389.565  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR) EUR 7.000.440  Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia USD 1.312  Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia USD 4.707.258  Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia USD 5.407.150  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia USD 5.407.150  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración) USD 430.891  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en UR) EUR 655.134  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR) EUR 655.134  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en HKD) HKD 514.141  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) CHF 521.051  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) CHF 521.051  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 52.535  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 52.535  Clase de acciones de acumulación "A" USD 578.132  Clase de acciones de acumulación "A" USD 578.132  Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) EUR 1.333.117  Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) EUR 4.304.853  Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) EUR 4.304.853  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) EUR 6.314.348  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) EUR 6.314.348  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) EUR 6.314.348  Clase de acciones de acu	1.587.176 — 1.323.868 62 1.176.365 2.980.119	2.463.491 172.612 3.616.643 — 6.778.383 2.502.814	7.057.936 216.953 4.707.665 1.374
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia USD 7.934.251 Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración) USD 389.565 Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR) EUR 7.000.440 Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia USD 1.312 Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia USD 1.8561.496 Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia USD 4.707.258 Clase de acciones denominada en la divisa de referencia USD 5.407.150 Clase de acciones denominada en la divisa de referencia USD 5.407.150 Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración) USD 430.891 Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR) EUR 655.134 Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en HKD) HKD 514.141 Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en CHF) CHF 521.051 Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (CHF 521.051 Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (CHF 521.051 Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (CHF 521.051 Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (CHF 521.051 Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (CHF 521.051 Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (CHF 521.051 Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (CHF 521.051 Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (CHF 521.051 Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (CHF 521.051 Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (CHF 521.051 Clase de acciones de acumulación en en EUR) (CHF 521.051 Clase de acciones de acumulación en en EUR) (CHF 521.051 Clase de acciones de acumulación en en EUR) (CHF	1.323.868 62 1.176.365 2.980.119	172.612 3.616.643 — 6.778.383 2.502.814	216.953 4.707.665 1.374
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)  Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia  USD  18.561.496  Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia  USD  5.407.150  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia  USD  5.407.150  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia  USD  5.407.150  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)  USD  430.891  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF)  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "A"  USD  578.132  Clase de acciones de acumulación "A"  USD  578.132  Clase de acciones (mensual) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  EUR  6.314.348  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  EUR  6.314.348  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)	1.323.868 62 1.176.365 2.980.119	172.612 3.616.643 — 6.778.383 2.502.814	216.953 4.707.665 1.374
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia USD 1.312 Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia USD 4.707.258 Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia USD 4.707.258 Clase de acciones denominada en la divisa de referencia USD 5.407.150 Clase de acciones denominada en la divisa de referencia USD 5.407.150 Clase de acciones denominada en la divisa de referencia USD 5.407.150 Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración) Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR) EUR 655.134 Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en HKD) HKD 514.141 Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en SGD) SGD 7.831.407 Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 52.535 Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" USD 3.239.527 Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) EUR 6.314.348 Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase cubierta en dur	62 1.176.365 2.980.119	3.616.643 — 6.778.383 2.502.814	4.707.665 1.374
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia  USD  18.561.496  Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la la divisa de referencia  USD  4.707.258  Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la la divisa de referencia  USD  5.407.150  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)  USD  430.891  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR)  EUR  655.134  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en HKD)  HKD  514.141  Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en SGD)  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF)  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)  EUR  52.535  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en SGD)  SGD  910.360  Clase de acciones de acumulación "A"  USD  578.132  Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  EUR  6.314.348  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  EUR  6.314.348  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  EUR  6.314.348  Clase de accio	62 1.176.365 2.980.119	6.778.383 2.502.814	1.374
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia  USD 4.707.258  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia  USD 5.407.150  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR)  EUR 655.134  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en HKD)  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en HKD)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF)  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF)  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en SGD)  Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"  USD 3.239.527  Clase de acciones de acumulación "A"  Clase de acciones de acumulación "A"  Clase de acciones de acumulación "A"  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  EUR  6.314.348  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  EUR  6.314.348  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  EUR  6.314.348  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  EUR  6.314.348  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  EUR  6.314.348  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubiert	1.176.365 2.980.119	2.502.814	
Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en HKD)  Clase de acciones en otras divisas (setable mensual) (Dis) (Clase cubierta en SGD)  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF)  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en SGD)  Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"  Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"  Clase de acciones de acumulación "A"  Clase de acciones de acumulación "A"  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  EUR  6.314.348  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  EUR  6.314.348  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  EUR  6.374.349  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  EUR  6.374.349  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  EUR  6.374.349  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  EUR  6.374.349  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  EUR  6.374.348  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  EUR  6.374.348  Clase de ac	2.980.119	2.502.814	
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en HKD)  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en SGD)  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF)  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (CHF  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (CHF  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (CHF  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (CHF  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"  Clase de acciones de acumulación "A"  Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)  Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  EUR  6.314.348  7.722.241  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  EUR  6.37		1 252 205	5.184.563
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR)  EUR  655.134  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en CHF)  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF)  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en SGD)  Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"  USD  578.132  Clase de acciones de acumulación "A"  Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)  Clase de acciones (minestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  EUR  6.314.348  EUR  6.792.241  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)  EUR  709.946		1.253.205	4.967.745
Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en HKD) HKD 514.141  Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en SGD) SGD 7.831.407  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) CHF 521.051  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 52.535  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 1.611.900  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en SGD) SGD 910.360  Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" USD 3.239.527  Clase de acciones de acumulación "A" USD 578.132  Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN) PLN 1.393.117  Clase de acciones "A" USD 2.403.951  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) EUR 4.304.853  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 6.314.348  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) EUR 8.722.241  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 8.722.241  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 8.722.241  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 8.722.241		210.343	220.548
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en SGD)  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF)  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en SGD)  Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"  Clase de acciones de acumulación "A"  Clase de acciones de acumulación "A"  Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)  Clase de acciones "A"  USD  78.132  Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)  Clase de acciones "A"  USD  2.403.951  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  EUR  6.314.348  8.722.241  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  EUR  7.89.46	1.968	264.671	392.431
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en SGD) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" USD 3.239.527 Clase de acciones de acumulación "A" USD 578.132 Clase de acciones de acumulación "A" USD 2.403.951 Clase de acciones "A" USD 2.403.951 Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) CLAST	_	71.531	442.610
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en SGD)  Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en SGD)  Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"  USD 3.239.527  Clase de acciones de acumulación "A"  Clase de acciones de acumulación "A"  Clase de acciones de acumulación "A"  Clase de acciones "A"  USD 2.403.951  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase cubierta en EUR)  EUR  8.722.241  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)  EUR  709.946	1.685.304	2.348.846	7.167.865
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en SGD) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones "A" USD 2.403,951 Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase de acciones de acumulación "E" Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase de acciones de acumulación "E" Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E"	50.495	175.713	395.833
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en SGD)  Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"  Clase de acciones de accumulación "A"  Clase de acciones de accumulación "A" (Clase cubierta en PLN)  Clase de acciones de accumulación "A" (Clase cubierta en PLN)  Clase de acciones "A"  USD  2.403.951  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de accumulación "E"  Clase de acciones de accumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de accumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de accumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de accumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  EUR  8.722.241  Clase de acciones de accumulación "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)  EUR  709.946	_	14.437	38.098
Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"  Clase de acciones de acumulación "A"  Clase de acciones de acumulación "A"  Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)  Clase de acciones "A"  USD 2.403.951  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  EUR 8.722.241  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)	33.990	681.051	964.839
Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN) 578.132 Clase de acciones (Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN) PLN 1.393.117 Clase de acciones "A" USD 2.403.951 Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) EUR 4.304.853 Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 1.336.626 Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) EUR 6.314.348 Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) EUR 8.722.241 Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 709.946	28.335	706.567	232.128
Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN) PLN 1.393.117 Clase de acciones "A" USD 2.403.951 Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) EUR 4.304.853 Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 1.336.626 Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) EUR 6.314.348 Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) EUR 8.722.241 Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 709.946	208.874	681.404	2.766.997
Clase de acciones "A"  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)  EUR  1.336.626  Clase de acciones de acumulación "E"  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  EUR  8.722.241  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)  EUR  709.946	64.184	169.279	473.037
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)  EUR 1.336.626  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)  EUR 8.722.241  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)  EUR 709.946	393.756	480.592	1.306.281
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 1.336.626 Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) EUR 6.314.348 Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) EUR 8.722.241 Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 709.946	45.300 166.594	583.118	1.866.133
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) EUR 6.314.348 Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 709.946	100.594	1.236.761 461.647	3.234.686 874.979
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) EUR 8.722.241 Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 709.946	495.365	1.018.290	5.791.423
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 709.946	1.304.331	2.049.548	7.977.024
	1.504.551	221.768	488.178
	_	37.770	12.170
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "I" GBP 9.045	18.382	915	26.512
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en CHF)  CHF  5.684.601	288.723	5.466.358	506.966
Clase de acciones de acumulación "I" USD 50.915.753	7.542.475	23.532.406	34.925.822
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) CHF 944.145	45.050	393.350	595.845
Clase de acciones de acumulación "l" (Clase cubierta en duración)* EUR 944	_	944	_
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) EUR 37.432.316	12.058.867	8.764.212	40.726.971
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 133.035	_	127.915	5.120
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en JPY) JPY 12.801	22.070	2.249	32.622
Clase de acciones "I" EUR 285.142	193.568	143.738	334.972
Clase de acciones "I" USD 5.924.303	1.449.770	5.561.269	1.812.804
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en duración) USD 195.613	5	_	195.618
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR) EUR 23.441.542	2.847.434	14.339.742	11.949.234
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) EUR 4.080	_	_	4.080
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP) GBP 12.690.882	1.122.374	13.097.280	715.976
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP) (Clase cubierta en duración)*  GBP 4.302	192	4.494	F 000 05
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) "IO"  USD 1.636.130  Clase de acciones de accimulación "IO"  CRP 65.630.340	3.626.529	0.740.000	5.262.659
Clase de acciones de acumulación "IO" GBP 65.639.210	7.100.553	9.718.288	63.021.475
Clase de acciones de acumulación "IO"  JPY 2.225.507		14.723	2.210.784
Clase de acciones de acumulación "IO"  USD 5.663.266  Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase subjerta en EUD)  3.201.762	200 047	946.652	4.948.831
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en EUR)  EUR 3.201.762	232.217	_	4.426.561
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)  GBP 520.718	1.224.799	_	1.150.301
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en JPY)  JPY 4.854.657	1.224.799 629.583	_	7.676.646
Clase de acciones "IO"  USD 2.917.861	1.224.799 629.583 2.821.989		
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "IS" (Clase cubierta en EUR) EUR 4.096.884 Clase de acciones de acumulación "IS" USD 3.282.394	1.224.799 629.583	407.824 4.096.884	3.959.412 992

		Saldo a			Saldo
Formula Made to Debt Destfella (continue of fee)	Divisa	30-nov-2020	Suscripciones	Reembolsos	30-nov-202
Emerging Markets Debt Portfolio (continuación)  Clase de acciones de acumulación "IS" (Clase cubierta en CHF)	CHF	122.199	23.150	144.350	99
Clase de acciones de acumulación "IS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	33.411.681	5.150.359	37.563.131	998.90
Clase de acciones "IS"	USD	21.967.367	2.987.487	10.798.113	14.156.74
Clase de acciones "IS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	2.951.884	236.884	3.015.030	173.73
Clase de acciones "IS" (Clase cubierta en GBP)	GBP	21.821.118	2.646.452	13.962.802	10.504.76
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IX"	USD	899.878	160.776	214.976	845.67
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	138.979	40.501	129.090	50.39
Clase de acciones "P" Clase de acciones de acumulación "R"	USD EUR	3.464 171.730	645.467 98.385	7.432 52.269	641.49 217.84
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	4.571.888	4.736.383	5.194.445	4.113.82
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF)	CHF	985.934	132.831	523.235	595.53
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en duración)*	USD	2.408	_	2.408	_
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	6.933.398	4.907.768	8.382.025	3.459.14
Clase de acciones "R"	USD	6.169.121	782.132	2.794.818	4.156.43
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	7.756.270	3.116.621	5.534.509	5.338.38
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.422.587	96.055	523.436	995.20
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) (Clase cubierta en duración)	GBP	2.130			2.13
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en SGD)	SGD USD	608.876	92.891	296.660	405.10
Clase de acciones de acumulación "RS"  Clase de acciones de acumulación "RS" (Clase cubierta en CHF)	CHF	1.365.098 1.459.908	463.123 330.847	511.430 337.901	1.316.79 1.452.85
Clase de acciones de acumulación "RS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	669.618	197.091	224.550	642.15
Clase de acciones "RS"	USD	876.501	1.229.931	145.849	1.960.58
Clase de acciones "RS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	98.288	284.992	108.269	275.0
Clase de acciones "RS" (Clase cubierta en GBP)	GBP	325.896	150.591	96.508	379.97
Total de Emerging Markets Debt Portfolio		432.034.686	85.556.576	206.838.176	310.753.08
ESG-Enhanced Emerging Markets Short Duration Bond Portfolio*					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	4.251	_	_	4.2
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	33.614	1.111	15.208	19.5
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.000	_	_	1.0
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.035	32	_	1.00
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	8.248	1.485	2.406	7.3
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	131.141	70.957	71.480	130.6
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	65.350	4.198	53.873	15.6
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP USD	1.000 104	4	_	1.0
Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.040	37	_	1.0
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	100	3.943	_	4.0
Clase de acciones "P"	USD	72.850	5.385	39.832	38.4
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.101	3.165	766	3.50
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)	GBP	103	4	_	1
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	112.335	21.881	28.601	105.6
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	146.960	40.271	77.208	110.0
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.000	_	_	1.0
Clase de acciones "R"	USD	11.460	15.950	1.479	25.9
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR GBP	1.039	37	_	1.0
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)  Total de ESG-Enhanced Emerging Markets Short Duration Bond Portfolio	GBP	1.037	39	200.052	1.0
		594.768	168.499	290.853	472.4
ESG-Enhanced Euro Short Duration Bond Plus Portfolio*	EUD	0.000.040	4 500 500	4 075 700	0.705.4
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	EUR	3.092.349	1.508.583	1.875.786	2.725.1
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación "E"	EUR EUR	19.476 595.521	2 144.167	3.404 307.164	16.0 432.5
Clase de acciones de acumulación "L"	EUR	10.036.699	8.282.911	2.160.285	16.159.3
Clase de acciones de acciminación i	EUR	2.912.892	5.684.623	2.121.908	6.475.6
Clase de acciones de acumulación "P"	EUR	3.453.251	787.426	164.313	4.076.3
Clase de acciones "P"	EUR	649.439	384.439	519.162	514.7
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	6.041.314	3.788.478	2.442.396	7.387.3
Clase de acciones "R"	EUR	1.450.681	343.870	493.403	1.301.1
Total de ESG-Enhanced Euro Short Duration Bond Plus Portfolio		28.251.622	20.924.499	10.087.821	39.088.3
ESG-Enhanced Europe High Yield Bond Portfolio*					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	EUR	2.133	3.023	72	5.0
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)	USD	1.766	366	106	2.0
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	EUR	602	9.095	65	9.6
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK)	SEK	2.092	4.315	3.250	3.1
Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)	PLN	42.889	18.531	25.479	35.9
Clase de acciones de acumulación "E"  Clase de acciones de acumulación "I"	EUR EUR	4.513 311.446	2.991 370.806	2.447 139.118	5.0 5/3.1
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)	USD	100	118.378	138.118	543.1 118.4
Clase de acciones de acumulación 1 (Clase cubierta en OSD)  Clase de acciones "I"	EUR	9.809	118.378	9.685	118.4
Clase de acciones (mensual) (Dis) "P" (Clase cubierta en USD)	USD	11.355	7	9.005	11.3
Clase de acciones de acumulación "P"	EUR	43.517	9.320	6.283	46.5
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD)	USD	31.657	_	6.631	25.0
Clase de acciones "P"	EUR	8.615	91	_	8.7
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	46.599	582	3.337	43.8
Clase de acciones "R"	EUR	16.104	1.917	10.115	7.9
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	3.498	796	1.680	2.6
		536.695	540.222	208.268	868.6

	Divisa	Saldo a 30-nov-2020	Suscripciones	Reembolsos	Saldo a 30-nov-2021
ESG-Enhanced Global Income Bond Portfolio*					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	100	544	_	644
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	100	4	_	104
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	100	3	_	103
Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	100	4	_	104
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis)	HKD AUD	775 1.412	30 55	_	805 1.467
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase cubierta en AUD)	EUR	1.412	25	_	1.027
Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR)	SGD	1.358	100	_	1.458
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en SGD)  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.000	100	_	1.45
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	85		_	8'
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.000	_		1.00
Clase de acciones (mensual) (Dis) "I"	USD	100	3	_	10
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	190.659	142.364	9.453	323.57
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	85	236.860	176.386	60.55
Clase de acciones (mensual) (Dis) "P"	USD	100	3	- 170.000	10
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	100	8.825	_	8.92
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R"	USD	100	3	_	10
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.003	30	_	1.03
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	100	1.147	_	1.24
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.000	1.147		1.00
Total de ESG-Enhanced Global Income Bond Portfolio	ODI	200.279	390.002	185.839	404.44
		200.219	390.002	100.009	404.44
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio*  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	GBP	35.466	263	24.808	10.92
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones "I"	GBP	55.193	54.406	5.183	10.92
	GBP			5.165	
Clase de acciones "P"		1.409 12.989	296	0 100	1.70
Clase de acciones de acumulación "R"  Clase de acciones "R"	GBP GBP		2.639	8.188	7.44
Total de ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio	GBP	105.621 210.678	7.992 <b>65.596</b>	40.993 <b>79.172</b>	72.62 <b>197.10</b>
Global Credit Portfolio (Hedged)		210.070	03.330	19.112	137.10
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	1.188.708	1.049.660	660.550	1.577.81
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	259.903	35.470	4.852	290.52
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK)	SEK	12.850	_		12.85
Clase de acciones "A"	USD	182.950	44.971	117.750	110.17
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	2.186.847	610.158	1.164.593	1.632.41
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en duración)	USD	13.765	25	1.104.000	13.79
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	15.626.006	25.431.433	27.089.386	13.968.05
Clase de acciones de acumulación "l" (Clase cubierta en CHF)	CHF	4.947.472	229.439	213.891	4.963.02
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	15.447.985	7.142.539	7.966.544	14.623.98
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	2.189	7.142.000	1.193	99
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EBP) (Clase cubierta en duración)*	GBP	71.926		71.926	-
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	404.960	46.342	366.557	84.74
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	11.451.793	14.333.805	6.738.325	19.047.27
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP) (Clase cubierta en duración)*	GBP	747.096	14.000.000	747.096	10.041.21
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en SEK)*	SEK	747.050	14.541.812	747.030	14.541.81
Clase de acciones "IO"	USD	10.670.653	5.723.741	3.501.197	12.893.19
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO"	USD	3.456.773	342.701	1.188.045	2.611.42
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	2.357.231	649.800	909.015	2.098.01
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en duración)	USD	3.562.359	043.000	559.625	3.002.73
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	935.272	103.607	90.725	948.15
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	372.757	103.007	228.159	144.59
Clase de acciones "P"	USD	1.062.272	974	705.530	357.71
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	40.086	846.660	95.238	791.50
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)	GBP	195.036	165.366	187.844	172.55
·				1.063.303	
Clase de acciones de acumulación "R"	USD USD	1.837.902 455.917	245.424	41.164	1.020.02
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en duración)	EUR	719.289	300.528	41.164 441.484	414.75 578.33
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)					2.260.80
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	2.551.103	396.046	290.295	
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	84.113	386.046	3.407	466.75
Clase de acciones "R"	USD	3.108.944	160.154	1.191.648	2.077.45
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	EUR	344.264	19.676	297.437	66.50
,	GBP GBP	615.621	168.860	178.616	605.86
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) (Clase cubierta en duración)  Total de Global Credit Portfolio (Hedged)	GBF	377.613 <b>85.291.655</b>	2.983 <b>72.582.174</b>	3.662 <b>56.119.057</b>	376.93 <b>101.754.77</b>
Global Fixed Income Portfolio		05.291.055	12.302.114	56.119.057	101.754.77
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	1.159.722	174.028	915.443	418.30
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	73.669	28.659	18.152	84.17
Clase de acciones "A"	USD	1.323.725	43.009	85.931	1.280.80
Clase de acciones "B"*	USD	1.323.725	43.009	119	1.200.00
Clase de acciones B "  Clase de acciones de acumulación "E"		783.299			639.29
	EUR		136.281	280.281	
Clase de acciones de acumulación "I"  Clase de acciones de acumulación "I"*	EUR	773.853	45.154	446.980	372.02
	USD	3.043.003	6.141.021	6.013.163	127.85
			281.806	1.430.735	1.894.07
Clase de acciones "I"	USD				
Clase de acciones "I" Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	1.796.997	317.802	33.996	2.080.80
Clase de acciones "I"					

	Divisa	Saldo a 30-nov-2020	Suscripciones	Reembolsos	Saldo 30-nov-202
Global Fixed Income Portfolio (continuación)					
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	392.044	56.669	293.660	155.05
Clase de acciones "R"	USD	378.178	172.522	359.174	191.52
Total de Global Fixed Income Portfolio		11.311.411	11.645.742	14.456.197	8.500.95
Global Fixed Income Portfolio (Hedged)	EUD	0.007.047	4 404 545	5 450 000	0.075.00
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	EUR	6.037.047	1.194.545 68.227	5.156.269 183.711	2.075.32 65.33
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación "E"	EUR EUR	180.819 697.173	321.740	552.645	466.26
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	15.368.364	7.534.623	10.218.481	12.684.50
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en NOK)	NOK	5.097.380	3.817.075	1.011.318	7.903.13
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)	USD	3.893.508	6.558.422	3.219.498	7.232.43
Clase de acciones "I"	EUR	15.698.369	3.215.819	3.848.955	15.065.23
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)	GBP	783	459.349	4.345	455.78
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD)	USD	18.220.995	16.352.492	1.259.568	33.313.91
Clase de acciones "IO" (Clase cubierta en USD)	USD	3.233.369	239.736	_	3.473.10
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO" (Clase cubierta en USD)	USD	4.486.726	422.891	838.643	4.070.97
Clase de acciones de acumulación "P"	EUR	2.521.537	536.993	316.994	2.741.53
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en CHF)	CHF	520.889	143.136	38.220	625.80
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD)	USD	693.796	476.939	402.397	768.33
Clase de acciones "P"	EUR	175.132	661	52.001	123.79
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)	GBP	231.824	823	51.011	181.63
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en USD)	USD	1.332.001	332.845	1.263.972	400.87
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	1.649.991	1.365.205	967.888	2.047.30
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en USD)	USD	1.519.269	692.217	649.401	1.562.08
Clase de acciones "R"	EUR	445.617	424.571	132.548	737.64
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en CHF)	CHF	503.863	1.225.600	809.216	920.24
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	7.676.565	3.718.233	3.797.648	7.597.15
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD)	USD	1.586.641	205.224	277.007	1.514.8
Global Fixed Income Portfolio (Hedged) Total		91.771.658	49.307.366	35.051.736	106.027.28
Global High Yield Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	5.227.616	702.891	2.458.009	3.472.49
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)	USD	2.829.470		593.548	2.235.92
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en SEK)	SEK	154.755	327.148	126.149	355.7
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	1.652	92		1.7
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	1.736.045	124.652	1.142.846	717.8
Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en duración)	USD	793.237	_	158.084	635.1
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	6.508.330	978.170	1.856.927	5.629.5
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)	USD	1.404.303	4.186	215.735	1.192.7
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis)	HKD	892	49	_	9.
Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en AUD)	AUD	306.346	122.856	_	429.2
Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en HKD) (Clase cubierta en duración)*	HKD	12.821	_	12.821	
Clase de acciones en otras divisas (trimestral) (Dis) (Clase cubierta en CHF) (Clase cubierta en duración)	CHF	46.850	_	_	46.8
Clase de acciones en otras divisas (trimestral) (Dis) (Clase cubierta en SGD) (Clase	SGD	119.481	_	_	119.4
cubierta en duración) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) (Clase	CHF	43.641	_	10.150	33.4
cubierta en duración)			100 710		
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (Clase	EUR EUR	2.495.838 212.109	423.743	1.158.559 17.271	1.761.0
cubierta en duración)					
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF)	CHF	173.586	10.000	87.176	96.4
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en GBP)	GBP	374.352	41.930	37.939	378.3
Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"	USD	413.044	218.379	94.702	536.7
Clase de acciones "A"	USD	2.973.542	102.228	607.611	2.468.1
Clase de acciones "B"	USD	3.817	_	_	3.8
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.435.876	60.616	482.322	1.014.1
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	891.868		244.484	647.3
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	610.683	59.317	143.267	526.7
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.359.849	56.344	184.928	1.231.2
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	365.123	_	87.211	277.9
Clase de acciones "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	6.488.907	901.465	805.758	6.584.6
Clase de acciones "G"*	USD	237.007	13.383	250.390	
Clase de acciones (mensual) (Dis) "I"	USD	40.539.709	8.214.411	15.792.597	32.961.5
Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" (Clase cubierta en EUR)		1.176	57		1.2
	EUR		7 905 477	8.502.722	13.824.8
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	14.522.088	7.805.477		40.6
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en duración)	USD USD	14.522.088 40.698	_	-	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en duración) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	USD USD EUR	14.522.088 40.698 1.936.407	14.593.530	1.013.848	15.516.0
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en duración) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	USD USD EUR GBP	14.522.088 40.698 1.936.407 11.905	_	1.013.848 11.428	4
Clase de acciones de acumulación " " (Clase cubierta en duración) Clase de acciones de acumulación " " (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación " " (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones " "	USD USD EUR GBP EUR	14.522.088 40.698 1.936.407 11.905 11.450.473	14.593.530 — —	11.428 —	4 11.450.4
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en duración) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "I" Clase de acciones "I"	USD USD EUR GBP EUR USD	14.522.088 40.698 1.936.407 11.905 11.450.473 22.764.577	14.593.530 — — — 1.980.499	11.428 — 3.375.825	11.450.4 21.369.2
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en duración) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	USD USD EUR GBP EUR USD EUR	14.522.088 40.698 1.936.407 11.905 11.450.473 22.764.577 762.357	14.593.530 — — 1.980.499 13.661	11.428 — 3.375.825 303.889	4 11.450.4 21.369.2 472.1
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en duración) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	USD USD EUR GBP EUR USD EUR GBP	14.522.088 40.698 1.936.407 11.905 11.450.473 22.764.577 762.357 186.208	14.593.530 — — — 1.980.499	11.428 — 3.375.825	4 11.450.4 21.369.2 472.1 194.7
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en duración) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	USD USD EUR GBP EUR USD EUR GBP GBP	14.522.088 40.698 1.936.407 11.905 11.450.473 22.764.577 762.357 186.208 54	14.593.530 — 1.980.499 13.661 33.660	11.428 — 3.375.825 303.889 25.133 —	4 11.450.4 21.369.2 472.1 194.7
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en duración) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (I" (Clase cubierta en GBP) (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (trimestral) (Dis) "IO" (Clase cubierta en AUD)	USD USD EUR GBP EUR USD EUR GBP GBP AUD	14.522.088 40.698 1.936.407 11.905 11.450.477 762.357 186.208 54 15.689	14.593.530 — 1.980.499 13.661 33.660 — 873	11.428 — 3.375.825 303.889 25.133 —	4 11.450.4 21.369.2 472.1 194.7
Clase de acciones de acumulación "!" (Clase cubierta en duración) Clase de acciones de acumulación "!" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "!" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (trimestral) (Dis) "IO" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones de acumulación "IO"	USD USD EUR GBP EUR USD EUR GBP GBP	14.522.088 40.698 1.936.407 11.905 11.450.473 22.764.577 762.357 186.208 54	14.593.530 — 1.980.499 13.661 33.660 — 873 346.392	11.428 — 3.375.825 303.889 25.133 —	
Clase de acciones de acumulación " " (Clase cubierta en duración) Clase de acciones de acumulación "l" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "l" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "l" Clase de acciones "l" Clase de acciones "l" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "l" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "l" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "l" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (trimestral) (Dis) "lO" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones de acumulación "lO" Clase de acciones de acumulación "lO" (Clase cubierta en EUR)	USD USD EUR GBP EUR USD EUR GBP GBP AUD	14.522.088 40.698 1.936.407 11.905 11.450.477 762.357 186.208 54 15.689	14.593.530 — 1.980.499 13.661 33.660 — 873	11.428 — 3.375.825 303.889 25.133 —	4 11.450.4 21.369.2 472.1 194.7 16.5 4.956.7 3.922.2
Clase de acciones de acumulación "!" (Clase cubierta en duración) Clase de acciones de acumulación "!" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "!" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (trimestral) (Dis) "IO" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones de acumulación "IO"	USD USD EUR GBP EUR USD EUR GBP GBP AUD USD	14.522.088 40.698 1.936.407 11.905 11.450.473 22.764.577 762.357 186.208 54 15.689 11.064.810	14.593.530 — 1.980.499 13.661 33.660 — 873 346.392	11.428 — 3.375.825 303.889 25.133 —	4 11.450.4 21.369.2 472.1 194.7 16.5 4.956.7

	Divisa	Saldo a 30-nov-2020	Suscripciones	Reembolsos	Saldo a 30-nov-2021
Global High Yield Portfolio (continuación)					
Clase de acciones "IO"	USD	4.179.305	963.867	984.969	4.158.203
Clase de acciones de acumulación "IS"	USD	7.598.340	3.493.402	3.262.973	7.828.769
Clase de acciones de acumulación "IS" (Clase cubierta en CHF)	CHF	133.470	109.110	66.120	176.46
Clase de acciones de acumulación "IS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.563.635	1.601.793	1.489.873	1.675.55
Clase de acciones de acumulación "IS" (Clase cubierta en GBP)	GBP	957	264	638	58
Clase de acciones "IS"	USD	8.289.169	3.040.978	5.799.188	5.530.95
Clase de acciones "IS" (Clase cubierta en GBP)	GBP	4.415.093	13.434.609	13.501.734	4.347.96
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	1.010	1.032.096	76.344	956.76
Clase de acciones "P"	USD	11.661	281.467	_	293.12 41.19
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en AUD)  Clase de acciones de acumulación "R"	AUD USD	31.839 2.833.446	9.351 198.365	408.110	
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF)	CHF	58.812	4.200	3.805	2.623.70 59.20
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF) (Clase cubierta en duración)	CHF	101.417	4.200	26.069	75.34
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en duración)	USD	47.779	_	23.029	24.75
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	3.461.550	857.439	1.510.018	2.808.97
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	247.512	_	7.500	240.01
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en SEK)	SEK	10.442	1.150	_	11.59
Clase de acciones "R"	USD	1.911.055	585.727	291.808	2.204.97
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en CHF)	CHF	793.140	25.379	160.457	658.06
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en duración)	USD	730.852	10.425	92.121	649.15
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	896.066	124.293	287.769	732.59
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.796.476	329.353	673.691	1.452.13
Total de Global High Yield Portfolio		238.212.866	72.719.793	78.630.805	232.301.85
Global Sovereign Bond Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	2.665	31	_	2.69
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	977	1	172	80
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	28.188	19.379	28.188	19.37
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	754.063	1.011.684	307.628	1.458.11
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	2.743.669	9.498	664.491	2.088.67
Clase de acciones "I"	USD	213	122	_	33
Clase de acciones "I" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	99	92.210	4 000 470	92.30
Total de Global Sovereign Bond Portfolio		3.529.874	1.132.925	1.000.479	3.662.32
Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio	HOD	0.044	0.47		10.50
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	9.914	647	_	10.56
Clase de acciones (trimestral) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	127	4	_	13
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	12.853	6	_	12.85
Clase de acciones en otras divisas (trimestral) (Dis) (Clase cubierta en EUR)	EUR	90	696	32	75
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	210	1.369		1.57
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "A"	USD EUR	9.422 4.609	2.849	3.190	9.08
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	100	13.970	387 462	4.22 13.60
	EUR	19.431	1.813	5.215	16.02
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	GBP	76	1.013	5.215	7
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	100	_	_	10
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	342.559	300.862	151.663	491.75
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	78.821	30.166	32.733	76.25
Clase de acciones de acumulación i (Clase cubierta en EOR)	USD	25.330	30.100	32.733	25.33
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO"*	USD	120.556	22.836	143.392	25.55
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "P"	USD	108.023	8.088	62.007	54.10
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	504.695	73.652	108.271	470.07
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	15.075	75.052	6.915	8.16
Clase de acciones "P"	USD	22.705	365	5.374	17.69
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	27	1	5.574	2
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)	GBP	44.435	1.659	_	46.09
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "R"	USD	9.171	1.797	1.994	8.97
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	50.090	61.556	8.021	103.62
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	24		- 0.02	2
Clase de acciones "R"	USD	22.652	936	2.965	20.62
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	5.168	17	1.545	3.64
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	238	30	128	14
Total de Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio		1.406.501	523.323	534.294	1.395.53
US Dollar Short Duration Bond Portfolio					
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	1.803.984	2.202.773	1.495.451	2.511.30
Clase de acciones "I"	USD	208.302	62.778	39.119	231.96
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	555.322	314.567	229.532	640.35
Clase de acciones "P"	USD	71.815	122.643	38.281	156.17
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	270.671	129.761	119.655	280.77
Clase de acciones "R"	USD	139.366	57.621	49.569	147.41
Total de US Dollar Short Duration Bond Portfolio		3.049.460	2.890.143	1.971.607	3.967.99
US Fixed Income Portfolio	USD	123.821	10.993	342	134.47
US Fixed Income Portfolio  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	030				
	USD	1.143	9	_	1.15
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia			9 97.783	33.492	
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	1.143		33.492 8.076	237.25
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD USD	1.143 172.964	97.783		237.25 70.80
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"	USD USD USD	1.143 172.964 53.539	97.783 25.338	8.076	1.15 237.25 70.80 44.19 1.02

	Divisa	Saldo a 30-nov-2020	Suscripciones	Reembolsos	Saldo a 30-nov-2021
US Fixed Income Portfolio (continuación)					
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	4.419.444	8.566.363	4.182.220	8.803.587
Clase de acciones "I"	USD	298.691	9.973.284	9.978.342	293.633
Clase de acciones (mensual) (Dis) "P"	USD	1.196	16		1.212
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	2.327.193	591.037	562.980	2.355.250
Clase de acciones "P"	USD	26.669	741	26.669	741
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	324.046	109.393	274.311	159.128
Clase de acciones "R"	USD	52.388	27.321	7.129	72.580
Total de US Fixed Income Portfolio		8.190.130	19.467.458	15.310.209	12.347.379
US Mortgage Backed Securities Portfolio  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	134.038	11.506	54.625	90.919
Clase de acciones de acuminación denominada en la divisa de referencia	USD	423.697	28.392	99.316	352.773
Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)	PLN	332.749	20.552	49.407	283.342
Clase de acciones "A"	USD	314.438	50.788	66.564	298.662
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	575.557	33.255	398.049	210.763
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	10.647.203	1.306.817	4.315.791	7.638.229
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.594.459	421.301	1.215.677	800.083
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	5.218	_	_	5.218
Clase de acciones "I"	USD	1.225.400	_	_	1.225.400
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IO"	USD	19.874.298	1.038.851	6.300.686	14.612.463
Clase de acciones "IO"	USD	2.297.064	1.447.288	899.522	2.844.830
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	996.479	306.190	185.581	1.117.088
Clase de acciones "P"	USD	40.052	408	12.409	28.051
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	478.184	123.851	368.697	233.338
Clase de acciones "R"	USD	83.973	30.472	80.568	33.877
Total de US Mortgage Backed Securities Portfolio		39.022.809	4.799.119	14.046.892	29.775.036
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	4.288	5.878	2.407	7.759
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) denominada en la divisa de referencia	USD	50.573	661	17.420	33.814
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	26.491	2.948	14.538	14.901
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	158	2	_	160
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	104	1	_	105
Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Cap) (Clase parcialmente cubierta en AUD)	AUD	19.160	979	8.704	11.435
Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Cap) (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	5.012	2.280	753	6.539
Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Cap) (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	14.407	2.075	5.098	11.384
Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Cap) (Clase parcialmente cubierta en SGD)	SGD	141.369	6.914	54.009	94.274
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis)	HKD	816	25	_	841
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase parcialmente cubierta en AUD)	AUD	1.664	50	_	1.714
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	1.110	33	_	1.143
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase parcialmente cubierta en SGD)	SGD	39.878	3.987	11.644	32.221
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	421	_	136	285
Clase de acciones "E"	EUR	311	29	_	340
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	727	46	252	521
Clase de acciones "I"	USD	105	3	_	108
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	100	_	_	100
Clase de acciones "P"	USD	104	2	_	106
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	100	_	_	100
Clase de acciones "R"	USD	105	2		107
Total de Emerging Markets Multi-Asset Portfolio		307.003	25.915	114.961	217.957
ESG-Enhanced Global Multi-Asset Balanced Portfolio*					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	86.853	50.281	30.394	106.740
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	3.578	2.548	499	5.627
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	58.722	77.717	38.432	98.007
Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	26.422	12.604	13.991	25.035
Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	49.673	2.086	11.822	39.937
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	43.934	27.087	11.256	59.765
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	149.084	10.755	94.999	64.840
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	2.100	1.684	_	3.784
Clase de acciones "I"	USD	6.555	2.032	_	8.587
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	100	1.563	_	1.663
Clase de acciones "R" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	269.091	140.376	51.254	358.213
Total de ESG-Enhanced Global Multi-Asset Balanced Portfolio		696.112	328.733	252.647	772.198
Global Multi-Asset Conservative Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	64.686	83.954	31.686	116.954
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	2.095	5.116	1.943	5.268
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	62.664	113.905	51.895	124.674
Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	4.893	570	4.608	855
Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en GBP)	ODD	21.070	2.252	12.532	10.790
	GBP		00 047	17.975	123.409
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	60.537	80.847		
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase parcialmente cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I"		60.537 2.477.818	283.687	449.373	2.312.132
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase parcialmente cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR				
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase parcialmente cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I"	EUR USD	2.477.818	283.687	449.373	3.585
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase parcialmente cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR USD EUR	2.477.818 13.396	283.687 1.288	449.373 11.099	3.585 397.643
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase parcialmente cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	EUR USD EUR GBP	2.477.818 13.396 452.321	283.687 1.288 392	449.373 11.099	3.585 397.643 112
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase parcialmente cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en GBP) Clase de acciones "I"	EUR USD EUR GBP USD	2.477.818 13.396 452.321 110	283.687 1.288 392	449.373 11.099 55.070	2.312.132 3.585 397.643 112 1.356 239.612

	Divisa	Saldo a	Suscripciones	Reembolsos	Saldo a 30-nov-2021
Global Multi-Asset Growth Portfolio	Divisa	30-1104-2020	ouscripciones	Recilibolada	30-1104-2021
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	47.929	7.464	21.223	34.170
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	1.984	295	164	2.115
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	6.419	11.563	4.402	13.580
Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	3.400	_	1.845	1.555
Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	11.265	_	3.048	8.217
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	11.075	2.193	5.714	7.554
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	1.220.178	162.153	257.714	1.124.617
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en EUR) Clase de acciones "I"	EUR	100 107	_	_	100 107
Clase de acciones 1  Clase de acciones de acumulación "R" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	USD EUR	100	_	_	107
Clase de acciones "R" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	68.599	48.619	18.158	99.060
Total de Global Multi-Asset Growth Portfolio	ODI	1.371.156	232.287	312.268	1.291.175
Global Multi-Asset Income Portfolio		1.57 1.150	232.207	312.200	1.231.173
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	6.643	17.372	13.410	10.605
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) denominada en la divisa de referencia	USD	295.446	525.661	86.102	735.005
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	322.711	2.310.406	634.449	1.998.668
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	34.395	34.377	15.594	53.178
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis)	HKD	216.737	16.276.353	3.230.639	13.262.451
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase cubierta en AUD)	AUD	17.439	780.808	124.682	673.565
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR)	EUR	282	396	_	678
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en SGD)*	SGD	_	4.552	2.224	2.328
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	351	_	_	351
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	12.203	2.232	1.993	12.442
Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"	USD	15.775	8.731	4.305	20.201
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	7.907	58.681	3.746	62.842
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	55.969	31.839	10.260	77.548
Clase de acciones (estable mensual) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	2.028	38.559	2.816	37.771
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	32.254	9.197	7.804	33.647
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	14.616	660	1.454	13.822
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	11.699	685	2.858	9.526
Clase de acciones "I"	USD	473	4	40	437
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	100	_	_	100
Clase de acciones "P"	USD	119	3		122
Clase de acciones "R" (bruta mensual) (Dis) (Clase cubierta en GBP)	GBP	78.883	5.322	8.854	75.351
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	79		_	79
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	97	11	-	108
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.011	255	354	912
Total de Global Multi-Asset Income Portfolio		1.127.217	20.106.104	4.151.584	17.081.737
US Real Estate Balanced Portfolio  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	167.447	38.445	20.113	185.779
Clase de acciones (Cap) (bruta mensual MBS) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	119	51	20.113	170
Clase de acciones (mensual MBS) (Dis) (Cap) denominada en la divisa de referencia	USD	131.569	6.308	7.613	130.264
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	124	1.162	1.160	126
Clase de acciones en otras divisas (Cap) (bruta mensual MBS) (Dis) (Clase cubierta en SGD)	SGD	1.666	51		1.717
Clase de acciones en otras divisas (Cap) (mensual MBS) (Dis) (Clase cubierta en SGD)	SGD	16.777	4.826	1.940	19.663
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	8.086	3.504	3.444	8.146
Clase de acciones (mensual MBS) (Dis) (Cap) "I"	USD	140.750	31.740	33.584	138.906
Clase de acciones (mensual) (Dis) "I"	USD	8.200	416	_	8.616
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	82.954	15.331	20.213	78.072
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	109.636	6.083	3.032	112.687
Clase de acciones (mensual MBS) (Dis) (Cap) "P"	USD	259.301	1.670	59.425	201.546
Clase de acciones (mensual) (Dis) "P"	USD	123	3	_	126
Clase de acciones de acumulación "P"		.20	-		
Clase de acciones (mensual MBS) (Dis) (Cap) "R"	USD	218.309	6.312	32.624	191.997
Class de assignes (monsual) (Dis) "P"	USD		6.312 949	_	5.351
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R"	USD GBP	218.309 4.402 117	6.312 949 3	4	5.351 116
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP)	USD GBP GBP	218.309 4.402 117 5.084	6.312 949 3 573	4 2.029	5.351 116 3.628
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R"	USD GBP GBP USD	218.309 4.402 117 5.084 121.984	6.312 949 3 573 22.096	2.029 24.787	5.351 116 3.628 119.293
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones "R"	USD GBP GBP	218.309 4.402 117 5.084 121.984 45.530	6.312 949 3 573 22.096 16.050	2.029 24.787 19.626	5.351 116 3.628 119.293 41.954
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones "R" Total de US Real Estate Balanced Portfolio	USD GBP GBP USD	218.309 4.402 117 5.084 121.984	6.312 949 3 573 22.096	2.029 24.787	5.351 116 3.628 119.293
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones "R" Total de US Real Estate Balanced Portfolio Emerging Markets Total Return Bond Portfolio	USD GBP GBP USD USD	218.309 4.402 117 5.084 121.984 45.530 1.322.178	6.312 949 3 573 22.096 16.050	2.029 24.787 19.626	5.351 116 3.628 119.293 41.954 1.248.157
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones "R" Total de US Real Estate Balanced Portfolio Emerging Markets Total Return Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD GBP GBP USD USD	218.309 4.402 117 5.084 121.984 45.530 1.322.178	6.312 949 3 573 22.096 16.050 155.573	2.029 24.787 19.626	5.351 116 3.628 119.293 41.954 1.248.157
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones "R" Total de US Real Estate Balanced Portfolio Emerging Markets Total Return Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD GBP GBP USD USD	218.309 4.402 117 5.084 121.984 45.530 1.322.178	6.312 949 3 573 22.096 16.050	2.029 24.787 19.626 229.594	5.351 116 3.628 119.293 41.954 <b>1.248.157</b> 13.776 112
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones "R" Total de US Real Estate Balanced Portfolio  Emerging Markets Total Return Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	USD GBP GBP USD USD	218.309 4.402 117 5.084 121.984 45.530 1.322.178 9.331 109 200	6.312 949 3 573 22.096 16.050 155.573 4.445 3	2.029 24.787 19.626 229.594	5.351 116 3.628 119.293 41.954 <b>1.248.157</b> 13.776 112 200
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones "R" Total de US Real Estate Balanced Portfolio Emerging Markets Total Return Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	USD GBP GBP USD USD USD USD EUR EUR	218.309 4.402 117 5.084 121.984 45.530 1.322.178	6.312 949 3 573 22.096 16.050 155.573	2.029 24.787 19.626 229.594	5.351 116 3.628 119.293 41.954 <b>1.248.157</b> 13.776 112 200
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones "R" Total de US Real Estate Balanced Portfolio  Emerging Markets Total Return Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	USD GBP GBP USD USD	218.309 4.402 117 5.084 45.530 1.322.178 9.331 109 200 220	6.312 949 3 573 22.096 16.050 155.573 4.445 3	2.029 24.787 19.626 229.594	5.351 116 3.628 119.293 41.954 1.248.157 13.776 112 200 225
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones "R" Total de US Real Estate Balanced Portfolio  Emerging Markets Total Return Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I"	USD GBP GBP USD USD USD EUR EUR EUR USD	218.309 4.402 117 5.084 121.984 45.530 1.322.178 9.331 109 200 220 200 83.000	6.312 949 3 573 22.096 16.050 155.573 4.445 3 — 5	4 2.029 24.787 19.626 229.594	5.351 116 3.628 119.293 41.954 <b>1.248.157</b> 13.776 112 200 225 200 60.726
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones "R" Total de US Real Estate Balanced Portfolio Emerging Markets Total Return Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en ortras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	USD GBP GBP USD USD USD USD EUR EUR EUR	218.309 4.402 117 5.084 121.984 45.530 1.322.178 9.331 109 200 220 220	6.312 949 3 573 22.096 16.050 155.573 4.445 3 — 5	4 2.029 24.787 19.626 229.594	5.351 116 3.628 119.293 41.954 1.248.157 13.776 112 200 225 200 60.726 106
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones "R" Total de US Real Estate Balanced Portfolio  Emerging Markets Total Return Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación de de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	USD GBP GBP USD USD USD EUR EUR EUR USD EUR	218.309 4.402 117 5.084 121.984 45.530 1.322.178 9.331 109 200 220 200 83.000 106	6.312 949 3 573 22.096 16.050 155.573 4.445 3 — 5 — 6.670	20.29 24.787 19.626 229.594	5.351 116 3.628 119.293 41.954 1.248.157 13.776 112 200 60.726 106 102
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones "R" Total de US Real Estate Balanced Portfolio Emerging Markets Total Return Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en ortras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	USD GBP GBP USD USD USD EUR EUR EUR EUR USD EUR	218.309 4.402 117 5.084 121.984 45.530 1.322.178 9.331 109 200 220 200 83.000 106 100	6.312 949 3 573 22.096 16.050 155.573 4.445 3 — 5 — 6.670	4 2.029 24.787 19.626 229.594 ————————————————————————————————————	5.351 116 3.628 119.293 41.954 11.248.157 13.776 112 200 60.726 106 102 1.350
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones "R" Total de US Real Estate Balanced Portfolio Emerging Markets Total Return Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	USD GBP USD USD USD USD EUR EUR EUR USD EUR USD EUR	218.309 4.402 117 5.084 121.984 45.530 1.322.178 9.331 109 200 220 200 83.000 106 100 1.350	6.312 949 3 573 22.096 16.050 155.573 4.445 3 — 5 — 6.670	4 2.029 24.787 19.626 229.594 ————————————————————————————————————	5.351 116 3.628 119.293 41.954 11.248.157 13.776 112 200 225 200 60.726 106 102 1.350
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" Total de US Real Estate Balanced Portfolio  Emerging Markets Total Return Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)	USD GBP USD USD USD USD USD EUR EUR EUR USD EUR OSD EUR OSD EUR OSD EUR OSD EUR OSD	218.309 4.402 117 5.084 121.984 45.530 1.322.178 9.331 109 200 220 200 0 33.000 106 100 1.350	6.312 949 3 573 22.096 16.050 155.573 4.445 3 — 5 6.670 — 2	20.29 24.787 19.626 229.594 ————————————————————————————————————	5.351 116 3.628 119.293 41.954 1.248.157 13.776 112 200 60.726 106 102
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones (R" Total de US Real Estate Balanced Portfolio  Emerging Markets Total Return Bond Portfolio  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	USD GBP USD USD USD USD EUR EUR EUR USD EUR EUR USD EUR EUR USD EUR	218.309 4.402 117 5.084 121.984 45.530 1.322.178 9.331 109 200 220 200 00 106 100 1.350 1.050.000	6.312 949 3 573 22.096 16.050 155.573 4.445 3 — 5 6.670 — 2	20.29 24.787 19.626 229.594 ————————————————————————————————————	5.351 116 3.628 119.293 41.954 1.248.157 13.776 112 200 225 200 60.726 106 102 1.350.000
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones "R" Total de US Real Estate Balanced Portfolio Emerging Markets Total Return Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de no de la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)	USD GBP GBP USD USD USD USD EUR EUR EUR USD AUD GBP EUR GBP	218.309 4.402 117 5.084 121.984 45.530 1.322.178 9.331 109 200 220 200 83.000 106 100 1.350 1.050.000 200 500	6.312 949 3 573 22.096 16.050 155.573 4.445 3 — 5 — 6.670 — 2 —	28.944 28.99 24.787 19.626 229.594	5.351 116 3.628 119.293 41.954 1.248.157 13.776 112 200 60.726 106 102 1.350 1.050.000 200 500

	Divisa	Saldo a 30-nov-2020	Suscripciones	Reembolsos	Saldo 30-nov-202
Global Absolute Return Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	558	_	_	55
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	101	_	_	10
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.000	237	52	1.18
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK)	SEK	8.171	290	2	8.45
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	21	519	_	54
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	193.166	1.577	76.687	118.05
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	319.771	148.955	67.787	400.93
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	6.392	671	2.822	4.24
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en JPY)	JPY	625.237	_	_	625.23
Clase de acciones "I"	USD	100	_	_	10
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	76	_	_	7
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	599	_	99	50
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	127.830		26.240	101.59
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)*	GBP		1.564.854		1.564.85
Clase de acciones "IO"	USD	799.208	458.784	1.257.973	1
Clase de acciones de acumulación "P"*	USD	100	_	100	-
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)*	EUR	56	_	56	-
Clase de acciones "P"*	USD	102	_	102	-
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	3.123	_	3.052	7
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	73			7
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	13.413	972	4.881	9.50
Total de Global Absolute Return Portfolio		2.099.097	2.176.859	1.439.853	2.836.10
Global Dynamic Bond Portfolio*					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	918	5.907	_	6.82
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.709	417	171	1.05
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	796	417 74	125	1.95 74
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.400	23	771	65
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en GBP)	GBP	576	_		57
Clase de acciones "A"	USD	5.998	30	1.444	4.58
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	5.845	8.118	5.306	8.65
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	100	0.110	0.000	10
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD)*	AUD	_	131	_	13
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	26.988	29.490	50.464	6.0
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	797	15	- 00.404	81
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)	GBP	3.336.030	620	171	3.336.47
Clase de acciones "IO" (Clase cubierta en AUD)	AUD	232.348	8.340	1.029	239.65
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	100	7	7	10
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	4.408	331	1.845	2.89
Clase de acciones "R"	USD	1.187	10	488	70
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1.131	18	_	1.14
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1.129	18	_	1.14
Total de Global Dynamic Bond Portfolio		3.621.460	53.549	61.821	3.613.18
Global Dynamic Bond Plus Portfolio*					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	203.325	1.855	25.838	179.3
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	8.688	_	894	7.7
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	208.146	11.807	58.755	161.1
Clase de acciones en otras divisas (trimestral) (Dis) (Clase cubierta en SGD)	SGD	14.905	2.056	14.983	1.9
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF)	CHF	18.597	4.167	7.157	15.6
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	99.281	3.162	23.747	
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK)	EUR SEK				78.6 50.1
		99.281	3.162	23.747	78.6
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK)	SEK	99.281 68.092	3.162 3.219	23.747	78.6 50.1
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF)	SEK CHF	99.281 68.092 1.209	3.162 3.219 35	23.747 21.112 —	78.6 50.1 1.2
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	SEK CHF EUR	99.281 68.092 1.209 236.970	3.162 3.219 35 3.405	23.747 21.112 — 72.554	78.6 50.1 1.2 167.8
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en GBP)	SEK CHF EUR GBP	99.281 68.092 1.209 236.970 3.571	3.162 3.219 35 3.405 18	23.747 21.112 — 72.554 602	78.6 50.1 1.2 167.8 2.9
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"	SEK CHF EUR GBP USD	99.281 68.092 1.209 236.970 3.571 21.065	3.162 3.219 35 3.405 18 132	23.747 21.112 — 72.554 602 4.601	78.6 50.1 1.2 167.8 2.9 16.5
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" Clase de acciones ("A" Clase de acciones ("A" Clase de acciones ("A"	SEK CHF EUR GBP USD USD EUR	99.281 68.092 1.209 236.970 3.571 21.065 87.127 129.553	3.162 3.219 35 3.405 18 132 695	23.747 21.112 — 72.554 602 4.601 20.400 43.474	78.6 50.1 1.2 167.8 2.9 16.5 67.4 87.5
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" Clase de acciones "A" Clase de acciones trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	SEK CHF EUR GBP USD USD	99.281 68.092 1.209 236.970 3.571 21.065 87.127	3.162 3.219 35 3.405 18 132 695 1.511	23.747 21.112 — 72.554 602 4.601 20.400 43.474 40.811	78.6 50.1 1.2 167.8 2.9 16.5 67.4 87.5
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" Clase de acciones ("A" Clase de acciones ("A" Clase de acciones ("A"	SEK CHF EUR GBP USD USD EUR EUR	99.281 68.092 1.209 236.970 3.571 21.065 87.127 129.553	3.162 3.219 35 3.405 18 132 695 1.511 4.323	23.747 21.112 — 72.554 602 4.601 20.400 43.474	78.6 50.1 1.2 167.8 2.9 16.5 67.4 87.5 99.7
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en BP) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" Clase de acciones "A" Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "G" (Clase cubierta en BP)*	SEK CHF EUR GBP USD USD EUR EUR GBP	99.281 68.092 1.209 236.970 3.571 21.065 87.127 129.553 136.203	3.162 3.219 35 3.405 18 132 695 1.511 4.323	23.747 21.112 — 72.554 602 4.601 20.400 43.474 40.811	78.6 50.1 1.2 167.8 2.9 16.5 67.4 87.5 99.7
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" Clase de acciones ("A" Clase de acciones "A" Clase de acciones "A" Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP)* Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" (Clase cubierta en GBP)	SEK CHF EUR GBP USD USD EUR EUR GBP GBP	99.281 68.092 1.209 236.970 3.571 21.065 87.127 129.553 136.203 — 2.000.119	3.162 3.219 35 3.405 18 132 695 1.511 4.323 3.800	23.747 21.112 ————————————————————————————————	78.6 50.1 1.2 167.8 2.9 16.5 67.4 87.5 99.7 2.000.1
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" Clase de acciones "A" Clase de acciones "A" Clase de acciones "Cimiestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP)" Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (semestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en JPY)	SEK CHF EUR GBP USD USD EUR EUR GBP GBP JPY	99.281 68.092 1.209 236.970 3.571 21.065 87.127 129.553 136.203 — 2.000.119	3.162 3.219 35 3.405 18 132 695 1.511 4.323 3.800	23.747 21.112 — 72.554 602 4.601 20.400 43.474 40.811 3.800	78.6 50.1 1.2 167.8 2.9 16.5 67.4 87.5 99.7 2.000.1 48.0 599.9
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en BBP) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" Clase de acciones "A" Clase de acciones trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP)* Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" (Clase cubierta en JPY) Clase de acciones de acumulación "I"*	SEK CHF EUR GBP USD USD EUR EUR GBP GBP JPY JPY	99.281 68.092 1.209 236.970 3.571 21.065 87.127 129.553 136.203 — 2.000.119 48.063	3.162 3.219 35 3.405 18 132 695 1.511 4.323 3.800 — 599.950	23.747 21.112 ————————————————————————————————	78.6 50.1 1.2 167.8 2.9 16.5 67.4 87.5 99.7 2.000.1 48.0 599.9
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en BP) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" Clase de acciones "A" Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP)* Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" (Clase cubierta en GP) Clase de acciones (semestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en JPY) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I"	SEK CHF EUR GBP USD USD EUR GBP GBP JPY JPY USD	99.281 68.092 1.209 236.970 3.571 21.065 87.127 129.553 136.203 — 2.000.119 48.063 — 330.123	3.162 3.219 35 3.405 18 132 695 1.511 4.323 3.800 — 599.950	23.747 21.112 — 72.554 602 4.601 10.400 43.474 40.811 3.800 — — — — 214.381	78.6 50.1 1.2 167.8 2.9 16.5 67.4 87.5 99.7 2.000.1 48.0 599.9 407.7 29.0
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" Clase de acciones (mensual) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP)" Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (semestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en JPY) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF)	SEK CHF EUR GBP USD USD EUR GBP JPY JPY USD CHF	99.281 68.092 1.209 236.970 3.571 21.065 87.127 129.553 136.203 2.000.119 48.063 — 330.123 35.874	3.162 3.219 315 3.405 18 132 695 1.511 4.323 3.800 — — 599.950 291.983	23.747 21.112 72.554 602 4.601 20.400 43.474 40.811 3.800 — — — 214.381 6.834	78.6 50.1.1.2 167.8 2.9 16.5 67.4 87.5 99.7 2.000.1 48.0 599.9 407.7 29.0 1.476.2
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" Clase de acciones (mensual) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones ("Clase cubierta en GBP)" Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (semestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en JPY) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	SEK CHF EUR GBP USD USD EUR GBP GBP JPY JPY USD CHF EUR	99.281 68.092 1.209 236.970 3.571 21.065 87.127 129.553 136.203 — 2.000.119 48.063 — 330.123 35.874 1.854.486 896.267	3.162 3.219 35 3.405 18 132 695 1.511 4.323 3.800 —— 599.950 291.983 —— 11.602	23.747 21.112 72.554 602 4.601 20.400 43.474 40.811 3.800 — — — 214.381 6.834 389.828 29.628	78.6 50.1 1.2 167.8 2.9 16.5 67.4 87.5 99.7 2.000.1 48.0 599.9 407.7 29.00 1.476.2 866.8
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP)* Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (semestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en JPY) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en JPY)	SEK CHF EUR GBP USD USD EUR EUR GBP JPY USD CHF EUR GBP JPY USD	99.281 68.092 1.209 236.970 3.571 21.065 87.127 129.553 136.203 — 2.000.119 48.063 35.874 1.854.486 896.267 911.482	3.162 3.219 35 3.405 18 132 695 1.511 4.323 3.800 —— 599.950 291.983 —— 11.602	23.747 21.112 72.554 602 4.601 20.400 43.474 40.811 3.800 — — 214.381 6.834 389.828	78.6 50.1 1.2 167.8 2.9 16.5 67.4 87.5 99.7 2.000.1 48.0 599.9 407.7 29.0 1.476.2 866.8 460.7
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" Clase de acciones "A" Clase de acciones trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP)* Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (semestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en JPY) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	SEK CHF EUR GBP USD USD EUR EUR GBP JPY JPY USD CHF EUR GBP JPY SEK	99.281 68.092 1.209 236.970 3.571 21.065 87.127 129.553 136.203 2.000.119 48.063 — 330.123 35.874 1.854.486 896.267 911.482	3.162 3.219 35 3.405 18 132 695 1.511 4.323 3.800 — — 599.950 291.983 — 11.602 176	23.747 21.112 72.554 602 4.601 20.400 43.474 40.811 3.800 — — — 214.381 6.834 389.828 29.628	78.6 50.1 1.2 167.8 2.9 16.5 67.4 87.5 99.7 2.000.1 48.0 599.9 407.7 29.0 1.476.2 866.8 460.7 2.5
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" Clase de acciones ("A" Clase de acciones ("A" Clase de acciones ("A" Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (semestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en JPY) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	SEK CHF EUR GBP USD USD EUR GBP GBP JPY USD CHF EUR GBP JPY SEK EUR	99.281 68.092 1.209 236.970 3.571 21.065 87.127 129.553 136.203 — 2.000.119 48.063 330.123 35.874 1.854.486 896.267 911.482 2.503 5.856	3.162 3.219 35 3.405 18 132 695 1.511 4.323 3.800 — 599.950 291.983 — 11.602 — 176 — —	23.747 21.112 — 72.554 602 4.601 20.400 43.474 40.811 3.800 — — 214.381 6.834 389.828 29.628 450.752 —	78.6 50.1 1.2 167.8 2.9 16.5 67.4 87.5 99.7 2.000.1 48.0 599.9 407.7 29.0 1.476.2 866.8 460.7 2.5 5.5 2.5
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" Clase de acciones (A" Clase de acciones (A" Clase de acciones (A" Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP)* Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (semestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en JPY) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones "I"	SEK CHF EUR GBP USD USD EUR EUR GBP JPY JPY USD CHF EUR GBP JPY SEK EUR USD	99.281 68.092 1.209 236.970 3.571 21.065 87.127 129.553 136.203 — 2.000.119 48.063 330.123 35.874 1.854.486 896.267 911.482 2.503 5.856 46.629	3.162 3.219 35 3.405 18 132 695 1.511 4.323 3.800 — — 599.950 291.983 — 11.602 176 — — 9.800	23.747 21.112 72.554 602 4.601 20.400 43.474 40.811 3.800 ———————————————————————————————————	78.6 50.1 1.2.2 167.8 2.9 16.5 67.4 87.5 99.7 2.000.1 48.0 599.9 407.7 29.0 1.476.2 866.8 460.7 2.5 5.2 2.4 44.4
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" Clase de acciones ("Ensual") (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones ("Irimestral") (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (semestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en JPY) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" Clase cubierta en AUD)	SEK CHF EUR GBP USD USD EUR GBP JPY JPY USD CHF EUR GBP JPY SEK EUR USD	99.281 68.092 1.209 236.970 3.571 21.065 87.127 129.553 136.203 2.000.119 48.063 —2 330.123 35.874 1.854.486 896.267 911.482 2.503 5.856 46.629 1.464	3.162 3.219 3.405 3.405 18 132 695 1.511 4.323 3.800 — — 599.950 291.983 — 11.602 176 — — 9.800 50	23.747 21.112 72.554 602 4.601 20.400 43.474 40.811 3.800 ———————————————————————————————————	78.6 50.1 1.2 167.8 2.9 16.5 67.4 87.5 99.7 2.000.1 48.0 599.9 407.7 29.0 1.476.2 866.8 460.7 5.5 5.2 44.4
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" Clase de acciones (mensual) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP)* Clase de acciones (semestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en GPP) Clase de acciones (semestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en JPY) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en BPP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SPP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SPP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" Clase cubierta en AUD) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	SEK CHF EUR GBP USD USD EUR GBP GBP JPY USD CHF EUR GBP JPY USD CHF EUR GBP JPY USD AUD EUR	99.281 68.092 1.209 236.970 3.571 21.065 87.127 129.553 136.203 — 2.000.119 48.063 330.123 35.874 1.854.486 896.267 911.482 2.503 5.856 46.629 1.464 15.956	3.162 3.219 35 3.405 18 132 695 1.511 4.323 3.800 — 599.950 291.983 — 11.602 — 11.602 — 9.800 50 2.500	23.747 21.112	78.6 50.1 1.2.2 167.8 2.9 16.5 67.4 87.5 99.7 2.000.1 48.0 599.9 407.7 29.0 1.476.2 866.8 460.7 2.5 5.5 2.4 44.4 1.5 6.1
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" Clase de acciones (Trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP)* Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (semestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en JPY) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en BP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	SEK CHF EUR GBP USD USD EUR EUR GBP JPY JPY JPY SEK EUR GBP USD AUD EUR	99.281 68.092 1.209 236.970 3.571 21.065 87.127 129.553 136.203 — 2.000.119 48.063 330.123 35.874 1.854.486 896.267 911.482 2.503 5.856 46.629 1.464 15.956 5.301	3.162 3.219 35 3.405 18 132 695 1.511 4.323 3.800 — 599.950 291.983 — 11.602 176 — 9.800 50 2.500 20.326	23.747 21.112 72.554 602 4.601 20.400 43.474 40.811 3.800 ———————————————————————————————————	78.6 50.1 1.2.2 167.8 2.9 16.5 67.4 87.5 99.7 2.000.1 48.0 599.9 407.7 29.0 1.476.2 866.8 460.7 2.5 5.2 44.4 1.5 6.1
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (mensual) (Dis) "A" Clase de acciones (firmestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP)" Clase de acciones (semestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones (semestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en JPY) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	SEK CHF EUR GBP USD USD EUR GBP GBP JPY USD CHF EUR GBP JPY USD CHF EUR GBP JPY USD AUD EUR	99.281 68.092 1.209 236.970 3.571 21.065 87.127 129.553 136.203 — 2.000.119 48.063 330.123 35.874 1.854.486 896.267 911.482 2.503 5.856 46.629 1.464 15.956	3.162 3.219 35 3.405 18 132 695 1.511 4.323 3.800 — 599.950 291.983 — 11.602 — 11.602 — 9.800 50 2.500	23.747 21.112	78.6 50.1 1.2.2 167.8 2.9 16.5 67.4 87.5 99.7 2.000.1 48.0 599.9 407.7 29.0 1.476.2 866.8 460.7 25.5 5.2 44.4 1.5 6.1

	Divisa	Saldo a 30-nov-2020	Suscripciones	Reembolsos	Saldo a 30-nov-2021
Global Dynamic Bond Plus Portfolio* (continuación)			· ·		
Clase de acciones "IS" (Clase cubierta en GBP)	GBP	122	4	_	126
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO"	USD	2.375.581	356.308	614.617	2.117.272
Clase de acciones (mensual) (Dis) "P"	USD	4.789	2.601	_	7.390
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	88.176	20.130	5.181	103.125
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	48.523	_	8.693	39.830
Clase de acciones "P"	USD	31.696	570	15.181	17.085
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	96	4	_	100
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)	GBP	30.234	904	3.769	27.369
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R"	USD	4.852	_	_	4.852
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	171.896	117.531	93.089	196.338
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF)	CHF	781			781
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	69.421	12.354	44.085	37.690
Clase de acciones "R"	USD	41.403	9.732	7.493	43.642
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	76.131	16	22.808	53.339
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	35.569	4.854	24.425	15.998
Total de Global Dynamic Bond Plus Portfolio		11.736.677	1.996.677	2.314.742	11.418.612
Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	EUR	260.084	74.479	100.623	233.940
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)	USD	178.788	707.266	26.531	859.523
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	EUR	145.344	11.242	42.717	113.869
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)	USD	218.714	9.649	161.838	66.525
Clase de acciones "A"	EUR	155.215	119.291	31.361	243.145
Clase de acciones "A" (Clase cubierta en USD)	USD	562.901	17.817	20.695	560.023
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	86.809	149.678	74.921	161.566
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	16.688.834	10.725.362	4.771.687	22.642.509
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD)*	AUD	_	14.398	_	14.398
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)	USD	6.968.544	6.061.948	3.081.647	9.948.845
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	90.075	8.281	6.601	91.755
Clase de acciones (semestral) (Dis) "IO"*	EUR	_	109.186.468	_	109.186.468
Clase de acciones de acumulación "IO"	EUR	57.862.138	_	57.861.138	1.000
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)	GBP	192.448	9.535	191.530	10.453
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en SEK)*	SEK	_	11.754.754	_	11.754.754
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD)	USD	3.080.101	1.363.943	3.342.968	1.101.076
Clase de acciones "IO" (Clase cubierta en USD)	USD	7.613.137	794.196	1.061.806	7.345.527
Clase de acciones de acumulación "P"	EUR	208.166	37.425	89.142	156.449
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD)	USD	1.384.846	1.439.236	607.292	2.216.790
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)	GBP	700	21	_	721
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	520.338	215.023	149.194	586.167
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en USD)	USD	304.011	113.230	38.011	379.230
Class de assispes "D"					
Clase de acciones "R"	EUR	209.276	56.197	3.329	262.144
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	EUR GBP		56.197 44.277	3.329 51.463	262.144 225.624
	EUR	209.276			
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	EUR GBP	209.276 232.810	44.277	51.463 4.768	225.624
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD)	EUR GBP	209.276 232.810 26.939	44.277 643	51.463 4.768	225.624 22.814
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged) Global Strategic Macro Bond Portfolio	EUR GBP	209.276 232.810 26.939	44.277 643	51.463 4.768 <b>71.719.262</b>	225.624 22.814
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)	EUR GBP USD	209.276 232.810 26.939 <b>96.990.218</b>	44.277 643 <b>142.914.359</b>	51.463 4.768	225.624 22.814 <b>168.185.315</b>
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged) Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	EUR GBP USD	209.276 232.810 26.939 <b>96.990.218</b>	44.277 643 <b>142.914.359</b>	51.463 4.768 <b>71.719.262</b> 30.332	225.624 22.814 <b>168.185.315</b> 89.549
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged) Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	EUR GBP USD	209.276 232.810 26.939 <b>96.990.218</b> 109.026 6.122	44.277 643 142.914.359 10.855	51.463 4.768 <b>71.719.262</b> 30.332 1.116	225.624 22.814 <b>168.185.315</b> 89.549 5.006
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged) Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF)	EUR GBP USD USD CHF USD	209.276 232.810 26.939 <b>96.990.218</b> 109.026 6.122 4.293	44.277 643 142.914.359 10.855 — 3.138	51.463 4.768 <b>71.719.262</b> 30.332 1.116 487	225.624 22.814 <b>168.185.315</b> 89.549 5.006 6.944
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged) Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD CHF USD EUR	209.276 232.810 26.939 <b>96.990.218</b> 109.026 6.122 4.293 124.557	44.277 643 142.914.359 10.855 — 3.138	51.463 4.768 <b>71.719.262</b> 30.332 1.116 487	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en GBP)	USD CHF USD EUR GBP	209.276 232.810 26.939 <b>96.990.218</b> 109.026 6.122 4.293 124.557 1.954	44.277 643 142.914.359 10.855 - 3.138 1.500	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 38.927	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK)	USD CHF USD EUR GBP SEK	209.276 232.810 26.939 <b>96.990.218</b> 109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 984.885	44.277 643 142.914.359 10.855 	51.463 4.768 <b>71.719.262</b> 30.332 1.116 487 38.927 — 484.878	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 587.752
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged) Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en SEK)	USD CHF USD EUR GBP SEK EUR	209.276 232.810 26.939 <b>96.990.218</b> 109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 984.885 667	44.277 643 142.914.359 10.855 - 3.138 1.500 - 87.745 21	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 38.927 — 484.878 107	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 587.752 581
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)	USD CHF USD EUR GBP SEK EUR PLN	209.276 232.810 26.939 <b>96.990.218</b> 109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 984.885 667 41.204	44.277 643 142.914.359 10.855 — 3.138 1.500 — 87.745 21 10	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 38.927 — 484.878 107 20.051	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 587.752 581 21.163
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	USD CHF USD EUR GBP SEK EUR PLN EUR	209.276 232.810 26.939 <b>96.990.218</b> 109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 984.885 667 41.204	44.277 643 142.914.359 10.855 	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 38.927 484.878 107 20.051 68.837	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 587.752 581 21.163
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en PLN) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP)*	USD CHF USD EUR GBP SEK EUR PLN EUR GBP	209.276 232.810 26.939 96.990.218 109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 984.885 667 41.204 185.272	44.277 643 142.914.359 10.855 — 3.138 1.500 — 87.745 21 10 973 3.800	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 38.927 484.878 107 20.051 68.837 3.800	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 587.752 581 21.163
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	USD USD USD USD USD USD EUR GBP SEK EUR PLN EUR GBP USD	209.276 232.810 26.939 <b>96.990.218</b> 109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 984.885 667 41.204 185.272	44.277 643 142.914.359 10.855 — 3.138 1.500 — 87.745 21 10 973 3.800	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 587.752 581 117.408 87.011 2.455
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD)  Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en ortara divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en ortara divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en ortara divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación en ortas divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en ortas divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" Clase cubierta en CHF)	USD USD USD USD USD CHF USD EUR GBP SEK EUR PLN EUR GBP USD CHF	209.276 232.810 26.939 <b>96.990.218</b> 109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 984.885 667 41.204 185.272 ———————————————————————————————————	44.277 643 142.914.359 10.855 — 3.138 1.500 — 87.745 21 10 973 3.800 112.258	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 38.927 484.878 107 20.051 68.837 3.800 177.438 28.235	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 587.752 581 21.163 117.408 87.011
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PUR) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP)"	USD USD USD USD USD CHF USD EUR GBP SEK EUR PLN EUR GBP USD CHF EUR EUR GBP	209.276 232.810 26.939 96.990.218 109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 984.885 667 41.204 185.272 — 152.191 30.690 2.252.489	44.277 643 142.914.359 10.855 	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 38.927 484.878 107 20.051 68.837 3.800 177.438 28.235 1.226.811	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 581.752 21.163 117.408 87.011 2.455 1.485.754 32.225
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD)  Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "C" (Clase cubierta en GBP)" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)* Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)* Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP)* Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)*	USD CHF USD EUR GBP USD CHF USD EUR GBP USD CHF EUR GBP USD CHF EUR GBP GBP	209.276 232.810 26.939 96.990.218 109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 984.885 667 41.204 185.272 152.191 30.690 2.252.489 25.943 3.99 50.236	44.277 643 142.914.359 10.855 	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 587.752 581 117.408 87.011 2.455 1.485.754 32.225 1.071
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en BP) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP)" Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	USD USD CHF USD EUR GBP SEK EUR PLN EUR GBP USD CHF EUR GBP GBP GBP SEK	209.276 232.810 26.939 96.990.218 109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 84.885 667 41.204 185.272 152.191 30.690 2.252.489 25.943 39 50.236 4.003.981	44.277 643 142.914.359 10.855 	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 38.927 — 484.878 107 20.051 68.837 3.800 177.438 28.235 1.226.811 3.489 39 54.449	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 587.752 21.163 117.408 87.011 2.455 1.485.754 32.225
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de nominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP)* Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	USD CHF USD EUR GBP USD CHF USD EUR GBP USD CHF EUR GBP USD CHF EUR GBP GBP	209.276 232.810 26.939 96.990.218 109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 984.885 667 41.204 185.272 152.191 30.690 2.252.489 25.943 3.99 50.236	44.277 643 142.914.359 10.855 — 3.138 1.500 — 87.745 21 10 973 3.800 112.258 — 460.076	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 38.927 484.878 107 20.051 68.837 3.800 177.438 28.235 1.226.811 3.489	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 587.752 581 117.408 87.011 2.455 1.485.754 32.225 1.071
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP)* Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP)* Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK)	USD CHF USD EUR GBP USD EUR GBP SEK EUR PLN EUR GBP USD CHF EUR EUR GBP USD USD USD	209.276 232.810 26.939 96.990.218 109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 984.885 667 41.204 185.272 — 152.191 30.690 2.252.489 25.943 39 50.236 4.003.981 1.155	44.277 643 142.914.359 10.855 	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 38.927 — 484.878 107 20.051 68.837 3.800 177.438 28.235 1.226.811 3.489 39 54.449	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 587.752 581 21.163 117.408 
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en ortas divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en ortas divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación en ortas divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación en ortas divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "B" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" Clase cubierta en SEK)	USD CHF USD EUR GBP USD EUR GBP USD EUR GBP USD CHF EUR GBP SEK USD USD USD EUR	209.276 232.810 26.939 96.990.218 109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 984.885 667 41.204 185.272 — 152.191 30.690 2.252.489 25.943 39 50.236 4.003.981 1.155	44.277 643 142.914.359  10.855	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 38.927 — 484.878 107 20.051 68.837 3.800 177.438 28.235 1.226.811 3.489 39 54.449	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 587.752 581 21.163 117.408 87.011 2.455 1.485.754 32.225 
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP)" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "I" Clase cubierta en EUR)	USD USD USD USD CHF USD EUR GBP SEK EUR PLN EUR GBP USD CHF EUR GBP USD CHF EUR GBP	209.276 232.810 26.939 96.990.218  109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 984.885 667 41.204 185.272 152.191 30.690 2.252.489 25.943 39 50.236 4.003.981 1.155 — 21.677 50.661	44.277 643 142.914.359 10.855 ———————————————————————————————————	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 — 484.878 107 20.051 68.837 3.800 177.438 28.235 1.226.811 3.489 39 54.449 — 1.163 —	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 581 21.163 117.408 87.011 2.455 1.485.754 1.071 4.003.981
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD)  Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PUR) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PUR) Clase de acciones de acumulación "B" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP)* Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK)	USD CHF USD EUR GBP USD CHF EUR GBP USD CHF EUR EUR GBP USD USD EUR USD USD EUR USD USD USD USD USD	209.276 232.810 26.939 96.990.218  109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 41.204 185.272 — 152.191 30.690 2.252.489 25.943 39 50.236 4.003.981 1.155 — 21.677 50.661 258.169	44.277 643 142.914.359  10.855	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 581,21.163 117.408 87.011 2.455 1.485.754 32.225 1.071 4.003.981 104 25.928 53.038 670.842
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP)" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "I" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "I" Clase cubierta en SEK) Clase de acciones "I" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "I" Clase cubierta en EUR)	USD USD USD USD CHF USD EUR GBP SEK EUR PLN EUR GBP USD CHF EUR GBP USD CHF EUR GBP	209.276 232.810 26.939 96.990.218  109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 984.885 667 41.204 185.272 152.191 30.690 2.252.489 25.943 39 50.236 4.003.981 1.155 — 21.677 50.661	44.277 643 142.914.359 10.855 ———————————————————————————————————	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 — 484.878 107 20.051 68.837 3.800 177.438 28.235 1.226.811 3.489 39 54.449 — 1.163 —	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 587.752 21.163 117.408 ————————————————————————————————————
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD)  Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en ortras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP)" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP)" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK)	USD CHF USD EUR GBP USD CHF EUR GBP USD CHF EUR EUR GBP USD USD EUR USD USD EUR USD USD USD USD USD	209.276 232.810 26.939 96.990.218  109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 41.204 185.272 — 152.191 30.690 2.252.489 25.943 39 50.236 4.003.981 1.155 — 21.677 50.661 258.169	44.277 643 142.914.359 10.855 ———————————————————————————————————	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 587.752 581 117.408 
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD)  Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP)* Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones "I"* Clase de acciones "I"* Clase de acciones de acumulación "P" Clase de a	USD CHF USD EUR GBP USD CHF USD EUR GBP USD CHF EUR GBP USD CHF EUR GBP USD USD USD USD	209.276 232.810 26.939 96.990.218  109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 984.885 667 41.204 185.272 — 152.191 30.690 2.252.489 25.943 39 50.236 4.003.981 1.155 — 21.677 50.661 258.169 11.192	44.277 643 142.914.359 10.855 ———————————————————————————————————	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 587.752 581 21.163 117.408 87.011 2.455 1.485.754 32.225 1.071 4.003.981 
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD)  Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP)" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" Clase cubierta en SEK) Clase de acciones "I" Clase cubierta en SEK) Clase de acciones "I" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" Clase de acciones de acumulación "I" Cla	USD USD USD USD USD EUR GBP USD EUR GBP USD CHF	209.276 232.810 26.939 96.990.218  109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 984.885 667 41.204 185.272 152.191 30.690 2.252.489 25.943 39 50.236 4.003.981 1.155 ————————————————————————————————	44.277 643 142.914.359  10.855	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 — 484.878 107 20.051 68.837 3.800 177.438 28.235 1.226.811 3.489 39 54.449 — 1.163 — 1.543 5.124 10.028 2.797	225.624 22.814 168.185.315  89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 587.752 587.752 4.003.981 1.485.754 32.225 1.071 4.003.981 104 25.928 53.038 670.842 8.395 100
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD)  Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en ortas divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en ortas divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en ortas divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en ortas divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en ortas divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP)* Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones "I"* Clase de acciones "I"* Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "P" Cl	USD USD USD USD USD USD USD EUR GBP SEK EUR PLN EUR GBP USD CHF EUR GBP SEK USD	209.276 232.810 26.939 96.990.218  109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 984.885 667 41.204 185.272 152.191 30.690 2.252.489 50.236 4.003.981 1.155 — 21.677 50.661 258.169 11.192	44.277 643 142.914.359 10.855 	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 — 484.878 107 20.051 68.837 3.800 177.438 28.235 1.226.811 3.489 39 54.449 — 1.163 — 1.543 5.124 10.028 2.797	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 587.752 581 21.163 117.408 ————————————————————————————————————
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD)  Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "F" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "F" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP)* Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumula	USD CHF USD EUR GBP USD CHF USD EUR GBP USD CHF EUR GBP USD CHF EUR GBP USD USD CHF EUR USD USD CHF EUR USD USD CHF EUR USD USD CHF EUR	209.276 232.810 26.939 96.990.218  109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 984.885 667 41.204 185.272 — 152.191 30.690 2.252.489 25.943 39 50.236 4.003.981 1.155 — 21.677 50.661 258.169 11.192 100 1.034	44.277 643 142.914.359  10.855	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 38.927 484.878 107 20.051 68.837 3.800 177.438 28.235 1.226.811 3.489 54.449 — 1.163 51.24 1.028 2.797 —	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 587.752 581 21.163 117.408 87.011 2.4555 1.485.754 32.225
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD) Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en BBP) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP)" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones "I" Clase de acciones de acumulación "P" Clase de acciones de acumulación	USD USD USD USD USD USD EUR GBP USD EUR GBP USD CHF EUR GBP USD CHF EUR USD USD USD CHF EUR USD	209.276 232.810 26.939 96.990.218  109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 185.272 152.191 30.690 2.252.489 25.943 39 50.236 4.003.981 1.155 21.677 50.661 258.169 11.192 100 1.034 58 5.990	44.277 643 142.914.359  10.855 3.138 1.500 87.745 21 10 973 3.800 112.258 460.076 9.771 5.284 8 104 5.794 7.501 422.701 143	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 38.927 — 484.878 107 20.051 68.837 3.800 177.438 28.235 1.226.811 3.489 39 54.449 — 1.163 — 1.543 5.124 10.028 2.797 —	225.624 22.814 168.185.315 89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 587.752 581 21.163 117.408 87.011 2.455 1.485.754 32.225 
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD)  Total de Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)  Global Strategic Macro Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EBP) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP)* Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "I"* Clase de acciones "I"* Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "P" Clase de acciones de acumulaci	USD USD USD USD USD USD EUR GBP USD EUR GBP USD CHF EUR GBP USD CHF EUR GBP USD	209.276 232.810 26.939 96.990.218  109.026 6.122 4.293 124.557 1.954 984.885 667 41.204 185.272 152.191 30.690 2.252.489 25.943 39 50.236 4.003.981 1.155 — 21.677 50.661 258.169 11.192 100 1.034 58 5.990 34.671	44.277 643 142.914.359  10.855 3.138 1.500 87.745 21 10 973 3.800 112.258 460.076 9.771 5.284 40 5.794 7.501 422.701 143 919	51.463 4.768 71.719.262 30.332 1.116 487 	225.624 22.814 168.185.315  89.549 5.006 6.944 87.130 1.954 587.752 581 21.163 117.408 87.011 2.455 1.485.754 32.225 1.071 4.003.981 104 25.928 8.395 53.038 670.842 8.395 58 100 386 58

	Divisa	Saldo a 30-nov-2020	Suscripciones	Reembolsos	Saldo a 30-nov-2021
Global Strategic Macro Bond Portfolio (continuación)					
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	7.788	_	2.560	5.228
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	16.437	876	4.617	12.696
Clase de acciones de acumulación "RS"	USD	30.006	8.881	9.984	28.903
Clase de acciones de acumulación "RS" (Clase cubierta en CHF)	CHF	44.830	1.422	12.659	33.593
Clase de acciones de acumulación "RS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	4.122	3.626	1.016	6.732
Clase de acciones "RS"	USD	9.350	4	_	9.354
Clase de acciones "RS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	3.904	1.374	2.033	3.245
Total de Global Strategic Macro Bond Portfolio		8.624.750	1.166.878	2.237.529	7.554.099
Strategic Absolute Return Bond II Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	4.800	5.670	9.492	978
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	EUR USD	6.567 2.694	1.269 55	958	6.878 2.749
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR)	EUR	2.560	26	1.347	1.239
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en GBP)	GBP	265	_	220	45
Clase de acciones "A"	USD	4.662	25	605	4.082
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	6.113	2.104	4.955	3.262
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	112	189.000	189.034	78
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	31.104	_	23.448	7.656
Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP)	GBP	531.002	2.454	_	533.456
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)	GBP	546	_	_	546
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	780	98.688	98.688	780
Clase de acciones "R"	USD	7.956	3	7.840	119
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	30.648	28		30.676
Total de Strategic Absolute Return Bond II Portfolio		629.809	299.322	336.587	592.544
Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio					
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	1.365.609	240.560	166.592	1.439.577
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	2.433.308	387.328	597.668	2.222.968
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	717.316	35.261	24.679	727.898
Clase de acciones "I"	USD	2.446.005	563.740	759.216	2.250.529
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	9.638.399	495.275	8.408.870	1.724.804
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR USD	578.097 2.242.685	266.094 236.554	363.804	480.387
				351.633	2.127.606
Clase de acciones de acumulación "R"					500 272
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	883.094	12.006	295.728	599.372
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)	EUR GBP	883.094 1.825.540	12.006 19.225	295.728 261.956	1.582.809
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"	EUR	883.094 1.825.540 8.153.104	12.006 19.225 3.471.851	295.728 261.956 2.273.772	1.582.809 9.351.183
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio	EUR GBP	883.094 1.825.540	12.006 19.225	295.728 261.956	
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged)	EUR GBP USD	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157	12.006 19.225 3.471.851 <b>5.727.894</b>	295.728 261.956 2.273.772	1.582.809 9.351.183 <b>22.507.133</b>
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio	EUR GBP	883.094 1.825.540 8.153.104	12.006 19.225 3.471.851	295.728 261.956 2.273.772	1.582.809 9.351.183
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I"	EUR GBP USD	883.094 1.825.540 8.153.104 <b>30.283.157</b> 93.537.023	12.006 19.225 3.471.851 <b>5.727.894</b> 81.167	295.728 261.956 2.273.772	1.582.809 9.351.183 <b>22.507.133</b> 93.618.190
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I"  Total Global Corporate Portfolio (Hedged)	EUR GBP USD	883.094 1.825.540 8.153.104 <b>30.283.157</b> 93.537.023	12.006 19.225 3.471.851 <b>5.727.894</b> 81.167	295.728 261.956 2.273.772	1.582.809 9.351.183 <b>22.507.133</b> 93.618.190
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I"  Total Global Corporate Portfolio (Hedged)  Absolute Return Tracker Portfolio	EUR GBP USD	883.094 1.825.540 8.153.104 <b>30.283.157</b> 93.537.023 <b>93.537.023</b>	12.006 19.225 3.471.851 <b>5.727.894</b> 81.167 81.167	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918	1.582.809 9.351.183 <b>22.507.133</b> 93.618.190 <b>93.618.190</b>
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I"  Total Global Corporate Portfolio (Hedged)  Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR GBP USD NOK	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157 93.537.023 97.114 464.982 934.273	12.006 19.225 3.471.851 <b>5.727.894</b> 81.167 81.167	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged) Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SGD)	NOK  USD  CHF EUR SGD	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157 93.537.023 93.537.023 97.114 464.982 934.273 14.000	12.006 19.225 3.471.851 <b>5.727.894</b> 81.167 332.906 47.395 8.187.175	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918 ————————————————————————————————————	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged) Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SGD) Clase de acciones de acumulación "A"	NOK  USD CHF EUR SGD USD	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157 93.537.023 97.114 464.982 934.273 14.000 18.807	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894 81.167 332.906 47.395 8.187.175 —	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918 ————————————————————————————————————	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I"  Total Global Corporate Portfolio (Hedged)  Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SGD) Clase de acciones de acumulación "F" (Clase cubierta en EUR)	NOK  USD CHF EUR SGD USD EUR	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157 93.537.023 97.114 464.982 934.273 14.000 18.807 4.159	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894 81.167 332.906 47.395 8.187.175 ————————————————————————————————————	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918 ————————————————————————————————————	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged) Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación en ortas divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en ortas divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en ortas divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en ortas divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en ortas divisas (Clase cubierta en SGD) Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	NOK  USD CHF EUR SGD USD EUR USD	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157 93.537.023 93.537.023 97.114 464.982 934.273 14.000 18.807 4.159 8.920.322	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894 81.167 332.906 47.395 8.187.175 —	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918 ————————————————————————————————————	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838 18.807.199
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged)  Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SGD) Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I"	NOK  USD CHF EUR SGD USD EUR USD AUD	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157 93.537.023 97.114 464.982 934.273 14.000 18.807 4.159 8.920.322	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894 81.167 332.906 47.395 8.187.175 — 112.643 34.086 27.175.660	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918 ————————————————————————————————————	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838 18.807.199
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged)  Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SGD) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF)	EUR GBP USD NOK USD CHF EUR SGD USD EUR USD AUD CHF	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157 93.537.023 97.114 464.982 934.273 14.000 18.807 4.159 8.920.322 103 20.717.455	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894 81.167 332.906 47.395 8.187.175 — 112.643 34.086 27.175.660 —	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918 	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838 18.807.199 103 21.043.228
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged)  Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SGD) Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "F" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	NOK  USD CHF EUR SGD USD USD CHF EUR CHF EUR CHF EUR CHF EUR CHF EUR CHF EUR	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157 93.537.023 93.537.023 97.114 464.982 934.273 14.000 18.807 4.159 8.920.322 103 20.717.455 12.038.557	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894 81.167 332.906 47.395 8.187.175 	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918 ————————————————————————————————————	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838 18.807.199 103 21.043.228 19.324.111
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged)  Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	NOK  USD CHF EUR SGD USD EUR AUD CHF EUR GBP	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157 93.537.023 97.114 464.982 934.273 14.000 18.807 4.159 0.322 103 20.717.455 12.038.557 961.928	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894 81.167 332.906 47.395 8.187.175 — 112.643 34.086 27.175.660 — 11.592.402 13.228.888 282.106	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918 	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838 18.807.199 103 21.043.228 19.324.111 829.958
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Giobal Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged)  Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	EUR GBP USD NOK USD CHF EUR SGD USD EUR USD CHF EUR GBP JPY	93.537.023 93.537.023 97.114 464.982 934.273 14.000 18.807 4.159 8.920.322 103 20.717.455 12.038.557 961.928 3.497.150	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894 81.167 332.906 47.395 8.187.175 — 112.643 34.086 27.175.660 — 11.592.402 13.228.888 282.106 2.135.839	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918 	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838 18.807.199 103 21.043.228 19.324.111 829.958 5.631.525
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged)  Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	NOK  USD CHF EUR SGD USD EUR AUD CHF EUR GBP	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157 93.537.023 97.114 464.982 934.273 14.000 18.807 4.159 0.322 103 20.717.455 12.038.557 961.928	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894 81.167 332.906 47.395 8.187.175 — 112.643 34.086 27.175.660 — 11.592.402 13.228.888 282.106	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918 	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838 18.807.199 103 21.043.228 19.324.111 829.958
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged)  Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SGD) Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en JPY) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK)	NOK  USD CHF EUR SGD AUD CHF EUR USD AUD AUD CHF EUR GBP JPY SEK	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157 93.537.023 97.114 464.982 934.273 14.000 18.807 4.159 8.920.322 103 20.717.455 12.038.557 961.928 3.497.150 1.063.939	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894 81.167 332.906 47.395 8.187.175 — 112.643 34.086 27.175.660 — 11.592.402 13.228.888 22.106 21.35.839 1.594.483	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918 	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838 18.807.199 103 21.043.228 19.324.111 829.958 5.631.525 1.648.487 1.385.620
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (R" Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged)  Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "P"	NOK  USD CHF EUR SGD USD AUD CHF EUR GBP JPY SEK USD	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157 93.537.023 93.537.023 97.114 464.982 934.273 14.000 18.807 4.159 8.920.322 103 20.717.455 12.038.557 961.928 3.497.150 1.063.939 1.184.134	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894 81.167 332.906 47.395 8.187.175 — 112.643 34.086 27.175.660 — 11.592.402 3228.888 282.106 2.135.839 1.594.483 528.131	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918 ————————————————————————————————————	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838 18.807.199 103 21.043.228 19.324.111 829.958 5.631.525 1.648.487 1.385.620 224.089
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged)  Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "P" Clase cubierta en EUR)	NOK  USD CHF EUR SGD USD AUD CHF EUR GBP JPY SEK USD EUR EUR USD EUR USD	93.537.023 93.537.023 93.537.023 97.114 464.982 944.273 14.000 18.807 4.159 8.920.322 20.717.455 12.038.557 961.928 3.497.150 1.063.939 1.184.134 152.062	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894  81.167  332.906 47.395 8.187.175 — 112.643 34.086 27.175.660 — 11.592.402 13.228.888 282.106 2.135.839 1.594.483 528.131 86.627	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918 	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838 18.807.199 21.043.228 19.324.111 829.958 5.631.525 1.648.487 1.385.620 234.089 6.857.525
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged) Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en BP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en BP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en BP) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en BUR) Clase de acciones de acumulación "P" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" Clase cubierta en EUR)	EUR GBP USD  NOK  USD CHF EUR SGD USD AUD CHF EUR USD AUD CHF EUR GBP JPY SEK USD	93.537.023 93.537.023 93.537.023 97.114 464.982 934.273 14.000 18.807 4.159 20.717.455 12.038.557 961.928 3.497.150 1.063.939 1.184.134 152.062 4.626.129 4.320.272 1.928.524	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894  81.167  332.906 47.395 8.187.175 — 112.643 34.086 27.175.660 — 11.592.402 13.228.888 282.106 2.135.839 1.594.483 528.131 86.627 2.820.903 3.458.661 609.366	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918 	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838 18.807.199 103 21.043.228 19.324.111 829.958 5.631.525 1.648.487 1.385.620 234.089 6.857.525 6.843.042 2.238.043
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged)  Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SGD) Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "R" Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Total de Absolute Return Tracker Portfolio	NOK  USD CHF EUR SGD USD AUD CHF EUR GBP JPY SEK USD EUR EUR USD EUR USD	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157 93.537.023 93.537.023 97.114 464.982 934.273 14.000 18.807 4.159 8.920.322 103 20.717.455 12.038.557 961.928 3.497.150 1.063.939 1.184.134 152.062 4.626.129 4.320.272	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894 81.167 332.906 47.395 8.187.175 — 112.643 34.086 27.175.660 — 11.592.402 3228.888 282.106 2.135.839 1.594.483 528.131 86.627 282.9003 3.458.661	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918 ————————————————————————————————————	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838 18.807.199 10.324.111 829.958 5.631.525 1.648.487 1.385.620 234.089 6.857.525 6.843.042
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged) Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SGD) Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEN) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEN) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEN) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEN) Clase de acciones de acumulación "P" Clase de acciones de acumulación "P" Clase de acciones de acumulación "P" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	NOK  USD CHF EUR SGD USD AUD CHF EUR USD AUD CHF EUR GBP JPY SEK USD EUR EUR USD GBP	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157 93.537.023 93.537.023 97.114 464.982 934.273 14.000 18.807 4.159 8.920.322 103 20.717.455 12.038.557 961.928 3.497.150 1.063.939 1.184.134 152.062 4.626.129 4.320.272 1.928.524 60.943.910	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894 81.167 332.906 47.395 8.187.175 — 112.643 34.086 27.175.660 — 11.592.402 13.228.888 282.106 2.135.839 1.594.483 528.131 86.627 2.820.903 3.458.661 609.366 72.227.271	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 21.043.228 19.324.111 829.958 5.631.525 1.648.487 1.385.620 234.089 8.857.525 6.843.042 2.238.043
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged) Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en BP) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en BP) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" Clase cubierta en EUR)	EUR GBP USD NOK USD CHF EUR SGD USD AUD CHF EUR GBP JPY SEK USD EUR EUR EUR USD GBP	93.537.023 93.537.023 93.537.023 97.114 464.982 93.4.273 14.000 18.807 4.159 8.920.322 103 20.717.455 12.038.557 961.928 3.497.150 1.063.939 1.184.134 152.062 4.626.129 4.320.272 1.928.524 60.943.910	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894  81.167  332.906 47.395 8.187.175 — 112.643 34.086 27.175.660 — 11.592.402 32.28.888 282.106 2.135.839 1.594.483 528.131 86.627 2.820.903 3.458.661 609.366 72.227.271	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838 18.807.199 103 21.043.228 19.324.111 829.958 5.631.525 1.648.487 1.385.620 234.089 6.857.525 6.843.042 2.238.043 93.793.069
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged) Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en BUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en BUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Total de Absolute Return Tracker Portfolio Alternative Trend Portfolio Clase de acciones de acumulación "I"	EUR GBP USD  NOK  USD CHF EUR SGD USD EUR USD CHF EUR USD GBP EUR USD EUR EUR USD EUR EUR USD EUR EUR USD EUR EUR USD	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157 93.537.023 97.114 464.982 934.273 14.000 18.807 4.159 8.920.322 103 20.717.455 12.038.557 961.928 3.497.150 1.063.939 1.184.134 152.062 4.626.129 4.320.272 1.928.524 60.943.910	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894  81.167  332.906 47.395 8.187.175 — 112.643 34.086 27.175.660 — 11.592.402 13.228.888 282.106 2.135.839 1.594.483 528.131 86.627 2.820.903 3.458.661 609.366 72.227.271	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838 18.807.199 103 21.043.228 19.324.111 829.958 5.631.525 1.648.487 1.385.620 234.089 6.857.525 6.843.042 2.238.043 93.793.069
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones gentro de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones gentro de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones gentro de acumulación "I" Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged) Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SGD) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en BEP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "R" Clase de acciones "R" Clase cubierta en GBP) Total de Absolute Return Tracker Portfolio Alternative Trend Portfolio Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR GBP USD  NOK  USD CHF EUR SGD USD AUD CHF EUR GBP JPY SEK USD EUR USD GBP  EUR USD GBP	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157 93.537.023 93.537.023 97.114 464.982 934.273 14.000 18.807 4.159 8.920.322 103 20.717.455 12.038.557 961.928 3.497.150 1.063.939 1.184.134 152.062 4.626.129 4.320.272 1.928.524 60.943.910 146.378 17.138 2.834.749	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894  81.167 81.167 332.906 47.395 8.187.175 60 21.2643 34.086 27.175.660 2.135.839 1.594.483 528.131 86.627 2.820.903 3.458.661 609.366 72.227.271 138.732 65.408 2.146.608	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838 18.807.199 21.043.228 19.324.111 829.958 6.631.525 1.648.487 1.385.620 234.089 6.857.525 6.843.042 22.338.043 93.793.069
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged) Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SGD) Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "P" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	NOK  USD CHF EUR SGD USD AUD CHF EUR GBP JPY SEK USD EUR EUR EUR USD GBP EUR	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157 93.537.023 93.537.023 97.114 464.982 93.4.273 14.000 18.807 4.159 8.920.322 103 20.717.455 12.038.557 961.928 3.497.150 1.063.939 1.184.134 152.062 4.626.129 4.320.272 1.928.524 60.943.910 146.378 17.138 2.834.749 227.818	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894  81.167  332.906 47.395 8.187.175 — 112.643 34.086 27.175.660 — 11.592.402 32.28.888 282.106 2.135.839 1.594.483 528.131 86.627 2.820.903 3.458.661 609.366 72.227.271  138.732 65.408 4.146.608 4.440.459	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838 18.807.199 103 21.043.228 19.324.111 829.958 5.631.525 1.648.487 1.385.620 234.089 6.857.525 6.843.042 2.238.043 93.793.069
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged)  Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SGD) Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en BUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en BUR) Clase de acciones de acumulación "P" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "R" Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR GBP USD  NOK  USD CHF EUR SGD USD AUD CHF EUR USD EUR EUR USD EBP	93.537.023 93.537.023 93.537.023 97.114 464.982 934.273 103 20.717.455 12.038.557 961.928 3.497.150 1.063.939 1.184.134 152.062 4.626.129 4.320.272 1.928.524 60.943.910 146.378 17.138 2.834.749 17.138 2.834.749 17.23.452	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894  81.167  332.906 47.395 8.187.175 — 112.643 34.086 27.175.660 — 11.592.402 13.228.888 262.106 2.135.839 1.594.483 34.58.661 609.366 72.227.271  138.732 65.408 2.146.608 4.440.459 322.005	295.728 261.956 2.273.772  13.503.918	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838 18.807.199 103 21.043.228 19.324.111 829.958 5.631.525 1.648.487 1.385.62 234.089 6.857.525 6.843.042 2.238.043 93.793.069
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones Portfolio (Hedged) Clase de acciones Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I"  Total Global Corporate Portfolio (Hedged) Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en BEP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en BEP) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación	EUR GBP USD  NOK  USD CHF EUR SGD USD AUD CHF EUR USD EUR GBP USD EUR EUR USD EUR EUR USD GBP USD	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157 93.537.023 93.537.023 93.537.023 97.114 464.982 934.273 14.000 18.807 4.159 8.920.322 103 20.717.455 12.038.557 961.928 3.497.150 1.063.939 1.184.134 152.062 4.626.129 4.320.272 1.928.524 60.943.910 146.378 17.138 2.834.749 227.818 1.723.452 23.800.716	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894  81.167 81.167 332.906 47.395 8.187.175 60 27.175.660 213.228.888 282.106 2.135.839 1.594.483 528.131 86.627 2.820.903 3.458.661 609.366 72.227.271  138.732 65.408 2.146.608 4.440.459 322.005 10.998.053	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838 18.807.199 21.043.228 19.324.111 829.958 5.631.525 1.648.487 1.385.620 234.089 6.857.525 6.843.042 22.38.043 93.793.069
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I" Total Global Corporate Portfolio (Hedged) Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SGD) Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "T" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cu	NOK  USD CHF EUR SGD USD AUD CHF EUR GBP JPY SEK USD GBP  EUR USD GBP  USD GBP  USD GBP	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157 93.537.023 93.537.023 97.114 464.982 934.273 14.000 18.807 4.159 8.920.322 103 20.717.455 12.038.557 961.928 3.497.150 1.063.939 1.184.134 152.062 4.626.129 4.320.272 1.928.524 60.943.910 146.378 17.138 2.834.749 227.818 1.723.452 23.800.716 205.149	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894  81.167  81.167  332.906 47.395 8.187.175 — 112.643 34.086 27.175.660 — 11.592.402 13.228.888 282.106 2.135.839 1.594.483 528.131 86.627 2.820.903 3.458.661 609.366 72.227.271  138.732 65.408 4.440.459 322.005 10.998.053 491.413	295.728 261.956 2.273.772 13.503.918	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838 18.807.199 21.043.228 19.324.111 829.958 5.631.525 1.648.487 1.385.620 234.089 6.857.525 6.843.042 2.238.043 93.793.069 237.647 53.196 4.251.289 4.422.638 1.945.375 29.166.058 696.562
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones R"  Total de Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio  Global Corporate Portfolio (Hedged) Clase de acciones Portfolio (Hedged) Clase de acciones Portfolio (Hedged) Clase de acciones de acumulación "I"  Total Global Corporate Portfolio (Hedged) Absolute Return Tracker Portfolio Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en BEP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en BEP) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación	EUR GBP USD  NOK  USD CHF EUR SGD USD AUD CHF EUR USD EUR GBP USD EUR EUR USD EUR EUR USD GBP USD	883.094 1.825.540 8.153.104 30.283.157 93.537.023 93.537.023 93.537.023 97.114 464.982 934.273 14.000 18.807 4.159 8.920.322 103 20.717.455 12.038.557 961.928 3.497.150 1.063.939 1.184.134 152.062 4.626.129 4.320.272 1.928.524 60.943.910 146.378 17.138 2.834.749 227.818 1.723.452 23.800.716	12.006 19.225 3.471.851 5.727.894  81.167 81.167 332.906 47.395 8.187.175 60 27.175.660 213.228.888 282.106 2.135.839 1.594.483 528.131 86.627 2.820.903 3.458.661 609.366 72.227.271  138.732 65.408 2.146.608 4.440.459 322.005 10.998.053	295.728 261.956 2.273.772  13.503.918	1.582.809 9.351.183 22.507.133 93.618.190 93.618.190 389.922 289.239 8.117.437 14.000 110.703 28.838 18.807.199 103 21.043.228 19.324.111 829.958 5.631.525 1.648.487 1.385.620 234.089 6.857.525 6.843.042 2.238.043 93.793.069

<sup>\*</sup> Consulte el Anexo III (sin auditar).

#### 8 Política de dividendos

El objetivo del Fondo es que la práctica totalidad de los ingresos netos derivados de inversiones de cada Cartera, de haberlos, se declaren como dividendos y se distribuyan como mínimo anualmente entre los accionistas de la Clase de acciones de Reparto de las Carteras. El capital neto y las plusvalías de divisas materializadas en las inversiones de cada Cartera y/o el capital atribuible a determinadas Clases de Acciones también podrán distribuirse a los Accionistas de determinadas Clases de Acciones de Reparto de las Carteras.

Por lo general, no se realizarán repartos respecto a la Clase de acciones de acumulación.

Consulte el Folleto para obtener más información sobre las políticas de distribución.

#### 9 Inversiones financieras y riesgos asociados

Las actividades inversoras del Fondo lo exponen a diversos tipos de riesgos asociados a los instrumentos financieros y los mercados donde invierten este y sus Carteras subyacentes (los "Riesgos de inversión"). Puede tratarse de inversiones tanto en instrumentos financieros derivados como no derivados. Las inversiones de las Carteras subyacentes del Fondo se componen de instrumentos de deuda, derivados, títulos de renta variable e inversiones en otros fondos al cierre del ejercicio. El Consejo de Administración ha nombrado a la Sociedad Gestora como responsable de, entre otras cosas, la gestión de inversiones y la gestión de riesgos. La Sociedad Gestora ha delegado determinadas funciones relacionadas con la gestión de inversiones al Asesor de inversiones.

Los principales tipos de riesgos financieros a los que se expone el Fondo son el riesgo de mercado, el riesgo de liquidez y el riesgo crediticio. El Folleto ofrece más detalles sobre estos y otros tipos de riesgo, complementando algunos de ellos la información facilitada en los presentes estados financieros.

La asignación de activos viene determinada por el Asesor de inversiones del Fondo que gestiona la asignación de activos para alcanzar los objetivos de inversión que se detallan en el Folleto. La consecución de dichos objetivos puede conllevar la asunción de riesgos. El Asesor de inversiones establece valoraciones a partir de análisis, estudios y técnicas de gestión de riesgos que utiliza al tomar decisiones de inversión. De conformidad con la política de gestión de riesgos del Fondo, se vigila la divergencia entre el índice de referencia y/o las asignaciones de activos objetivo y la composición de la cartera.

A continuación se describen las políticas de gestión de riesgos empleadas en relación con el Fondo.

### (a) Riesgo de mercado

Se entiende por "riesgo de mercado" la posibilidad de que se produzcan cambios en el valor de mercado de las inversiones mantenidas por las Carteras subyacentes del Fondo. Este riesgo se divide generalmente en las categorías de riesgo de cambio, riesgo de tipos de interés y riesgo de otros precios.

- (i) El riesgo de cambio puede producirse cuando nos exponemos a variaciones de los precios al contado o a plazo, o bien a la volatilidad de los tipos de cambio.
- (ii) <u>El riesgo de tipos de interés</u> puede producirse cuando nos exponemos a variaciones en el nivel, la pendiente o la curvatura de las diversas curvas de rentabilidad, la volatilidad de los tipos de interés, la velocidad de amortización anticipada del préstamo hipotecario y los diferenciales de crédito.
- (iii) <u>Los riesgos de otros precios</u> son aquellos en que el valor de la inversión fluctúa como consecuencia de variaciones de los precios de mercado, a excepción de las asociadas a los tipos de cambio. Esto puede producirse cuando nos exponemos a variaciones de los precios y volatilidades de determinadas acciones, cestas de acciones, índices bursátiles o materias primas.

La estrategia de gestión de riesgos de mercado empleada por el Fondo viene determinada por el riesgo de inversión de las Carteras subyacentes del mismo y por los objetivos de rentabilidad fijados.

El riesgo de mercado se gestiona mediante la aplicación de principios de presupuestación de riesgos. El Asesor de inversiones determina un objetivo de riesgo conveniente, denominado generalmente "Error de seguimiento", que emplea una estructura de presupuestación de riesgos.

#### 9 Inversiones financieras y riesgos asociados (continuación)

#### (a) Riesgo de mercado (continuación)

El grupo de Gestión de Riesgo de AM de Goldman Sachs ("Riesgo de AM") es responsable de la estructura general del control de riesgos y de definir las mejores prácticas de gestión de riesgos adecuadas. La estructura de control de riesgos incluye la identificación, la medición, la supervisión, la asignación y la solución de los riesgos pertinentes. El Riesgo de AM emplea una serie de métricas de riesgo para supervisar el perfil de riesgo de los fondos de forma regular y continua. La función de gestión de riesgos de GSAMFSL, en asociación con el equipo de gestión del riesgo de AM, tratará de garantizar que el perfil de riesgo de los fondos siga siendo acorde con los límites de riesgo aplicables y los umbrales internos que se establezcan en consonancia con el perfil de riesgo comunicado a los inversores. El cumplimiento de estos umbrales de riesgo se supervisa semanalmente, y las excepciones se notifican de inmediato al Director de riesgos de AM y a los equipos de gestión de carteras. Todas las excepciones de gobernanza se comunican al Comité de Supervisión de la Gestión de Riesgos ("RMOC") y al Grupo de trabajo sobre riesgos de AM. Asimismo, la función de gestión de riesgos de GSAMFSL presenta o proporciona material escrito sobre los riesgos al Consejo al menos con frecuencia semestral.

#### (i) Riesgo de cambio

El Fondo puede invertir en instrumentos financieros y formalizar transacciones denominadas en divisas distintas a las monedas de referencia de sus Carteras. Por consiguiente, el Fondo puede estar expuesto al riesgo de que el tipo de cambio de su moneda de referencia con respecto a otras divisas extranjeras pueda variar de forma negativa para el valor de los activos o pasivos del Fondo denominados en divisas distintas a la moneda de referencia.

Cuando un inversor invierte en una Clase de acciones denominada en una moneda distinta a la divisa de referencia de la Cartera en que invierte, el riesgo de cambio al que se expone el inversor será distinto al riesgo de cambio de la Cartera.

### (ii) Riesgo de tipos de interés

El Fondo puede invertir en valores de renta fija y en contratos de permutas de tipos de interés. Cualquier variación de los tipos de interés que afecte a dichos valores puede hacer que al Asesor de inversiones le resulte imposible lograr rendimientos similares en la fecha de vencimiento de los contratos o en la venta de los títulos. Por otro lado, las variaciones de los tipos de interés vigentes o los cambios en las expectativas de los futuros tipos pueden provocar un aumento o disminución del valor de los títulos mantenidos. En general, si los tipos de interés suben, el valor de los títulos de renta fija baja, y un descenso de tipos de interés en general tendrá el efecto contrario. En el Estado de inversiones se indican todos los títulos de renta fija y de tipo variable, junto con sus tipos de interés y fechas de vencimiento. El Fondo puede invertir en instrumentos financieros denominados en las divisas deseadas a tipos de interés fijos, variables y nulos.

### (iii) Riesgo de otros precios

El riesgo de otros precios se produce cuando el valor del instrumento financiero fluctúa como consecuencia de variaciones de los precios de mercado, a excepción de las asociadas a los riesgos de tipos de interés o de tipos de cambio, bien causadas por factores específicos de una inversión concreta, por su emisor o por cualquier otro factor que afecte a los instrumentos financieros cotizados en el mercado.

Como las inversiones financieras de los Fondos se contabilizan al valor de mercado, y las variaciones de dicho valor quedan reflejadas en la Cuenta de pérdidas y ganancias, todos los cambios en la situación del mercado afectarán directamente al patrimonio neto.

Las inversiones del Fondo mantenidas en fondos de inversión colectiva se basan en el valor liquidativo suministrado por los fondos, de acuerdo con la política de valoración de ese fondo, descrita en su Folleto. Aunque se prevé que sea un administrador externo independiente u otro proveedor de servicios el encargado de valorar los activos de los fondos de inversión colectiva, pueden darse circunstancias que impidan determinar fácilmente el precio de mercado de algunos títulos u otros activos de un fondo de inversión colectiva. En tal caso, el gestor del fondo afectado puede estar obligado a asignar un precio a dichos títulos o instrumentos.

Un gran número de instrumentos financieros utilizan o pueden utilizar un tipo de interés variable basado en el LIBOR, que es el tipo ofrecido en los depósitos en eurodólares a corto plazo entre los principales bancos internacionales. Con arreglo al anuncio de la Autoridad de Conducta Financiera ("FCA") y la ICE Benchmark Authority ("IBA"), todos los datos del LIBOR en euros y en francos suizos, los datos del LIBOR al contado a un día, a una semana, a dos meses y a doce meses en yenes y libras esterlinas, y los datos del LIBOR en dólares estadounidenses a una semana y a dos meses dejaron de publicarse el 31 de diciembre de 2021.

#### 9 Inversiones financieras y riesgos asociados (continuación)

#### (a) Riesgo de mercado (continuación)

#### (iii) Riesgo de otros precios (continuación)

Todos los datos del LIBOR en dólares estadounidenses a un día, a un mes, a tres meses, a seis meses y a doce meses dejarán de publicarse a partir del 30 de junio de 2023. Las agencias bancarias federales de EE. UU. también han emitido orientaciones que instan a las organizaciones bancarias mundiales a dejar de hacer referencia al LIBOR en dólares estadounidenses tan pronto como sea posible y, en cualquier caso, antes del 31 de diciembre de 2021.

Existe aún cierta incertidumbre en cuanto a la utilización futura del LIBOR y la naturaleza de los tipos de sustitución disponibles en la actualidad, aunque esperamos que el índice de referencia para este mandato cambie antes de finales de 2021 o inmediatamente después. Por lo tanto, no es posible determinar en este momento el posible efecto del abandono del LIBOR en el Fondo o en los instrumentos financieros en los que invierte el Fondo. El proceso de transición podría provocar un aumento de la volatilidad y la falta de liquidez en los mercados que actualmente dependen del LIBOR para determinar los tipos de interés. También podría provocar una reducción del valor de algunas inversiones basadas en el LIBOR y reducir la eficacia de las nuevas coberturas constituidas frente a los instrumentos existentes basados en el LIBOR. Dado que la utilidad del LIBOR como índice de referencia podría verse mermada durante el periodo de transición, dichos efectos podrían manifestarse antes de que finalice el año 2021.

#### (b) Riesgo de liquidez

El riesgo de liquidez es el riesgo de que el Fondo tenga problemas a la hora de atender las obligaciones de pago asociadas a los pasivos financieros que se liquidan con la entrega de efectivo u otro activo financiero. La liquidez podría quedar mermada, entre otras razones, por la imposibilidad de acceder a fuentes de financiación seguras y/o no seguras, la imposibilidad de vender activos o por salidas imprevistas de fondos o garantía o por una violación de los términos o cláusulas del contrato por parte del intermediario financiero preferente o de la contraparte. Esta situación puede surgir por circunstancias ajenas al control del Fondo, por ejemplo, por una suspensión general de la actividad del mercado o por un problema operativo que afecte al Fondo o a entidades externas. La capacidad de vender activos también puede verse mermada si otros participantes del mercado tratan de vender activos similares al mismo tiempo.

El Fondo puede invertir en fondos de inversión colectiva, los cuales es posible que impongan restricciones en los reembolsos más estrictas que las aplicadas por el Fondo. Entre ellas destaca una menor frecuencia de fechas en que se permite solicitar reembolsos, comparado con las fechas que el Fondo ofrece a sus accionistas.

Entre los instrumentos financieros del Fondo se encuentran inversiones en contratos de derivados cotizados en mercados extrabursátiles (OTC), es decir, que no cotizan en mercados públicos organizados y que pueden resultar ilíquidos, así como inversiones que pueden representar un porcentaje considerable del tamaño de la emisión. En consecuencia, el Fondo puede no ser capaz de liquidar rápidamente algunas de sus inversiones mantenidas en estos instrumentos a un precio próximo a su valor de mercado para cumplir los requisitos de liquidez, o para responder a incidencias concretas como, por ejemplo, un deterioro de la solvencia de un determinado emisor. La liquidación forzosa de ciertas posiciones de inversión puede ocasionar pérdidas financieras.

El Fondo prevé la suscripción y el reembolso de acciones, por lo que está expuesto al riesgo de liquidez asociado a los reembolsos que los accionistas desean realizar conforme a lo dispuesto en el Folleto. Las Carteras subyacentes del Fondo se gestionan de modo que incorporen inversiones líquidas suficientes, a juicio del Asesor de inversiones, para atender las necesidades normales de liquidez. Los reembolsos cuantiosos de acciones podrían exigir al Fondo liquidar las inversiones más rápidamente de lo que sería deseable, con el fin de captar el capital necesario para atender los reembolsos; asimismo, las variaciones de la liquidez de las inversiones subyacentes de las Carteras, una vez adquiridas, pueden tener un efecto adverso en la posición mantenida en ellas.

Estos factores podrían afectar negativamente al valor de las acciones reembolsadas, a la valoración de aquellas que continúan en circulación y a la liquidez del resto de activos de la Cartera, si se han vendido más activos líquidos para atender los reembolsos.

Consulte el Anexo IV (sin auditar) para obtener información sobre los Accionistas que mantenían posiciones superiores al 10 % del patrimonio neto de la Cartera a 30 de noviembre de 2021.

#### 9 Inversiones financieras y riesgos asociados (continuación)

#### (b) Riesgo de liquidez (continuación)

Entre los acuerdos de financiación figuran los contratos de recompra inversa, las transacciones de derivados y las líneas de crédito. El vencimiento o rescisión de los préstamos financieros disponibles para posiciones apalancadas y los requisitos aplicados al depósito de garantía originado por cambios en el valor de mercado de dichas posiciones o por variaciones en las tasas de anticipo u otros términos y condiciones establecidos en los acuerdos de financiación del Fondo pueden acarrear consecuencias negativas para él que limiten su acceso a la liquidez o mermen su capacidad de mantener posiciones apalancadas, pudiendo llegar a incurrir en pérdidas cuantiosas por estas limitaciones.

Sin embargo, no hay garantías de que pueda acceder a acuerdos de este tipo para financiarse o, en caso contrario, que pueda celebrarlos en términos y condiciones aceptables para el Fondo. Una situación económica desfavorable también podría aumentar los costes financieros, limitar el acceso a los mercados de capitales o inducir a las entidades prestamistas a decidir no extender nuevos créditos al Fondo.

El uso del apalancamiento también aumenta el riesgo, ya que potencia el efecto de la volatilidad de los valores de mercado asignados a la renta variable del Fondo.

Un descenso del valor de mercado de los activos del Fondo puede tener consecuencias especialmente adversas en aquellos casos en que los préstamos adquiridos por el Fondo estén basados en el valor de mercado de esos activos. Un descenso del valor de mercado de esos activos puede obligar al prestamista (incluyendo las contrapartes de instrumentos derivados) a exigir al Fondo depositar una garantía adicional o, en su defecto, vender activos en un momento que resulte inoportuno o inconveniente para el Fondo.

El reembolso de acciones de una Cartera podrá ser suspendido temporalmente, o aplazado, por el Consejo de Administración o la Sociedad Gestora en nombre del Fondo en determinadas circunstancias, y cuando se considere que redunda en interés de los Accionistas.

A 30 de noviembre de 2021, el Fondo participaba en una línea de crédito renovable sin garantías de 350.000.000 USD (la "línea") junto a otros subfondos de Goldman Sachs Funds II SICAV y Goldman Sachs Lux Investment Funds. Esta línea se utiliza con fines de emergencia temporales o para permitir una liquidación ordenada de los títulos para cumplir con las solicitudes de reembolso. La tasa de interés de los endeudamientos se basa en una tasa de referencia relacionada con la divisa obtenida (como LIBOR, EURIBOR). La línea también requiere el pago de una comisión por parte del Fondo basado en la cantidad del compromiso que no se utilice. En el ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021, el Fondo no disponía de ningún endeudamiento en la línea.

### (c) Riesgo crediticio

El riesgo crediticio y de contraparte es el riesgo de que una parte contratante de un instrumento financiero origine una pérdida económica a la otra parte por el incumplimiento de una obligación.

Se han adoptado procedimientos para reducir el riesgo crediticio relacionado con las operaciones que el Fondo mantiene con contrapartes. Antes de celebrar transacciones con una contraparte, el Asesor de inversiones o sus afilados evalúan la solvencia, el negocio y la reputación de la misma mediante un análisis centrado en esos tres aspectos. Posteriormente se supervisa el riesgo crediticio de las contrapartes aprobadas cada cierto tiempo y se realizan revisiones periódicas de los estados financieros e informes provisionales de las mismas, en caso necesario.

Para reducir la exposición a pérdidas crediticias, el Fondo formalizó algunos contratos de derivados extrabursátiles que permiten la compensación de transacciones originadas en virtud de esos contratos, excepto aquellos que se celebran con contrapartes que ejecutan únicamente contratos de divisas al contado. Estos activos y pasivos declarados permiten la reducción del riesgo crediticio en transacciones extrabursátiles favorables celebradas con una sola contraparte por el valor de las transacciones extrabursátiles desfavorables celebradas con ella tras acontecer un suceso de incumplimiento o de rescisión del contrato, ya que todas las transacciones extrabursátiles celebradas con esa contraparte en virtud de ese contrato quedan rescindidas y los saldos debidos por la contraparte y los que se adeudan a ella se liquidan en importes netos.

Los valores de deuda están expuestos al riesgo de que el emisor o el avalista sea incapaz de atender los pagos del principal y los intereses al vencimiento, así como a una volatilidad de precios debida a factores diversos, como la sensibilidad a los tipos de interés. la solvencia del emisor percibida por el mercado y la liquidez general del mismo.

## 9 Inversiones financieras y riesgos asociados (continuación)

#### (c) Riesgo crediticio (continuación)

El Fondo está expuesto a una serie de riesgos relacionados con la quiebra, la administración, la liquidación u otra protección formal frente a acreedores ("Quiebra") del Depositario o de un Subdepositario. Entre estos riesgos figuran los siguientes, a título meramente indicativo:

- 1. La pérdida de todo el efectivo mantenido en el Depositario o Subdepositario que no sea considerado como dinero del cliente tanto en el seno del Depositario como de cualquier Subdepositario ("dinero del cliente").
- 2. La pérdida de todo el efectivo que el Depositario o el Subdepositario haya dejado de considerar como dinero del cliente de conformidad con los procedimientos (si los hubiere) acordados con el Fondo.
- 3. La pérdida de todo o parte de valores cualesquiera mantenidos en fideicomiso que no hayan sido debidamente segregados e identificados así tanto en el seno del Depositario como de cualquier Subdepositario ("Activos en fideicomiso") o dinero del cliente mantenido por el Depositario o el Subdepositario.
- 4. La pérdida de todo o parte de los activos como consecuencia de una gestión inadecuada de cuentas por parte del Depositario o el Subdepositario o debido al proceso de identificación y transferencia de los Activos de fideicomiso aplicables y/o dinero del cliente, incluida la deducción practicada para cubrir los gastos administrativos de una quiebra.
- Pérdidas causadas por retrasos prolongados en la recepción de transferencias de saldos y la recuperación del control sobre los activos pertinentes.

Las quiebras podrían provocar una interrupción severa de la actividad inversora del Fondo; en algunos casos, podría obligar a los Consejeros a suspender temporalmente el cálculo del Valor liquidativo y la negociación de Acciones.

### (d) Riesgos adicionales

### (i) Riesgo de concentración

El Fondo puede invertir en un número limitado de inversiones y temas de inversión. Una de las consecuencias de limitar el número de inversiones es que el rendimiento puede verse afectado en sentido positivo o negativo por la rentabilidad que genera una determinada inversión.

### (ii) Riesgo operativo

El riesgo operativo consiste en la posibilidad de incurrir en pérdidas debidas a una deficiencia de información, comunicación y procesamiento y liquidación de transacciones o que afecte a los sistemas contables. Los proveedores de servicios del Fondo, incluidos los subdepositarios, llevan a cabo controles y procedimientos a fin de asistir en la gestión del riesgo operativo. Periódicamente el Asesor de inversiones examina los niveles de servicio que prestan los proveedores, pero no se garantiza que estas mediciones sean 100 % efectivas.

#### (iii) Riesgos jurídicos, fiscales y normativos

El Fondo puede verse negativamente afectado por posibles cambios legislativos, fiscales o regulatorios.

En cuanto a la tributación, el Fondo puede estar sujeto a un impuesto sobre los incrementos patrimoniales, intereses y dividendos en determinadas jurisdicciones en las que invierte.

La interpretación y aplicación de dichas leyes y normativas por parte de las agencias tributarias en ocasiones puede no ser clara u homogénea. Las obligaciones fiscales, cuando son probables y estimables, se contabilizan como pasivos. Sin embargo, algunas de ellas están expuestas a incertidumbres y pueden dar lugar a obligaciones fiscales adicionales, intereses y sanciones basadas en acciones, interpretaciones o valoraciones futuras por parte de las agencias tributarias encargadas de cubrir posiciones fiscales de ejercicios pasados o en curso. Las normas contables también pueden cambiar, creando o eliminado la obligación del Fondo de asignar un devengo para posibles deudas tributarias.

Por consiguiente, es posible que algunas obligaciones fiscales potenciales que actualmente no son probables lleguen a serlo en el futuro, lo que podría acarrear al Fondo pasivos fiscales adicionales, pudiendo ser estos relevantes. Debido a las incertidumbres antedichas, puede que el valor liquidativo no refleje los pasivos tributarios asumidos en última instancia por el Fondo, por ejemplo en el momento de efectuarse suscripciones, reembolsos o canjes de participaciones en el mismo, lo cual podría afectar negativamente a los inversores existentes en ese momento.

### 9 Inversiones financieras y riesgos asociados (continuación)

#### (d) Riesgos adicionales (continuación)

(iv) Riesgo asociado a mercados no desarrollados

El Fondo puede invertir una parte de su capital en títulos de empresas radicadas en mercados no desarrollados o emergentes, o en valores emitidos por gobiernos de dichos países. Invertir en valores de dichas empresas o países entraña riesgos que no suelen presentarse al invertir en títulos de empresas o países de mercados desarrollados, entre ellos, a título meramente indicativo, el riesgo de una menor liquidez y un mayor precio y volatilidad de las divisas, así como riesgos de carácter fiscal, jurídico y normativo.

(v) Riesgo asociado a empresas de baja capitalización

El Fondo puede invertir una parte de su capital en títulos de empresas de pequeña capitalización. Estas empresas por lo general no son tan conocidas por la comunidad inversora y reciben un seguimiento menor que las empresas de mayor capitalización. Invertir en títulos de este tipo de empresas puede entrañar ciertos riesgos, entre ellos, a título meramente indicativo, el riesgo de una menor liquidez o una mayor volatilidad de precios, así como riesgos asociados a un historial operativo limitado y/o a la disponibilidad de información correspondiente a la empresa y sus operaciones.

#### (vi) Riesgo de selección del SubAsesor de inversiones

Las decisiones de inversión con respecto a Multi-Manager Portfolio serán tomadas por sus Gestores externos. Los Gestores externos de una Multi-Manager Portfolio tomarán las decisiones relacionadas con la compra, la gestión, la disposición u otra realización de las inversiones de la Multi-Manager Portfolio.

No se pretende seleccionar Gestores externos del Grupo Goldman Sachs o de cualquiera de sus filiales. Por este motivo, el Asesor de inversiones no tiene control, de forma directa ni indirecta, sobre los asuntos comerciales o sobre la conducción del mercado de los Gestores externos. Para seleccionar los Gestores externos, el Asesor de inversiones ha llevado a cabo procedimientos de investigación y diligencia razonables, pero, de todas maneras, confía en la información proporcionada por los Gestores externos, así como también en la información relacionada con los Gestores externos que se obtuvo por medio de fuentes independientes y del dominio público.

### (vii) Riesgo de sostenibilidad

El riesgo de sostenibilidad se define en el artículo 3 del Reglamento (UE) 2019/2088 (el "Reglamento sobre divulgación de finanzas sostenibles") como todo acontecimiento o estado medioambiental, social o de gobernanza que, de producirse, podría provocar un impacto negativo significativo, real o potencial, en el valor de las inversiones. Consulte el Anexo I – Divulgación de información con arreglo al Reglamento sobre divulgación de finanzas sostenibles ("SFDR", por sus siglas en inglés) (sin auditar) para obtener información sobre la integración de los riesgos de sostenibilidad en nuestro proceso de toma de decisiones de inversión.

En el Folleto puede hallarse más información sobre los riesgos no mencionados en los presentes estados financieros.

### 10 Tipos de cambio

Se utilizaron los siguientes tipos de cambio (frente al USD) para calcular el Total combinado en el Balance de situación correspondiente al ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021:

Divisa	30-nov-2021
1 euro (EUR)	1,137851 USD
1.000 yenes japoneses (JPY)	8,880995 USD
1 corona noruega (NOK)	0,110530 USD
1 libra esterlina (GBP)	1,335950 USD

Se utilizaron los siguientes tipos de cambio medios (frente al USD) para calcular el Total combinado en la Cuenta de pérdidas y ganancias y en el Estado de variaciones patrimoniales correspondientes al ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021 (salvo en el patrimonio al inicio y al cierre del ejercicio):

Divisa	
1 euro (EUR)	1,189897 USD
1.000 yenes japoneses (JPY)	9,174663 USD
1 corona noruega (NOK)	0,116660 USD
1 libra esterlina (GBP)	1,376760 USD

### 10 Tipos de cambio (continuación)

Se utilizaron los siguientes tipos de cambio para convertir los importes de las monedas locales de la clase de acciones a las monedas de referencia de las Carteras, para el ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021:

	Divisa de referencia				
Divisa de la clase de acciones	le acciones Euro (EUR)		Dólar estadounidense (USD)		
1 dólar australiano (AUD)	0,629432	No aplicable	0,716200		
1 euro (EUR)	No aplicable	128,121978	1,137851		
1 dólar de Hong Kong (HKD)	No aplicable	No aplicable	0,128279		
1.000 yenes japoneses (JPY)	No aplicable	No aplicable	8,880995		
1 corona noruega (NOK)	0,097139	No aplicable	No aplicable		
1 esloti polaco (PLN)	0,214033	No aplicable	0,243537		
1 dólar de Singapur (SGD)	0,644436	No aplicable	0,733272		
1 corona sueca (SEK)	0,097480	12,489324	0,110918		
1 franco suizo (CHF)	0,959443	122,925764	1,091703		
1 libra esterlina (GBP)	1,174100	150,427972	1,335950		
1 dólar estadounidense (USD)	0,878850	112,600000	No aplicable		

#### 11 Retrocesión de comisiones

Cada una de las Carteras podrá ordenar transacciones, siempre y cuando se obtenga un mejor precio y una mejor ejecución, a diferentes agentes que hayan acordado reducir una parte de las comisiones generadas. Dichas reducciones se realizan directamente en las Carteras en cuestión en forma de pagos en efectivo y se reflejan como plusvalías y minusvalías netas materializadas sobre inversiones en la Cuenta de pérdidas y ganancias. En el ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021, no se pagaron comisiones sobre los valores del programa y se reembolsaron a las Carteras.

#### 12 Estado de variaciones de la Cartera

Podrá obtener de manera gratuita un Estado de las variaciones solicitándolo en la sede social.

### 13 Información sobre garantías monetarias

La siguiente tabla proporciona los saldos de garantías de efectivo a pagar por/a pagar por intermediarios financieros en relación con las siguientes inversiones mantenidas a 30 de noviembre de 2021:

Carteras	Divisa	Saldos a pagar por/ a intermediarios	Tipo de inversión	Saldos de garantías monetarias
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	1.791.615
Asia Equity Portfolio	USD	Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Emerging Markets Equity ESC Partfelia	USD	Saldos a pagar por	Derivados cotizados	2.730.386
Emerging Markets Equity ESG Portfolio	080	Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Global Equity Partners Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	_
Global Equity Farthers Fortions	030	Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	600.000
Global Future Technology Leaders Equity Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados cotizados	_
	030	Saldos a pagar a	Derivados cotizados	395

Carteras	Divisa	Saldos a pagar por/ a intermediarios	Tipo de inversión	Saldos de garantías monetarias
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	1.807.166
India Equity Portfolio	USD	Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Janes Fauits Darbass Darbalist	JPY	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	678.953
Japan Equity Partners Portfolio*	JPT	Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	280.000
lance Coult Double !!	JPY	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	379.817
Japan Equity Portfolio*	JPY	Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	5.000
Face against Markets CODE® Face its Double	USD	Saldos a pagar por	Derivados cotizados	5.309.395
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	020	Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	668.864
Furana CORF® Fauity Portfolia	FUR	Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Europe CORE® Equity Portfolio	EUR	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	1.169.736
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	_
F CORF® F 'I. P II'.	FUE	Saldos a pagar por	Derivados cotizados	6.512
Eurozone CORE® Equity Portfolio	EUR	Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	1.745.650
Global CORE® Equity Portfolio	USD	Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	36.576
Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	260.503
US CORE® Equity Portfolio	USD	Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
US CORE Equity Fortions	030	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	420.000
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	_
US Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados cotizados	297.977
	1	Saldos a pagar a	Derivados cotizados	
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	32.479
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Asia High Yield Bond Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	330.000
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	_

Carteras	Divisa	Saldos a pagar por/ a intermediarios	Tipo de inversión	Saldos de garantías monetarias
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	2.094.695
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Emerging Markets Corporate Bond Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	82.085.892
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	510.000
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	345.277
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Emerging Markets Debt Blend Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	21.782.705
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	1.800.000
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	853.514
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Emerging Markets Debt Local Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	43.170.690
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	8.650.000
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	2.312.239
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Emerging Markets Debt Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	179.815.096
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	15.280.000
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	268.845
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
ESG-Enhanced Emerging Markets Short Duration Bond Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	250.000
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	_
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	145.000
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
ESG-Enhanced Euro Short Duration Bond Plus Portfolio	EUR	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	338.420
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	344.616
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	156.722
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
ESG-Enhanced Europe High Yield Bond Portfolio	EUR	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	88.756
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	_
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	62.335
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
ESG-Enhanced Global Income Bond Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	54.593
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	_

Carteras	Divisa	Saldos a pagar por/ a intermediarios	Tipo de inversión	Saldos de garantías monetarias
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	51.672
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio	GBP	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	376.509
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	_
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	2.152.045
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Global Credit Portfolio (Hedged)	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	14.548.697
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	5.520.000
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	237.571
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Global Fixed Income Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	2.113.328
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	300.000
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	1.767.880
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
		Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	33.124.865
Global Fixed Income Portfolio (Hedged)	EUR	Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	8.324.262
		Saldos a pagar por	Títulos con garantía hipotecaria	966.735
		Saldos a pagar a	Títulos con garantía hipotecaria	940.370
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	2.236.281
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Global High Yield Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	6.392.153
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	6.121.819
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	530.149
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Global Sovereign Bond Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	15.148.730
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	5.650.000
Short Duration Opportunistic Corporate	USD	Saldos a pagar por	Derivados cotizados	986.678
Bond Portfolio	1000	Saldos a pagar a	Derivados cotizados	
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	310.668
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados  Derivados	_
US Dollar Short Duration Bond Portfolio	USD	Saldos a pagar por	extrabursátiles (OTC)  Derivados	604.166
		Saldos a pagar a	extrabursátiles (OTC)	550.000

Carteras	Divisa	Saldos a pagar por/ a intermediarios	Tipo de inversión	Saldos de garantías monetarias
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	390.359
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
US Fixed Income Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	1.643.586
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	_
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	145.403
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
		Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	1.015.743
US Mortgage Backed Securities Portfolio	USD	Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	_
		Saldos a pagar por	Títulos con garantía hipotecaria	30.000
		Saldos a pagar a	Títulos con garantía hipotecaria	_
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	13.088
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	77.523
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	_
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	224.119
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
ESG-Enhanced Global Multi-Asset Balanced Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	3.980.000
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	22.109
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	711.067
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Global Multi-Asset Conservative Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	4.830.000
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	_
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	1.808.984
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Global Multi-Asset Growth Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	490.000
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	_

Carteras	Divisa	Saldos a pagar por/ a intermediarios	Tipo de inversión	Saldos de garantías monetarias
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	16.845.762
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Global Multi-Asset Income Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	4.280.000
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	1.623
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	346.491
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
US Real Estate Balanced Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	290.000
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	_
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	405.658
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	
Emerging Markets Total Return Bond Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	10.922.597
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	1.100.000
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	17.361.667
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	
Global Absolute Return Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	22.906.574
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	40.533
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	4.992.978
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Global Dynamic Bond Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	36.988.502
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	710.000
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	3.676.319
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
		Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	85.237.881
Global Dynamic Bond Plus Portfolio	USD	Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	5.750.000
		Saldos a pagar por	Títulos con garantía hipotecaria	290.000
		Saldos a pagar a	Títulos con garantía hipotecaria	270.000
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	1.923.623
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
		Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	45.706.132
Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)	EUR	Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	7.820.480
		Saldos a pagar por	Títulos con garantía hipotecaria	5.703.737
		Saldos a pagar a	Títulos con garantía hipotecaria	5.835.564

### 13 Información sobre garantías monetarias (continuación)

Carteras	Divisa	Saldos a pagar por/ a intermediarios	Tipo de inversión	Saldos de garantías monetarias
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	2.037.986
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
		Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	21.326.963
Global Strategic Macro Bond Portfolio	USD	Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	2.700.000
		Saldos a pagar por	Títulos con garantía hipotecaria	130.000
		Saldos a pagar a	Títulos con garantía hipotecaria	_
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	426.399
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Strategic Absolute Return Bond II Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	7.624.293
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	270.000
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	13.970.132
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Global Corporate Portfolio (Hedged)	NOK	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	942.354.000
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	38.502.878
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	37.776.856
		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
Absolute Return Tracker Portfolio	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	26.190.000
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	1.624.042
		Saldos a pagar por	Derivados cotizados	62.106.105
Alternative Trend Portfolio		Saldos a pagar a	Derivados cotizados	_
	USD	Saldos a pagar por	Derivados extrabursátiles (OTC)	3.191.896
		Saldos a pagar a	Derivados extrabursátiles (OTC)	_

<sup>\*</sup> Expresado en miles.

### 14 Costes de transacción

Se ha determinado que los costes de transacción incluyen los gastos por comisiones del gestor de valores, las comisiones de contratos de futuros, los gastos del mercado y los impuestos relacionados con la compra o venta de acciones e inversiones en otros fondos. Los costes de transacciones basadas en el Depositario están incluidos en los "Gastos de custodia", tal y como se indica en la Cuenta de pérdidas y ganancias.

Durante el ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021, la siguientes Carteras incurrieron en costes de transacción identificados de manera separada:

Carteras	Divisa	Costes de transacción*	% del patrimonio medio
Asia Equity Portfolio	USD	492.152	0,20 %
All China Equity Portfolio	USD	325.249	0,35 %
Emerging Markets Equity ESG Portfolio	USD	1.114.971	0,27 %

#### 14 Costes de transacción (continuación)

Carteras	Divisa	Costes de transacción*	% del patrimonio medio
Emerging Markets Equity Portfolio	USD	7.454.140	0,15 %
Global Environmental Impact Equity Portfolio	USD	1.263.006	0,17 %
Global Equity Income Portfolio	USD	21.967	0,09 %
Global Equity Partners ESG Portfolio	USD	81.650	0,16 %
Global Equity Partners Portfolio	USD	984.244	0,07 %
Global Future Health Care Equity Portfolio	USD	181.782	0,07 %
Global Future Technology Leaders Equity Portfolio	USD	4.024.060	0,09 %
Global Millennials Equity Portfolio	USD	2.012.325	0,09 %
India Equity Portfolio	USD	8.747.243	0,37 %
Japan Equity Partners Portfolio**	JPY	140.479	0,06 %
Japan Equity Portfolio**	JPY	182.766	0,12 %
US Equity Portfolio	USD	205.739	0,03 %
US Focused Growth Equity Portfolio	USD	3.530	0,01 %
US Small Cap Equity Portfolio	USD	55.640	0,09 %
US Technology Opportunities Equity Portfolio	USD	102.257	0,03 %
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	USD	4.772	0,09 %
Global Infrastructure Equity Portfolio	USD	58.071	0,22 %
Global Real Estate Equity Portfolio	USD	31.370	0,07 %
North America Energy & Energy Infrastructure Equity Portfolio	USD	54.186	0,11 %
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	USD	13.544.330	0,45 %
Europe CORE® Equity Portfolio	EUR	3.869.889	0,22 %
Eurozone CORE® Equity Portfolio	EUR	9.219	0,22 %
Global CORE® Equity Portfolio	USD	2.053.298	0,05 %
Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	475.193	0,07 %
US CORE® Equity Portfolio	USD	250.212	0,01 %
US Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	73.016	0,03 %
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio	USD	22.707	0,11 %
ESG-Enhanced Global Multi-Asset Balanced Portfolio	USD	51.458	0,04 %
Global Multi-Asset Conservative Portfolio	USD	4.600	0,00 %
Global Multi-Asset Growth Portfolio	USD	4.854	0,00 %
Global Multi-Asset Income Portfolio	USD	175.983	0,06 %
US Real Estate Balanced Portfolio	USD	9.677	0,00 %
Global Absolute Return Portfolio	USD	60.119	0,02 %
Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio	USD	348.455	0,06 %
Absolute Return Tracker Portfolio	USD	229.614	0,02 %
Total (en USD)***		52.103.272	

Los costes de transacción para inversiones de renta fija, los contratos de divisas a plazo y otros contratos derivados no están identificados de manera separada. Las Carteras que invierten por separado en aquellas inversiones no están incluidas en la tabla anterior.

Nota: la rentabilidad del índice de referencia, con excepción de los impuestos en algunas ocasiones, no incorpora costes de transacción.

#### 15 Comisiones por servicios de análisis y/o ejecución

Algunas Carteras pagarán comisión únicamente por servicios de ejecución y/o por servicios de análisis de inversión y ejecución. Las comisiones de ejecución se reflejan en el precio de la transacción. El Fondo no celebró ningún tipo de acuerdo de comisiones con terceros durante el ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021.

#### 16 Folleto

A 30 de noviembre de 2021, el Folleto más reciente del Fondo se publicó en octubre de 2021.

<sup>\*\*</sup> Expresado en miles.

<sup>\*\*\*</sup> El importe total se calcula utilizando los tipos de cambio indicados en la Nota 10.

#### 17 Ajuste cambiario

En el Estado de variaciones patrimoniales, el valor inicial del Fondo ha sido reformulado a los tipos de cambio vigentes a 30 de noviembre de 2020 y las cifras combinadas se han calculado utilizando los tipos de cambio medios a lo largo de todo el ejercicio. La minusvalía resultante de 653.726.800 USD obedece a la fluctuación de los tipos de cambio ocurrida entre el 1 de diciembre de 2020 y el 30 de noviembre de 2021. Se trata de una minusvalía teórica que no tiene incidencia en el Valor liquidativo de las Carteras individuales.

#### 18 Obligaciones cruzadas

Atendiendo a lo dispuesto en la legislación luxemburguesa, las Carteras están "restringidas" para determinados fines y se considera que constituyen un único conjunto de activos y pasivos, de modo que el derecho a recurrir de los Accionistas y acreedores de cada Cartera estará limitado a los activos mantenidos en dicha Cartera.

#### 19 Pasivos contingentes

A 30 de noviembre de 2021 no había ningún pasivo contingente.

#### 20 Acontecimientos posteriores al cierre

Desde el 30 de noviembre de 2021, existe la firme intención de proceder al cierre de Goldman Sachs Emerging Markets Multi-Asset Portfolio. Actualmente, no se ha confirmado ninguna fecha de cierre.

Las Carteras tienen un valor de mercado limitado en valores rusos, ucranianos y bielorrusos. Estos activos se están valorando para reflejar las limitaciones de liquidez y negociabilidad en el entorno actual. Con el cierre de los mercados rusos locales y la imposición de sanciones a finales de febrero y principios de marzo, actualmente se pueden llevar a cabo pocas gestiones en las carteras, ya que muchos de estos activos están sujetos a sanciones o no pueden liquidarse ni usarse para negociar.

Con posterioridad al ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021, se modificó el nombre de la siguiente Cartera:

Antiguo nombre de la Cartera	tiguo nombre de la Cartera Nuevo nombre de la Cartera	
Global Equity Partners Portfolio	Global Equity Partners ESG Portfolio	19 de enero de 2022

Con posterioridad al ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021, se cerró la siguiente Cartera:

Cartera	Divisa	Fecha de cierre
Global Equity Partners ESG Portfolio	USD	a 19 de enero de 2022

Desde el 1 de diciembre de 2021 hasta el 15 de marzo de 2022, las siguientes Carteras registraron movimientos superiores al 25% del patrimonio:

Cartera	Divisa	% de variación de los activos gestionados	% de variación de la rentabilidad
All China Equity Portfolio	USD	(27,12%)	(30,41%)
Global Equity Income Portfolio	USD	31,79%	(3,92%)
Global Future Technology Leaders Equity Portfolio	USD	(31,34%)	(30,42%)
Global Millennials Equity Portfolio	USD	(27,68%)	(25,01%)
US Focused Growth Equity Portfolio	USD	(27,20%)	(27,23%)
North America Energy & Energy Infrastructure Equity Portfolio	USD	31,27%	17,29%
ESG-Enhanced Emerging Markets Short Duration Bond Portfolio	USD	(37,37%)	(4,57%)
Global Sovereign Bond Portfolio	USD	(36,81%)	(7,49%)
Global Dynamic Bond Plus Portfolio	USD	(26,48%)	(2,44%)

No se produjeron otros acontecimientos posteriores que señalar.

#### 21 Indemnizaciones

El Fondo podrá celebrar contratos que contemplen el pago de una serie de indemnizaciones, aunque se desconoce la cantidad máxima a la que se expondría en virtud de estos acuerdos. Sin embargo, el Fondo no ha recibido reclamaciones de indemnización anteriores ni ha incurrido en pérdidas en virtud de estos contratos.

#### 22 Aprobación de los estados financieros

El 15 de marzo de 2022, el Consejo de Administración procedió a la aprobación de los Estados financieros anuales auditados.

#### 23 Información complementaria

El Asesor de inversiones está sujeto a la Norma 206(4)-2, en su versión modificada, de la Comisión de Valores y Bolsa al amparo de la Ley de Asesores de Inversiones (Investment Advisers Act) ("la Ley") de 1940. Dicho

#### 23 Información complementaria (continuación)

Asesor de inversiones ha resuelto que está obligado a facilitar la siguiente información a todos los inversores y ha determinado qué Carteras deberán facilitarla de conformidad con lo previsto en la Ley. El Asesor de inversiones ha solicitado al Consejo de Administración que recoja esta información en los estados financieros de la Sociedad.

A continuación se presenta un resumen de la rentabilidad total y los resultados de ingresos y gastos de las inversiones correspondiente al ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021:

Global Environmental Impact Equity Portfolio	Divisa	Rentabilidad total <sup>1</sup>	Gastos antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>	Gasto después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3,4</sup>	Ingresos/ (pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	22,26 %	1,68 %	1,68 %	(0,72 %)
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	22,19 %	1,69 %	1,69 %	(0,82 %)
Clase de acciones de acumulación en otras divisas*	EUR	15,40 %	1,69 %	1,69 %	(0,82 %)
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	27,75 %	2,44 %	2,44 %	(1,54 %)
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	29,73 %	0,87 %	0,87 %	0,05 %
Clase de acciones de acumulación "I"	GBP	23,31 %	0,86 %	0,86 %	0,10 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	23,21 %	0,86 %	0,86 %	0,08 %
Clase de acciones "I"*	AUD	18,30 %	0,88 %	0,88 %	(0,19 %)
Clase de acciones "I"	GBP	23,32 %	0,87 %	0,87 %	0,04 %
Clase de acciones "I"	USD	23,26 %	0,86 %	0,86 %	0,17 %
Clase de acciones "IO"*	USD	9,50 %	0,13 %	0,13 %	0,55 %
Clase de acciones de acumulación "P"	GBP	22,58 %	1,41 %	1,41 %	(0,39 %)
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	22,50 %	1,41 %	1,41 %	(0,45 %)
Clase de acciones "P"	GBP	22,66 %	1,40 %	1,40 %	(0,45 %)
Clase de acciones "P"	USD	22,73 %	1,32 %	1,32 %	(0,37 %)
Clase de acciones de acumulación "R"	GBP	23,27 %	0,93 %	0,93 %	0,01 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	23,15 %	0,93 %	0,93 %	0,05 %
Clase de acciones "R"	GBP	22,86 %	0,93 %	0,93 %	0,07 %
Clase de acciones "R"	USD	23,13 %	0,94 %	0,94 %	0,02 %

Global Equity Partners Portfolio	Divisa	Rentabilidad total <sup>1</sup>	Gastos antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>	Gasto después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3,4</sup>	Ingresos/ (pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	20,49 %	1,65 %	1,65 %	(0,77 %)
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)	USD	21,78 %	1,65 %	1,65 %	(0,80 %)
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	20,50 %	1,65 %	1,65 %	(0,77 %)
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)	USD	21,85 %	1,64 %	1,64 %	(0,76 %)
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	27,01 %	1,65 %	1,65 %	(0,78 %)
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	GBP	20,58 %	1,64 %	1,64 %	(0,77 %)
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	21,07 %	1,65 %	1,65 %	(0,77 %)
Clase de acciones en otras divisas	GBP	20,58 %	1,65 %	1,65 %	(0,79 %)
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	20,99 %	1,65 %	1,65 %	(0,77 %)
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	19,89 %	2,15 %	2,15 %	(1,27 %)
Clase de acciones "A"	USD	19,85 %	2,15 %	2,15 %	(1,27 %)
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	26,04 %	2,40 %	2,40 %	(1,53 %)
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	28,05 %	0,83 %	0,83 %	0,04 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	21,46 %	0,83 %	0,83 %	0,03 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	22,03 %	0,83 %	0,83 %	0,04 %

Global Equity Partners Portfolio (continuación)	Divisa	Rentabilidad total <sup>1</sup>	Gastos antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>	Gasto después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3,4</sup>	Ingresos/ (pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)	USD	22,83 %	0,83 %	0,83 %	0,05 %
Clase de acciones "I"	GBP	21,58 %	0,83 %	0,83 %	0,02 %
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en USD)	USD	22,79 %	0,83 %	0,83 %	0,06 %
Clase de acciones de acumulación "IO"	GBP	22,48 %	0,08 %	0,08 %	0,77 %
Clase de acciones de acumulación "IO"*	SEK	4,06 %	0,08 %	0,08 %	0,73 %
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	22,36 %	0,08 %	0,08 %	0,80 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD)	USD	23,73 %	0,08 %	0,08 %	0,81 %
Clase de acciones "IO"	USD	22,38 %	0,08 %	0,08 %	0,78 %
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	20,80 %	1,38 %	1,38 %	(0,51 %)
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD)	USD	22,18 %	1,37 %	1,37 %	(0,51 %)
Clase de acciones "P"	USD	20,81 %	1,37 %	1,37 %	(0,49 %)
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en USD)	USD	22,18 %	1,36 %	1,36 %	(0,48 %)
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	27,94 %	0,90 %	0,90 %	(0,03 %)
Clase de acciones de acumulación "R"	GBP	21,47 %	0,90 %	0,90 %	(0,04 %)
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	21,39 %	0,90 %	0,90 %	(0,01 %)
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	21,94 %	0,90 %	0,90 %	(0,03 %)
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en USD)	USD	22,75 %	0,91 %	0,91 %	(0,01 %)
Clase de acciones "R"	GBP	21,51 %	0,90 %	0,90 %	(0,02 %)
Clase de acciones "R"	USD	21,38 %	0,90 %	0,90 %	(0,02 %)
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	21,96 %	0,90 %	0,90 %	(0,02 %)
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD)	USD	22,72 %	0,90 %	0,90 %	(0,06 %)

Global Future Health Care Equity Portfolio	Divisa	Rentabilidad total <sup>1</sup>	Gastos antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>	Gasto después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3,4</sup>	Ingresos/ (pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	11,87 %	1,74 %	1,74 %	(1,51 %)
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	11,87 %	1,75 %	1,75 %	(1,52 %)
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	17,21 %	2,25 %	2,25 %	(2,01 %)
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	18,92 %	0,98 %	0,98 %	(0,76 %)
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	12,81 %	0,92 %	0,92 %	(0,68 %)
Clase de acciones "I"	USD	12,81 %	0,95 %	0,95 %	(0,68 %)
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	12,16 %	1,48 %	1,48 %	(1,23 %)
Clase de acciones "P"	USD	12,16 %	1,48 %	1,48 %	(1,22 %)
Clase de acciones de acumulación "R"	GBP	12,83 %	1,01 %	1,01 %	(0,75 %)
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	12,71 %	1,00 %	1,00 %	(0,75 %)
Clase de acciones "R"	GBP	12,73 %	0,99 %	0,99 %	(0,75 %)
Clase de acciones "R"	USD	12,81 %	1,00 %	1,00 %	(0,76 %)

Global Future Technology Leaders Equity Portfolio	Divisa	Rentabilidad total <sup>1</sup>	Gastos antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>	Gasto después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3,4</sup>	Ingresos/ (pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	23,23 %	1,64 %	1,64 %	(1,23 %)
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	23,30 %	1,63 %	1,63 %	(1,29 %)
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	29,83 %	1,63 %	1,63 %	(1,23 %)
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	28,88 %	2,37 %	2,37 %	(1,98 %)
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	24,22 %	0,81 %	0,81 %	(0,41 %)

Global Future Technology Leaders Equity Portfolio (continuación)	Divisa	Rentabilidad total <sup>1</sup>	Gastos antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>	Gasto después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3,4</sup>	Ingresos/ (pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>
Clase de acciones "I"*	GBP	15,90 %	0,79 %	0,79 %	(0,37 %)
Clase de acciones "I"	USD	24,23 %	0,81 %	0,81 %	(0,42 %)
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	25,17 %	0,06 %	0,06 %	0,32 %
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	23,60 %	1,36 %	1,36 %	(0,97 %)
Clase de acciones "P"	USD	23,60 %	1,35 %	1,35 %	(0,95 %)
Clase de acciones de acumulación "R"	GBP	24,08 %	0,89 %	0,89 %	(0,43 %)
Clase de acciones de acumulación "R"*	USD	17,70 %	0,88 %	0,88 %	(0,46 %)
Clase de acciones "R"	EUR	30,90 %	0,88 %	0,88 %	(0,47 %)
Clase de acciones "R"	GBP	24,26 %	0,87 %	0,87 %	(0,49 %)
Clase de acciones "R"	USD	24,19 %	0,88 %	0,88 %	(0,48 %)

Global Millennials Equity Portfolio	Divisa	Rentabilidad total <sup>1</sup>	Gastos antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>	Gasto después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3,4</sup>	Ingresos/ (pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	13,44 %	1,66 %	1,66 %	(1,33 %)
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	13,41 %	1,66 %	1,66 %	(1,31 %)
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	19,52 %	1,66 %	1,66 %	(1,33 %)
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	HKD	13,97 %	1,66 %	1,66 %	(1,29 %)
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	SGD	15,39 %	1,67 %	1,67 %	(1,32 %)
Clase de acciones en otras divisas	EUR	19,58 %	1,64 %	1,64 %	(1,31 %)
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	18,65 %	2,41 %	2,41 %	(2,07 %)
Clase de acciones "E"	EUR	18,70 %	2,40 %	2,40 %	(2,08 %)
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	20,54 %	0,84 %	0,84 %	(0,51 %)
Clase de acciones de acumulación "I"	GBP	14,46 %	0,84 %	0,84 %	(0,51 %)
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	14,33 %	0,84 %	0,84 %	(0,51 %)
Clase de acciones "I"	GBP	14,45 %	0,83 %	0,83 %	(0,52 %)
Clase de acciones "I"	USD	14,37 %	0,83 %	0,83 %	(0,51 %)
Clase de acciones "IO"	USD	15,24 %	0,09 %	0,09 %	0,26 %
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	13,74 %	1,39 %	1,39 %	(1,06 %)
Clase de acciones "P"	USD	13,70 %	1,39 %	1,39 %	(1,06 %)
Clase de acciones de acumulación "R"	GBP	14,38 %	0,91 %	0,91 %	(0,59 %)
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	14,26 %	0,91 %	0,91 %	(0,58 %)
Clase de acciones "R"	GBP	14,39 %	0,91 %	0,91 %	(0,58 %)
Clase de acciones "R"	USD	14,28 %	0,91 %	0,91 %	(0,58 %)

India Equity Portfolio	Divisa	Rentabilidad total <sup>1</sup>	Gastos antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>	Gasto después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3,4</sup>	Ingresos/ (pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	41,26 %	1,95 %	1,95 %	(0,89 %)
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	41,33 %	1,94 %	1,94 %	(0,89 %)
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	SEK	49,50 %	1,95 %	1,95 %	(0,94 %)
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	SGD	43,94 %	1,97 %	1,97 %	(1,57 %)
Clase de acciones en otras divisas	GBP	41,21 %	1,96 %	1,96 %	(1,53 %)
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	40,54 %	2,46 %	2,46 %	(1,51 %)
Clase de acciones "A"	USD	40,57 %	2,45 %	2,45 %	(1,42 %)

India Equity Portfolio (continuación)	Divisa	Rentabilidad total <sup>1</sup>	Gastos antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>	Gasto después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3,4</sup>	Ingresos/ (pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	47,59 %	2,45 %	2,45 %	(1,48 %)
Clase de acciones de acumulación "l"	EUR	49,69 %	0,98 %	0,98 %	(0,25 %)
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	42,69 %	0,98 %	0,98 %	(0,13 %)
Clase de acciones "I"	GBP	42,54 %	0,98 %	0,98 %	0,09 %
Clase de acciones "I"	USD	42,68 %	0,98 %	0,98 %	(0,12 %)
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	43,89 %	0,13 %	0,13 %	0,46 %
Clase de acciones de acumulación "P"	EUR	49,07 %	1,42 %	1,42 %	(0,26 %)
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	42,03 %	1,43 %	1,43 %	(0,45 %)
Clase de acciones "P"	USD	42,06 %	1,43 %	1,43 %	(0,99 %)
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	49,63 %	1,05 %	1,05 %	(0,17 %)
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	42,60 %	1,05 %	1,05 %	(0,05 %)
Clase de acciones "R"	GBP	42,44 %	1,05 %	1,05 %	(0,05 %)
Clase de acciones "R"	USD	42,59 %	1,05 %	1,05 %	(0,09 %)

Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	Divisa	Rentabilidad total <sup>1</sup>	Gasto antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>	Gasto después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3,4</sup>	Ingresos/ (pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>
Clase de acciones de acumulación al cierre					
denominada en la divisa de referencia	USD	4,56 %	1,53 %	1,53 %	1,50 %
Clase de acciones puntuales de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	4,61 %	1,53 %	1,53 %	1,39 %
Clase de acciones puntuales denominada en la divisa de referencia	USD	4,63 %	1,52 %	1,52 %	1,65 %
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas	EUR	10,14 %	1,53 %	1,53 %	1,56 %
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas (Long Emerging Markets CCY vs. USD)	CHF	3,30 %	1,53 %	1,53 %	1,44 %
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas (Long Emerging Markets CCY vs. USD)	EUR	3,38 %	1,53 %	1,53 %	1,48 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "A" (Long Emerging Markets CCY vs. USD)	PLN	3,06 %	2,02 %	2,02 %	0,96 %
Clase de acciones puntuales "A"*	USD	(7,90 %)	2,01 %	2,01 %	0,97 %
Clase de acciones de acumulación "E" al cierre	EUR	9,43 %	2,28 %	2,28 %	0,73 %
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	EUR	11,02 %	0,76 %	0,76 %	2,23 %
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	USD	5,29 %	0,76 %	0,76 %	2,21 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "I"	GBP	5,52 %	0,76 %	0,76 %	2,28 %
Clase de acciones "I" al cierre	EUR	11,01 %	0,76 %	0,76 %	2,29 %
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	GBP	6,09 %	0,11 %	0,11 %	2,89 %
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	JPY	14,50 %	0,11 %	0,11 %	2,85 %
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	USD	6,01 %	0,11 %	0,11 %	2,88 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"*	JPY	(3,41 %)	0,09 %	0,09 %	3,56 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"	USD	6,08 %	0,11 %	0,11 %	2,83 %
Clase de acciones puntuales "IO"	USD	6,12 %	0,11 %	0,11 %	2,84 %
Clase de acciones de acumulación "P" al cierre	USD	5,11 %	0,96 %	0,96 %	2,02 %
Clase de acciones "P" al cierre	USD	5,13 %	0,96 %	0,96 %	2,04 %
Clase de acciones de acumulación "R" al cierre	USD	5,27 %	0,82 %	0,82 %	2,25 %
Clase de acciones de acumulación "R" al cierre (Long Emerging Markets CCY vs. USD)	EUR	4,12 %	0,83 %	0,83 %	2,57 %
Clase de acciones "R" al cierre	GBP	5,41 %	0,83 %	0,83 %	2,21 %
Clase de acciones "R" al cierre	USD	5,23 %	0,83 %	0,83 %	2,22 %

Europe CORE® Equity Portfolio	Divisa	Rentabilidad total <sup>1</sup>	Gasto antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>	Gasto después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3,4</sup>	Ingresos/(pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa	EUR	22.00.0/	4.44.0/	4.44.0/	4.50.0/
de referencia  Clase de acciones denominada en la divisa	EUR	23,89 %	1,41 %	1,41 %	1,50 %
de referencia	EUR	23,83 %	1,41 %	1,41 %	1,52 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	USD	17,46 %	1,41 %	1,41 %	1,47 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en USD)	USD	22,93 %	1,40 %	1,40 %	1,51 %
Clase de acciones en otras divisas	GBP	17,61 %	1,41 %	1,41 %	1,64 %
Clase de acciones en otras divisas	USD	17,51 %	1,40 %	1,40 %	1,48 %
Clase de acciones de acumulación "A"	EUR	23,22 %	1,90 %	1,90 %	0,90 %
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	16,91 %	1,90 %	1,90 %	0,91 %
Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)	PLN	21,37 %	1,89 %	1,89 %	0,78 %
Clase de acciones "A"	EUR	23,20 %	1,90 %	1,90 %	1,00 %
Clase de acciones "A"	USD	16,88 %	1,90 %	1,90 %	1,02 %
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	23,26 %	1,90 %	1,90 %	1,00 %
Clase de acciones de acumulación "I"	CHF	20,11 %	0,59 %	0,59 %	2,20 %
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	24,89 %	0,59 %	0,59 %	2,30 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	18,54 %	0,59 %	0,59 %	2,48 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF)	CHF	22,37 %	0,59 %	0,59 %	2,23 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	22,60 %	0,59 %	0,59 %	2,36 %
Clase de acciones "l"	EUR	24,89 %	0,58 %	0,58 %	2,13 %
Clase de acciones de acumulación "IO"	EUR	25,49 %	0,09 %	0,09 %	2,86 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Long European CCY vs. EUR)	SGD	26,64 %	0,09 %	0,09 %	2,84 %
Clase de acciones de acumulación "IS"*	EUR	23,30 %	0,48 %	0,48 %	3,00 %
Clase de acciones de acumulación "P"	EUR	24,24 %	1,14 %	1,14 %	1,78 %
Clase de acciones "P"	EUR	24,16 %	1,15 %	1,15 %	1,85 %
Clase de acciones "P"	GBP	17,96 %	1,14 %	1,14 %	1,79 %
Clase de acciones "P"	USD	17,80 %	1,14 %	1,14 %	1,79 %
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	24,81 %	0,65 %	0,65 %	2,37 %
Clase de acciones "R"	EUR	24,85 %	0,65 %	0,65 %	2,14 %
Clase de acciones "R"	GBP	18,54 %	0,65 %	0,65 %	2,16 %
Clase de acciones "R"	USD	18,30 %	0,65 %	0,65 %	1,94 %

Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	Divisa	Rentabilidad total <sup>1</sup>	Gasto antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>	Gasto después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3,4</sup>	Ingresos/(pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>
Clase de acciones al cierre denominada en la divisa de referencia	USD	22,58 %	1,44 %	1,44 %	0,09 %
Clase de acciones puntuales denominada en la divisa de referencia	USD	23,33 %	1,44 %	1,44 %	0,09 %
Clase de acciones puntuales de acumulación en otras divisas	EUR	29,98 %	1,44 %	1,44 %	0,09 %
Clase de acciones puntuales de acumulación en otras divisas	SEK	31,06 %	1,44 %	1,44 %	0,09 %
Clase de acciones "A" al cierre	USD	21,93 %	1,94 %	1,94 %	(0,41 %)
Clase de acciones puntuales "A"	USD	22,71 %	1,94 %	1,94 %	(0,41 %)
Clase de acciones de acumulación "E" al cierre	EUR	28,59 %	1,94 %	1,94 %	(0,42 %)
Clase de acciones puntuales de acumulación "E"	EUR	29,36 %	1,94 %	1,94 %	(0,41 %)

Global Small Cap CORE® Equity Portfolio (continuación)	Divisa	Rentabilidad total <sup>1</sup>	Gasto antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>	Gasto después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3,4</sup>	Ingresos/(pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	GBP	23,63 %	0,70 %	0,70 %	0,82 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "I"	EUR	30,93 %	0,72 %	0,72 %	0,83 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "I"	USD	24,27 %	0,72 %	0,72 %	0,81 %
Clase de acciones "l" al cierre	GBP	23,55 %	0,72 %	0,72 %	0,81 %
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	GBP	24,31 %	0,12 %	0,12 %	1,42 %
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	JPY	34,14 %	0,12 %	0,12 %	1,41 %
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	USD	24,17 %	0,12 %	0,12 %	1,42 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"*	SEK	2,18 %	0,12 %	0,12 %	1,05 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"	USD	24,95 %	0,12 %	0,12 %	1,40 %
Clase de acciones puntuales "IO"	USD	24,98 %	0,12 %	0,12 %	1,43 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "P"	USD	23,63 %	1,17 %	1,17 %	0,37 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "R"	USD	24,15 %	0,79 %	0,79 %	0,73 %
Clase de acciones puntuales "R"	GBP	24,24 %	0,79 %	0,79 %	0,72 %
Clase de acciones puntuales "R"	USD	24,13 %	0,79 %	0,79 %	0,74 %

		Rentabilidad	Gasto antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto	Gasto después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto	Ingresos/(pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto
Emerging Markets Debt Blend Portfolio	Divisa	total <sup>1</sup>	medio <sup>2,3</sup>	medio <sup>2,3,4</sup>	medio <sup>2,3</sup>
Clase de acciones de acumulación denominada					
en la divisa de referencia	USD	(3,24 %)	1,58 %	1,58 %	3,38 %
Clase de acciones denominada en la divisa					
de referencia	USD	(3,24 %)	1,58 %	1,58 %	3,41 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	(1,15 %)	1,59 %	1,59 %	3,43 %
Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	(1,14 %)	1,59 %	1,59 %	3,43 %
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	(1,64 %)	2,09 %	2,09 %	2,93 %
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	2,78 %	0,82 %	0,82 %	4,19 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	(2,50 %)	0,82 %	0,82 %	4,19 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	(0,39 %)	0,81 %	0,81 %	4,16 %
Clase de acciones "I"	USD	(2,49 %)	0,80 %	0,80 %	4,22 %
Clase de acciones "I" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	(2,39 %)	0,82 %	0,82 %	4,20 %
Clase de acciones "IO" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	(1,68 %)	0,12 %	0,12 %	4,89 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	(2,56 %)	0,87 %	0,87 %	4,15 %
Clase de acciones "R"	USD	(2,58 %)	0,89 %	0,89 %	4,12 %
Clase de acciones "R" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	(2,44 %)	0,89 %	0,89 %	4,13 %

Global High Yield Portfolio	Divisa	Rentabilidad total <sup>1</sup>	Gastos antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>	Gastos después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3,4</sup>	Ingresos/ (pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>
Clase de acciones de acumulación denominada en la					
divisa de referencia	USD	2,99 %	1,24 %	1,24 %	4,12 %
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)	USD	4,12 %	1,24 %	1,24 %	4,11 %
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en SEK)	SEK	2,55 %	1,25 %	1,25 %	4,03 %
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en					
la divisa de referencia	USD	2,97 %	1,24 %	1,24 %	4,10 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en					
la divisa de referencia	USD	3,03 %	1,23 %	1,23 %	4,11 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la					
divisa de referencia (Clase cubierta en duración)	USD	4,09 %	1,24 %	1,24 %	4,11 %

Global High Yield Portfolio (continuación)	Divisa	Rentabilidad total <sup>1</sup>	Gasto antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>	Gasto después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3,4</sup>	Ingresos/(pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>
Clase de acciones denominada en la divisa	Divisa	totai	medio ·	medio ·	medio ·
de referencia	USD	2,98 %	1,24 %	1,24 %	4,11 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)	USD	4,09 %	1,24 %	1,24 %	4,11 %
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis)	HKD	3,57 %	1,23 %	1,23 %	4,11 %
Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (AUD) cubierta en CHF)	AUD	2,59 %	1,24 %	1,24 %	4,08 %
Clase de acciones en otras divisas (trimestral) (Dis) (Clase cubierta en CHF) (Clase cubierta en duración)	CHF	2,97 %	1,24 %	1,24 %	4,10 %
Clase de acciones en otras divisas (trimestral) (Dis) (Clase cubierta en SGD) (Clase cubierta en duración)	SGD	4,09 %	1,24 %	1,24 %	4,10 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) (Clase cubierta en duración)	CHF	3,09 %	1,24 %	1,24 %	4,11 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas		0,00 70	1,21 70	1,21 70	1,11 /0
(Clase cubierta en EUR)	EUR	2,13 %	1,24 %	1,24 %	4,13 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	3,27 %	1,24 %	1,24 %	4,10 %
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF)	CHF	1,90 %	1,23 %	1,23 %	4,14 %
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en GBP)	GBP	2,93 %	1,24 %	1,24 %	4,09 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"	USD	2,74 %	1,49 %	1,49 %	3,82 %
Clase de acciones "A"	USD	2,69 %	1,49 %	1,49 %	3,86 %
Clase de acciones "B"	USD	1,74 %	2,47 %	2,47 %	2,86 %
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E"	EUR	1,56 %	1,74 %	1,74 %	3,63 %
(Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	2,87 %	1,74 %	1,74 %	3,61 %
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	8,01 %	1,74 %	1,74 %	3,60 %
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1,61 %	1,74 %	1,74 %	3,61 %
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	2,81 %	1,74 %	1,74 %	3,62 %
Clase de acciones "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	2,20 %	1,24 %	1,24 %	4,10 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) "I"	USD	3,56 %	0,67 %	0,67 %	4,68 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	2,77 %	0,65 %	0,65 %	4,68 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	3,56 %	0,67 %	0,67 %	4,66 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en duración)	USD	4,68 %	0,67 %	0,67 %	4,66 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	2,74 %	0,67 %	0,67 %	4,54 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	3,47 %	0,67 %	0,67 %	4,86 %
Clase de acciones "I"	EUR	9,15 %	0,67 %	0,67 %	4,66 %
Clase de acciones "I"	USD	3,47 %	0,67 %	0,67 %	4,67 %
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	2,75 %	0,67 %	0,67 %	4,73 %
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	3,46 %	0,67 %	0,67 %	4,66 %
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP) (Clase cubierta en duración)	GBP	4,68 %	0,62 %	0,62 %	4,65 %
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "IO" (Clase cubierta en AUD)	AUD	3,86 %	0,07 %	0,07 %	5,27 %
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	4,18 %	0,07 %	0,07 %	5,39 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en EUR)	EUR	3,31 %	0,07 %	0,07 %	5,23 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)	GBP	4,06 %	0,07 %	0,07 %	5,24 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en JPY)	JPY	3,75 %	0,07 %	0,07 %	5,26 %
Clase de acciones "IO"	USD	4,22 %	0,07 %	0,07 %	5,27 %
Clase de acciones de acumulación "IS"	USD	3,63 %	0,55 %	0,55 %	4,76 %

		Rentabilidad	Gasto antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto	Gasto después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto	Ingresos/(pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto
Global High Yield Portfolio (continuación)	Divisa	total <sup>1</sup>	medio <sup>2,3</sup>	medio <sup>2,3,4</sup>	medio <sup>2,3</sup>
Clase de acciones de acumulación "IS" (Clase cubierta en CHF)	CHF	2,63 %	0,55 %	0,55 %	4,74 %
Clase de acciones de acumulación "IS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	2,88 %	0,55 %	0,55 %	4,74 %
Clase de acciones de acumulación "IS" (Clase cubierta en GBP)	GBP	3,62 %	0,52 %	0,52 %	4,86 %
Clase de acciones "IS"	USD	3,69 %	0,55 %	0,55 %	4,81 %
Clase de acciones "IS" (Clase cubierta en GBP)	GBP	3,59 %	0,55 %	0,55 %	4,66 %
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	3,16 %	1,03 %	1,03 %	4,19 %
Clase de acciones "P"	USD	3,21 %	1,03 %	1,03 %	4,13 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en AUD)	AUD	3,18 %	0,74 %	0,74 %	4,58 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	3,45 %	0,74 %	0,74 %	4,59 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF)	CHF	2,37 %	0,74 %	0,74 %	4,58 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF) (Clase cubierta en duración)	CHF	3,53 %	0,74 %	0,74 %	4,63 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en duración)	USD	4,61 %	0,74 %	0,74 %	4,65 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	2,59 %	0,74 %	0,74 %	4,59 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	3,79 %	0,74 %	0,74 %	4,59 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en SEK)	SEK	3,06 %	0,74 %	0,74 %	4,59 %
Clase de acciones "R"	USD	3,45 %	0,74 %	0,74 %	4,57 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en CHF)	CHF	2,44 %	0,74 %	0,74 %	4,61 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en duración)	USD	4,72 %	0,74 %	0,74 %	4,60 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	2,70 %	0,74 %	0,74 %	4,61 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	3,46 %	0,74 %	0,74 %	4,61 %

Dhart David an Constant of the Constant David David Ha	Distan	Rentabilidad	Gasto antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>	Gasto después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3,4</sup>	Ingresos/(pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>
Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la	Divisa	totai	medio <sup>2,0</sup>	medio2,0,4	medio-,-
divisa de referencia	USD	2,07 %	1,79 %	1,75 %	2,76 %
Clase de acciones (trimestral) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	2,06 %	1,79 %	1,75 %	2,76 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	2,06 %	1,79 %	1,75 %	2,76 %
Clase de acciones en otras divisas (trimestral) (Dis) (Clase cubierta en EUR)	EUR	1,29 %	1,80 %	1,75 %	2,75 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	1,29 %	1,82 %	1,75 %	2,79 %
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "A"	USD	1,55 %	2,29 %	2,25 %	2,26 %
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	0,79 %	2,29 %	2,25 %	2,26 %
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	7,04 %	2,29 %	2,24 %	2,24 %
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	0,79 %	2,29 %	2,25 %	2,25 %
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	2,78 %	0,92 %	0,91 %	3,59 %
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	8,52 %	0,90 %	0,89 %	3,62 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	2,92 %	0,92 %	0,91 %	3,59 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	2,15 %	0,92 %	0,91 %	3,60 %
Clase de acciones "I"	USD	2,92 %	0,92 %	0,91 %	3,60 %
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "P"	USD	2,58 %	1,27 %	1,25 %	3,28 %
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	2,57 %	1,27 %	1,25 %	3,26 %
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1,81 %	1,27 %	1,25 %	3,31 %

Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio (continuación)	Divisa	Rentabilidad total <sup>1</sup>	Gasto antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>	Gasto después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3,4</sup>	Ingresos/(pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>
Clase de acciones "P"	USD	2,57 %	1,27 %	1,25 %	3,27 %
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1,87 %	1,18 %	1,17 %	3,33 %
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)	GBP	2,46 %	1,27 %	1,25 %	3,26 %
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "R"	USD	2,88 %	0,99 %	0,95 %	3,56 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	2,87 %	1,00 %	0,95 %	3,56 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	2,19 %	0,88 %	0,84 %	3,64 %
Clase de acciones "R"	USD	2,89 %	0,99 %	0,95 %	3,56 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	2,11 %	0,99 %	0,95 %	3,56 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	2,79 %	0,98 %	0,94 %	3,56 %

		Rentabilidad	Gasto antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio 2 2	Gasto después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto	Ingresos/(pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto
Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)	Divisa	total <sup>1</sup>	medio <sup>2,3</sup>	medio <sup>2,3,4</sup>	medio <sup>2,3</sup>
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	EUR	(3,51 %)	1,15 %	1,15 %	1,18 %
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)	USD	(2,75 %)	1,15 %	1,15 %	1,12 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	EUR	(3,50 %)	1,15 %	1,15 %	1,18 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)	USD	(2,67 %)	1,15 %	1,15 %	1,22 %
Clase de acciones "A"	EUR	(3,81 %)	1,41 %	1,41 %	0,90 %
Clase de acciones "A" (Clase cubierta en USD)	USD	(3,00 %)	1,41 %	1,41 %	0,91 %
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	(3,72 %)	1,40 %	1,40 %	0,89 %
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	(2,93 %)	0,59 %	0,59 %	1,72 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD)*	AUD	0,40 %	0,58 %	0,58 %	1,63 %
Clase de acciones de acumulación "I"(Clase cubierta en USD)	USD	(2,17 %)	0,58 %	0,58 %	1,71 %
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	(2,23 %)	0,58 %	0,58 %	1,73 %
Clase de acciones (semestral) (Dis) "IO"*	EUR	(2,39 %)	0,09 %	0,09 %	2,22 %
Clase de acciones de acumulación "IO"	EUR	(2,51 %)	0,03 %	0,03 %	2,49 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)	GBP	(1,81 %)	0,08 %	0,08 %	2,42 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en SEK)*	SEK	(1,59 %)	0,11 %	0,11 %	2,08 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD)	USD	(1,78 %)	0,08 %	0,08 %	2,39 %
Clase de acciones "IO" (Clase cubierta en USD)	USD	(1,64 %)	0,09 %	0,09 %	2,23 %
Clase de acciones de acumulación "P"	EUR	(3,34 %)	0,93 %	0,93 %	1,38 %
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD)	USD	(2,54 %)	0,94 %	0,94 %	1,35 %
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)	GBP	(2,58 %)	0,92 %	0,92 %	1,41 %
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	(3,06 %)	0,66 %	0,66 %	1,66 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en USD)	USD	(2,25 %)	0,65 %	0,65 %	1,65 %
Clase de acciones "R"	EUR	(3,00 %)	0.65 %	0.65 %	1.65 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	(2,38 %)	0,65 %	0,65 %	1,66 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD)	USD	(2,30 %)	0,65 %	0,65 %	1,68 %

#### 23 Información complementaria (continuación)

Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio	Divisa	Rentabilidad total <sup>1</sup>	Gasto antes de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio2,3	Gasto después de renuncias/ reembolsos al patrimonio neto medio <sup>2,3,4</sup>	Ingresos/(pérdidas) netos de inversiones respecto al patrimonio neto medio <sup>2,3</sup>
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	21,87 %	1,34 %	1,34 %	(0,27 %)
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	21,88 %	1,34 %	1,34 %	(0,27 %)
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	28,45 %	1,34 %	1,34 %	(0,27 %)
Clase de acciones "I"	USD	22,36 %	0,92 %	0,92 %	0,15 %
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	22,73 %	0,64 %	0,64 %	0,43 %
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	29,25 %	0,70 %	0,70 %	0,40 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	22,62 %	0,69 %	0,69 %	0,38 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	21,53 %	0,70 %	0,69 %	0,41 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	22,03 %	0,69 %	0,69 %	0,39 %
Clase de acciones "R"	USD	22,62 %	0,69 %	0,69 %	0,36 %

<sup>\*</sup> Clases de acciones lanzadas durante el ejercicio. La rentabilidad total no ha sido anualizada.

#### Activos y pasivos financieros expresados al valor razonable

A continuación se describen los tres niveles de que consta la jerarquía de valores razonables contemplada en la Norma 820 de la Accounting Standards Codification (Codificación de Normas Contables, "ASC", por sus siglas en inglés):

Nivel 1 — Precios no ajustados cotizados en mercados operativos que son accesibles en la fecha de medición para activos o pasivos idénticos no restringidos.

Nivel 2 – Precios cotizados en mercados que no están operativos o instrumentos financieros de los cuales se conocen datos significativos observables (incluidos, sin carácter limitativo, los precios cotizados de valores similares, tipos de interés, tipos de cambio de divisas, volatilidad y diferenciales de riesgo crediticio), ya sea directa o indirectamente.

Nivel 3 — Precios o valoraciones que precisan datos significativos no observables (incluidas las hipótesis que utilizan los Tasadores para determinar la medición por valor razonable).

El nivel asignado en la jerarquía de valores razonables en el cual se clasifica la medición por valor razonable en su totalidad se determinará a partir de la información de nivel más bajo que sea relevante para realizar dicha medición en su totalidad. A estos efectos, la relevancia de una información se define en función de la medición por valor razonable en su totalidad. Si una medición por valor razonable emplea datos observables que requieren un ajuste importante basado en datos no observables, estaremos ante una medición de Nivel 3. Definir la relevancia de un determinado dato con respecto a una medición por valor razonable en su totalidad exige emitir un juicio de valor, considerando los factores específicos de ese activo o pasivo.

Global Environmental Impact Equity Portfolio	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD				
Activos financieros valorados a su valor razonable								
Acciones ordinarias	1.082.912.104	262.672.289	_	1.345.584.393				
Fondos de inversión	31	_	_	31				
Total	1.082.912.135	262.672.289		1.345.584.424				

<sup>&</sup>lt;sup>1</sup> Las rentabilidades totales se calculan dividiendo la variación del valor liquidativo por acción durante el ejercicio entre el valor liquidativo por acción al comienzo del ejercicio. La rentabilidad destinada a cada accionista puede diferir de las rentabilidades mostradas dependiendo del momento en que se celebren las transacciones de capital.

<sup>&</sup>lt;sup>2</sup> Los porcentajes de gastos totales e ingresos netos derivados de las inversiones se calculan para cada grupo de accionistas en su conjunto. De conformidad con las normas exigidas por SEC 206(4)-2, este porcentaje no incluye las plusvalías y minusvalías materializadas de los ingresos netos de inversiones. El cálculo de dichos porcentajes basado en el importe de ingresos y gastos evaluados con respecto al capital de un accionista específico puede diferir de estos porcentajes dependiendo del momento en que se celebren las transacciones de capital.

<sup>&</sup>lt;sup>3</sup> Consulte la Nota 6 sobre los Principales acuerdos y Partes relacionadas para obtener más detalles sobre los gastos de renuncias/reembolsos.

<sup>&</sup>lt;sup>4</sup> Incluye una comisión adicional pagada al Asesor de inversiones respecto a clases de acciones de comisión fija.

#### 23 Información complementaria (continuación)

Activos y pasivos financieros expresados al valor razonable (continuación)

Global Equity Partners Portfolio	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros valorados a su valor razonable	l	J		
Acciones ordinarias	1.514.427.115	180.551.808	_	1.694.978.923
Fondos de inversión	40.505.510	_	_	40.505.510
Plusvalía latente sobre contratos		1 600 052		1.688.953
de divisas a plazo	_	1.688.953	_	1.000.953
Total	1.554.932.625	182.240.761	_	1.737.173.386
	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3	Total
Global Future Health Care Equity Portfolio	USD	USD	USD	USD
Activos financieros valorados a su valor razonable				
Acciones ordinarias	293.474.309	24.796.472	_	318.270.781
Fondos de inversión	9.296.287	_	_	9.296.287
Total	302.770.596	24.796.472	_	327.567.068
Global Future Technology Leaders Equity	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3	Total
Portfolio	USD	USD	USD	USD
Activos financieros valorados a su valor razonable				
Acciones ordinarias	4.162.492.673	1.369.511.429	_	5.532.004.102
Total	4.162.492.673	1.369.511.429	_	5.532.004.102
		1		
Global Millennials Equity Portfolio	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros valorados a su valor razonable				
Acciones ordinarias	2.406.562.527	372.972.191	_	2.779.534.718
Fondos de inversión	98.210.396	-	_	98.210.396
Total	2.504.772.923	372.972.191	_	2.877.745.114
		0.2.0.20		
India Equity Portfolio	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros valorados a su valor razonable				
Acciones ordinarias	340.822.610	2.011.243.827	_	2.352.066.437
Total	340.822.610	2.011.243.827	_	2.352.066.437
	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3	Total
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	USD	USD	USD	USD
Activos financieros valorados a su valor razonable	700 000 407	0.000.000.707		0.774.000.004
Acciones ordinarias	708.296.497	2.063.009.767	_	2.771.306.264
Fondos de inversión	24.897.197			24.897.197
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	_	10.099	_	10.099
Total	733.193.694	2.063.019.866	_	2.796.213.560
Europe CORE® Equity Portfolio	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros valorados a su valor razonable				
Acciones ordinarias	1.657.947.191	43.252.674	_	1.701.199.865
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	6.076	_	_	6.076
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	_	321.120	_	321.120
Total	1.657.953.267	43.573.794	_	1.701.527.061

#### 23 Información complementaria (continuación)

Activos y pasivos financieros expresados al valor razonable (continuación)

Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros valorados a su valor razonable				
Acciones ordinarias	629.584.786	77.816.874	_	707.401.660
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	_	1.028	_	1.028
Total	629.584.786	77.817.902	_	707.402.688
Emerging Markets Debt Blend Portfolio	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros valorados a su valor razonable				
Bonos	_	598.255.380	_	598.255.380
Acciones ordinarias	44.270	_	_	44.270
Fondos de inversión	23.609.196	_	_	23.609.196
Contratos a plazo sobre bonos no entregables	_	12.709	_	12.709
Opciones adquiridas	_	976.865	_	976.865
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	837.371	_	_	837.371
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	_	12.592.049	_	12.592.049
Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	_	5.321.222	_	5.321.222
Total	24.490.837	617.158.225	_	641.649.062
	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3	Total
Global High Yield Portfolio	USD	USD	USD	USD
Activos financieros valorados a su valor razonable				
Bonos	_	2.898.578.329	_	2.898.578.329
Acciones ordinarias	4.841.261	6.419.686	_	11.260.947
Acciones preferentes	_	2.217.880	_	2.217.880
Warrants	_	66.273	_	66.273
Fondos de inversión	56.378.028	_	_	56.378.028
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	1.642.618	_		1.642.618
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	_	— 14.963.686		14.963.686
Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	_	4.371.105	_	4.371.105
Total	62.861.907	2.926.616.959	_	2.989.478.866
	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3	Total
Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio	USD	USD	USD	USD
Activos financieros valorados a su valor razonable				
Bonos	_	178.682.246	_	178.682.246
Acciones ordinarias	_	842.076	_	842.076
Fondos de inversión	2.209	_		2.209
Depósitos a plazo	_	13.345.971	_	13.345.971
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	215.143	_	_	215.143
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	_	159.560		159.560
Total	217.352	193.029.853	_	193.247.205

#### 23 Información complementaria (continuación)

Activos y pasivos financieros expresados al valor razonable (continuación)

Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR	
Activos financieros valorados a su valor razonable					
Bonos	532.489.349	835.942.924	2.802.009	1.371.234.282	
Obligaciones con garantía de activos emitidos o garantizados por agencias	_	229.176.620	_	229.176.620	
Obligaciones con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias	_	216.480.781	7.638.543	224.119.324	
Fondos de inversión	52.207.304		_	52.207.304	
Opciones adquiridas	_	3.564.833	_	3.564.833	
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	8.094.895	_	_	8.094.895	
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	_	38.847.961	_	38.847.961	
Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	_	8.800.249	_	8.800.249	
Total	592.791.548	1.332.813.368	10.440.552	1.936.045.468	

Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros valorados a su valor razonable				
Acciones ordinarias	569.409.536	36.971.765	_	606.381.301
Warrants	_	324.615	_	324.615
Fondos de inversión	27.551.610	_		27.551.610
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	_	11.385	_	11.385
Total	596.961.146	37.307.765	-	634.268.911

Las siguientes tablas muestran los pasivos financieros contabilizados al valor razonable, analizados entre los tres niveles distintos descritos anteriormente:

Global Equity Partners Portfolio	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD	
Pasivos financieros valorados a su valor razonable					
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	_	299.340	_	299.340	
Total	_	299.340	_	299.340	
India Equity Portfolio	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD	
Pasivos financieros valorados a su valor razonable					
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	666.908	_	_	666.908	
Total	666.908	_	_	666.908	
	1				
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD	
Pasivos financieros valorados a su valor razonable					
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	2.234.800	_	_	2.234.800	
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	_	480	_	480	
Total	2.234.800	480	_	2.235.280	
Europe CORE® Equity Portfolio	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR	
Pasivos financieros valorados a su valor razonable					
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	115.253	_	_	115.253	
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	_	2.437.888		2.437.888	
Total	115.253	2.437.888	_	2.553.141	

#### 23 Información complementaria (continuación)

Activos y pasivos financieros expresados al valor razonable (continuación)

Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros valorados a su valor razonable	035	035	035	030
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	6.142	[		6.142
Minusvalía latente sobre contratos de luturos  Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	0.142	5.631	_	5.631
Total	6.142	5.631	_	11.773
Total	6.142	5.631		11.773
		,		
Emerging Markets Debt Blend Portfolio	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Tota USD
Pasivos financieros valorados a su valor razonable				
Opciones suscritas	_	878.811	_	878.811
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	-	19.844.305	-	19.844.305
Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	_	2.454.408	_	2.454.408
Total	_	23.177.524	-	23.177.524
Global High Yield Portfolio	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros valorados a su valor razonable		•	•	
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	1.758.575	_	-[	1.758.575
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	_	4.998.865	_	4.998.865
Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	_	1.490.815	_	1.490.815
Total	1.758.575	6.489.680	_	8.248.255
		•		
	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3	Total
Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio	USD	USD	USD	USD
Pasivos financieros valorados a su valor razonable				
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	862.686	_	_	862.686
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	_	193.402	_	193.402
Total	862.686	193.402	_	1.056.088
Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Pasivos financieros valorados a su valor razonable	'	<u>'</u>	'	
Valores hipotecarios a plazo cubiertos	_	11.049.474	_	11.049.474
Opciones suscritas	_	9.912.488	_	9.912.488
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	940.207	_	_	940.207
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	_	36.521.413	_	36.521.413
Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	_	18.253.727	_	18.253.727
Total	940,207	75.737.102	_	76.677.309
Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros valorados a su valor razonable				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	_	233.591	_[	233.591
Total	_	233.591	_	233.591

La siguiente tabla muestra una conciliación de variaciones en el valor razonable de los instrumentos financieros clasificados en el Nivel 3 entre el inicio y el final del ejercicio objeto de este informe.

#### 23 Información complementaria (continuación)

Activos y pasivos financieros expresados al valor razonable (continuación)

Activos financieros medidos al valor razonable basados en el Nivel 3					
Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)					
	Activos financieros a valor razonable con cambios en resultados				
	Bon				
Saldo a 30-nov-2020	EUR	2.612.820	7.184.364		
Compras	EUR	_	_		
Ventas	EUR	_	(3.710)		
Liquidaciones	EUR	_	_		
Traspasos al Nivel 3	EUR	_	_		
Traspasos desde el Nivel 3	EUR	_	_		
Plusvalías o minusvalías totales registradas en el periodo como beneficio o pérdida	EUR	189.189	457.889		
Saldo a 30-nov-2021	EUR	2.802.009	7.638.543		
Plusvalías o minusvalías totales incluidas en el periodo para los activos mantenidos a 30-nov-2021	EUR	189.189	457.889		

#### 24 Inversiones cruzadas en subfondos

A 30 de noviembre de 2021, el total de las inversiones cruzadas en subfondos ascendía a 620.777.733 USD y, por consiguiente, el Patrimonio neto combinado total al cierre del ejercicio sin inversión cruzada en subfondos ascendería a 69.027.540.720 USD.

### Goldman Sachs Funds—Asia Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	
	rios admitidos a cotización en una	bolsa de valo	res oficial	
Acciones ordina	arias – 92,64 %			
105 806	Alibaba Group Holding Ltd.—ADR(8)	13.774.952	5,77	
	ANTA Sports Products Ltd.	2.295.299	0,96	
	China Feihe Ltd. 144A(b)	2.269.615	0,95	
312.000	China Merchants Bank Co., Ltd. "H"	2.427.911	1,02	
	Ecovacs Robotics Co., Ltd. "A"	1.034.510	0,43	
	Full Truck Alliance Co., Ltd.—ADR <sup>(a)</sup>	304.549	0,13	
	Hangzhou Robam Appliances Co., Ltd. "A"	1.193.825	0,50	
	Kweichow Moutai Co., Ltd. "A" Luxshare Precision Industry Co., Ltd. "A"	11.728.874	4,92 0,79	
234 400	Meituan "B" 144A <sup>(b)</sup>	7.234.037	3,03	
	Minth Group Ltd.	1.071.501	0,45	
	New Oriental Education & Technology Group, Inc.—ADR <sup>(a)</sup>	1.402.000	0,59	
547.500	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. "H"	3.823.017	1,60	
59.407	Qingdao Haier Biomedical Co., Ltd. "A"	845.267	0,35	
119.300	Shenzhou International Group	0.005.055		
14 214	Holdings Ltd.	2.265.837	0,95	
	Silergy Corp. Sunny Optical Technology Group	2.417.544	1,01	
03.000	Co., Ltd.	2.551.371	1,07	
+ 341.500	Tencent Holdings Ltd.	20.180.369	8,46	
1.106.000	Topsports International Holdings Ltd.			
50.000	144A <sup>(b)</sup>	1.292.653	0,54	
	Wuliangye Yibin Co., Ltd. "A" WuXi AppTec Co., Ltd. "H" 144A(b)	1.750.537 2.043.891	0,73	
	Yunnan Aluminium Co., Ltd. "A"	1.442.720	0,86 0,60	
	Zepp Health Corp.—ADR <sup>(a)</sup>	275.572	0,12	
		85.508.032	35,83	
Hong Kong				
	AIA Group Ltd.	2.745.479	1,15	
	China Mengniu Dairy Co., Ltd.	1.814.860	0,76	
48.901	Hong Kong Exchanges & Clearing			
	Ltd.	2.714.814	1,14	
	Sino Biopharmaceutical Ltd.	1.655.453	0,69	
55.000	Techtronic Industries Co., Ltd.	1.141.462	0,48	
		10.072.068	4,22	
India 43.259	Bajaj Finance Ltd.	4.043.515	1,69	
	Computer Age Management			
172.664	Services Ltd. Crompton Greaves Consumer	1.035.474	0,43	
	Electricals Ltd.	1.031.943	0,43	
24.578	Divi's Laboratories Ltd.	1.598.019	0,67	
	Hindustan Unilever Ltd.	5.397.413	2,26	
	ICICI Bank Ltd. ICICI Lombard General Insurance	2.197.801	0,92	
116 004	Co., Ltd. 144A(b) Infosys Ltd.	1.277.626 2.683.600	0,54 1,12	
	Infosys Ltd.—ADR <sup>(a)</sup>	636.593	0,27	
	Maruti Suzuki India Ltd.	6.013.711	2,52	
	Navin Fluorine International Ltd.	2.917.547	1,22	
	51.666 Route Mobile Ltd.		0,53	
	57.895 SBI Life Insurance Co., Ltd. 144A(b)		0,38	
	57.681 Sona BLW Precision Forgings Ltd. 144A(b)		0,66	
	TeamLease Services Ltd.	1.254.847	0,53	
	Wipro Ltd. Zomato Ltd.	1.716.434 2.296.527	0,72 0,96	
1.131.305	Zomato Ltu.	37.826.816	15,85	
Indonesia				
	Bank BTPN Syariah Tbk PT	961.674	0,40	

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% de patrimonio
Acciones ordina	arias – (continuación)		
Indonesia – (cont	•		
	Bank Central Asia Tbk PT	3.063.945	1,28
	BFI Finance Indonesia Tbk PT	917.470	0,39
	Map Aktif Adiperkasa PT	287.500	0,12
	Pakuwon Jati Tbk PT	451.967	0,19
586.838	Semen Indonesia Persero Tbk PT	6.010.928	0,14
Filinings		0.010.926	2,52
Filipinas 430 800	Del Monte Pacific Ltd.	115.559	0,0
	Jollibee Foods Corp.	900.588	0,38
	Monde Nissin Corp. 144A(b)	1.685.998	0,70
	·	2.702.145	1,13
Singapur			<u> </u>
	Nanofilm Technologies International		
	Ltd.	2.306.103	0,97
	Sea Ltd.—ADR <sup>(a)</sup>	1.303.780	0,5
30.893	TDCX, Inc.—ADR <sup>(a)</sup>	577.699	0,24
		4.187.582	1,76
Corea del Sur			
	Fila Holdings Corp.	826.462	0,3
	Hankook Tire & Technology Co., Ltd.	678.419	0,28
	KB Financial Group, Inc.	1.084.005	0,45
	Krafton, Inc.	1.168.684	0,49
	LG Electronics, Inc.	1.706.673	0,72
	NAVER Corp.	2.382.500	1,00
	NCSoft Corp.	6.861.022	2,87
	NHN KCP Corp.	688.745	0,29
	Orion Corp.	292.609	0,12
	Samsung Electronics Co., Ltd.	9.869.109	4,14
68.318	SK Hynix, Inc.	6.592.268 32.150.496	13,47
 Taiwán		32.130.490	13,47
	Largan Precision Co., Ltd.	5.654.743	2,37
	MediaTek, Inc.	1.673.204	0,70
	momo.com, Inc.	1.419.095	0,59
	Nien Made Enterprise Co., Ltd.	833.678	0,35
	Taiwan Semiconductor Manufacturing	24.409.442	
212 000	Co., Ltd. Taiwan Union Technology Corp.	779.913	10,23 0,33
	Tong Hsing Electronic Industries Ltd.	575.881	0,34
	United Microelectronics Corp.	2.076.219	0,87
		37.422.175	15,68
Tailandia			
1.308.400	Airports of Thailand PCL	2.325.052	0,98
Estados Unidos			
	Samsonite International S.A. 144A <sup>(b)</sup>	1.073.055	0,45
Vietnam 461.210	Vietnam Dairy Products JSC	1.780.681	0,75
TOTAL DE ACCIO	ONES ORDINARIAS		
(coste USD 185.6	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	221.059.030	92,64
Fondos de inver Irlanda	rsión – 4,05 %		
	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid		
	Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X) <sup>(c)(d)</sup>	9.659.057	4,05
	OS DE INVERSIÓN		
COSTE USD 9.659	.057) RES MOBILIARIOS ADMITIDOS	9.659.057	4,05
A COTIZACIÓN E	N UNA BOLSA DE VALORES		
OFICIAL (coste USD 195.3	20.145)	230.718.087	96,69

#### Goldman Sachs Funds—Asia Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

EXCLU	JYEND	00	DERIVA		ERSION	ES			
(coste	USD 1	195.	320.145	)			230	0.718.087	96,69
Contra	atos d	le fi	uturos ·	- (0,23 %)					
	lúmero de contratos Descripción del valor			de mercad a asignació en US	ón	linusvalía latente en USD	% del patrimonio		
	126 F		ros sobr	e el Hang 80/12/2021	Larga	18.971.52	22	(553.749)	(0,23)
			TENTE E FUTUI	SOBRE		,		(553.749)	(0,23)
Contra	atos d	le d	livisas	a plazo – 0,	00 %				
Divisa	Com	pra	Divisa	Venta	Fech	na de vencir	niento	Minusvalía latente en USD	% del patrimonio
USD	29.4	121	PHP	1.485.856		01/12	2/2021	(69)	(0,00)
USD	20.2	258	PHP	1.022.926		02/12	2/2021	(45)	(0,00)
MINUS				SOBRE CO	NTRATO	OS DE		(114)	(0,00)
			CADO I 320.145	DE LAS INVI	ERSION	ES		230.164.224	96,46
OTROS	SACT	IVO	S Y PAS	sivos				8.463.403	3,54
PATRI	MONIC	)						238.627.627	100,00
TOTAL	. DE IN	IVE	RSIONE	:s				Valor de mercado en USD	% del patrimonio
				ndo derivado	os		23(	0.718.087	96,69
(coste USD 195.320.145) Minusvalía latente sobre contratos de futuros						(553.749)	(0,23)		
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo				a plazo		(114)	(0,00)		
Otros a	ctivos	ур	asivos				8	3.463.403	3,54
Patrim	onio						238	3.627.627	100,00

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.
---------------------------------------------------------

La contraparte de los contratos de divisas a plazo fue State Street Bank & Trust. La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del  $0.00\,\%$ .

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Internet	23,76
Semiconductores	18,94
Alimentación, bebidas y tabaco	8,03
Fabricaciones varias	4,41
Servicios financieros diversos	4,10
Seguros	3,67
Bancos	3,62
Fabricantes de automóviles	2,52
Ordenadores	2,40
Productos farmacéuticos	2,31
Otros	18,88
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	92,64
Fondos de inversión	4,05
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(0,23)
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	(0,00)
Otros activos y pasivos	3,54
TOTAL	100,00

Una parte de estos valores estaba cedida en préstamo a 30 de noviembre de 2021.

<sup>(</sup>a) Los valores se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional)).

<sup>(</sup>b) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.

<sup>(</sup>c) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

 $<sup>^{(</sup>d)}$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

# Goldman Sachs Funds—All China Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Valores mobilia Acciones ordina	rios admitidos a cotización en una arias – 97,83 %	bolsa de valo	res oficial	Acciones ordina China – (continua	arias – (continuación) ación)		
China				14.300	Will Semiconductor Co., Ltd.		
152.900	Alibaba Group Holding Ltd.	2.485.871	4,01		Shanghai "A"	616.336	1,00
10.678	Alibaba Group Holding Ltd.—ADR(a)	1.388.994	2,24		WuXi AppTec Co., Ltd. "H" 144A(c)	1.015.060	1,64
18.000	ANTA Sports Products Ltd.	288.919	0,47	99.500	Wuxi Biologics Cayman, Inc.		
	Bank of Ningbo Co., Ltd. "A"(b)	1.430.906	2,31		144A <sup>(c)</sup>	1.365.007	2,20
	Baoshan Iron & Steel Co., Ltd. "A"	268.749	0,43		XPeng, Inc. "A"	566.444	0,91
	Bilibili, Inc. "Z"	909.577	1,47		XPeng, Inc.—ADR <sup>(a)</sup>	1.052.815	1,70
	CanSino Biologics, Inc. "H" 144A(c)	257.272	0,42	150.934	Yantai Jereh Oilfield Services	024 624	1.50
	China Feihe Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	302.615	0,49	100 500	Group Co., Ltd. "A"	931.634	1,50
	China Merchants Bank Co., Ltd. "H"	2.291.730	3,70		Yunnan Aluminium Co., Ltd. "A"  Yunnan Energy New Material Co.,	306.258	0,49
	China Vanke Co., Ltd. "H"	919.530	1,48	21.279	Ltd. "A"	853.603	1,38
	CIFI Holdings Group Co., Ltd.	553.909	0,89	149.247	Zhejiang Sanhua Intelligent		,,
	CITIC Securities Co., Ltd. "H"	928.375	1,50		Controls Co., Ltd. "A"	547.005	0,88
24.723	Contemporary Amperex Technology	2.665.789	4,30	10.171	ZTO Express Cayman, Inc.—ADR(a)	317.335	0,51
70.000	Co., Ltd. "A"  East Money Information Co., Ltd. "A"	382.928	4,30 0,62		-	54.404.450	07.04
	Ecovacs Robotics Co., Ltd. "A"	622.262	1,00			54.424.156	87,84
	ENN Energy Holdings Ltd.	754.959	1,00	Hong Kong			
	0, 0	754.959	1,22	54.800	AIA Group Ltd.	581.056	0,94
367.000	Focus Media Information Technology Co., Ltd. "A"	431.763	0,70	79.228	Alibaba Health Information		
0 310	Full Truck Alliance Co., Ltd.—ADR <sup>(a)</sup>	120.751	0,20		Technology Ltd.	73.654	0,12
	Ganfeng Lithium Co., Ltd. "H"	120.701	0,20	51.000	ASM Pacific Technology Ltd.	539.761	0,87
40.000	144A <sup>(c)</sup>	955.757	1,54	227.000	China Mengniu Dairy Co., Ltd.	1.271.522	2,05
78.279	Hangzhou Robam Appliances Co.,		.,	258.000	Geely Automobile Holdings Ltd.	772.969	1,25
	Ltd. "A"	387.926	0,63	12.268	Hong Kong Exchanges & Clearing		
17.900	Hangzhou Tigermed Consulting				Ltd.	681.077	1,10
	Co., Ltd. "H" 144A(c)	285.417	0,46		Sino Biopharmaceutical Ltd.	755.376	1,22
6.000	Helens International Holdings			27.500	Techtronic Industries Co., Ltd.	570.731	0,92
	Co., Ltd.	13.008	0,02		_	5.246.146	8,47
	Hongfa Technology Co., Ltd. "A"	869.773	1,40				
4.100	Huazhu Group Ltd.—ADR(a)	160.925	0,26	Taiwán			
246.000	Jiumaojiu International Holdings			26.000	MediaTek, Inc.	945.724	1,52
00.000	Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	513.051	0,83	TOTAL DE ACCIO	ONES ORDINARIAS		
	Juewei Food Co., Ltd. "A"	641.152	1,04	(coste USD 54.49		60.616.026	97,83
232.000	Kingdee International Software	710.525	1 15	Foundation de la con-			
10 160	Group Co., Ltd. Kweichow Moutai Co., Ltd. "A"	3.094.159	1,15 4,99	Fondos de inve	rsion – 2,24 %		
	Luxshare Precision Industry Co.,	3.094.139	4,55	Irlanda	0-1d 0b-1106 T		
100.505	Ltd. "A"	648.033	1,05	1.300.230	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de		
83.500	Meituan "B" 144A <sup>(c)</sup>	2.576.971	4,16		acciones de distribución X)(d)(e)	1.386.230	2,24
17.800	Midea Group Co., Ltd. "A"	190.681	0,31		······································		<u> </u>
	Minth Group Ltd.	1.332.388	2,15		OS DE INVERSIÓN	1.386.230	2.24
72.600	NetEase, Inc.	1.583.947	2,56	(coste USD 1.386	5.230)	1.300.230	2,24
2.462	NetEase, Inc.—ADR(a)	272.149	0,44		RES MOBILIARIOS ADMITIDOS A		
252.151	Ping An Bank Co., Ltd. "A"	693.037	1,12		UNA BOLSA DE VALORES OFICIAL		
104.000	Ping An Insurance Group Co. of			(coste USD 55.88	34.800)	62.002.256	100,07
	China Ltd. "H"	726.199	1,17				
21.516	Qingdao Haier Biomedical Co.,					Valor de	
	Ltd. "A"	306.138	0,49		Descripción	Valor de mercado	% del
	SF Holding Co., Ltd. "A"	428.309	0,69	Tenencias	del valor	en USD	patrimonio
	SG Micro Corp. "A"	560.426	0,90				
1.000	Shanghai MicroPort MedBot Group			Otros valores n			
	Co., Ltd.	7.697	0,01	Derechos – 0,01	I %		
23.800	Shanghai Putailai New Energy	000 000	4.40	China			
00.050	Technology Co., Ltd. "A"  Shenzhen Inovance Technology	683.389	1,10	50.800	CIFI Holdings Group—Derechos(g)	1.629	0,01
96.630	Co., Ltd. "A"	1.025.238	1,66	Hong Kong			
18 400	Shenzhen Kangtai Biological	1.023.230	1,00	23.807	Bank of Ningbo Co., Ltd.—Derechos <sup>(b)</sup>	0	-
10.400	Products Co. Ltd.	332.006	0,54	TOTAL DE DERE	CHOS		
12.400	Shenzhen Mindray Bio-Medical		-,-	(coste USD 0)		1.629	0,01
	Electronics Co., Ltd. "A"	702.568	1,14	<u> </u>			
53.300	Sungrow Power Supply Co., Ltd. "A"	1.359.083	2,19	(coste USD 0)	S VALORES MOBILIARIOS	1.629	0,01
41.600	Sunny Optical Technology Group			(coste osp o)		1.029	0,01
	Co., Ltd.	1.266.552	2,04		CADO DE LAS INVERSIONES		
87.000	Tencent Holdings Ltd.	5.141.119	8,30	(coste USD 55.88	34.800)	62.003.885	100,08
457.000	Topsports International Holdings			OTROS ACTIVOS	S Y PASIVOS	(46.445)	(0,08)
	Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	534.125	0,86				
	Tsingtao Brewery Co., Ltd. "H"	695.124	1,12	PATRIMONIO		61.957.440	100,00
40.600	Wanhua Chemical Group Co.,	642 400	0.00				
100 0==	Ltd. "A"	613.123	0,99				
438.000	Weimob, Inc. 144A(c)	537.765	0,87				

# Goldman Sachs Funds—All China Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

TOTAL DE INVERSIONES	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Total de inversiones (coste USD 55.884.800)	62.003.885	100,08
Otros activos y pasivos	(46.445)	(80,0)
Patrimonio	61.957.440	100,00

<sup>(</sup>e) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Internet	19,58
Alimentación, bebidas y tabaco	9,20
Bancos	7,13
Software	5,62
Equipos y componentes eléctricos	4,30
Semiconductores	4,29
Fabricantes de automóviles	3,86
Atención sanitaria – Servicios	3,84
Productos químicos	3,47
Servicios financieros diversos	3,22
Otros	33,32
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	97,83
Fondos de inversión	2,24
Derechos	
Inmobiliaria	0,01
Bancos	0,00
TOTAL DE DERECHOS	0,01
Otros activos y pasivos	(0,08)
TOTAL	100,00

<sup>(</sup>a) Los valores se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional)).
(b) La valoración de este tífulo la realiza el Tasador. Consulte la Nota 4.
(c) 144A: La emisión de este tífulo va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
(d) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

### Goldman Sachs Funds—Emerging Markets Equity ESG Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	Tenencias	Des del v
Acciones ordina	rios admitidos a cotización en un arias – 92 37 %	a boisa de vaic	ores oficial	Acciones ordina Hungría	arıas
Argentina	32,07 /0			142.522	OTF
-	MercadoLibre, Inc.	16.809.700	2,23	India	
Brasil				90.221	Ave
	Aeris Industria E Comercio De			657.435	
	Equipamentos Para Geracao De	0.004.405	0.40	45.440	Elec
2 137 280	Energia S.A.  Banco Bradesco S.A.—ADR <sup>(a)</sup>	3.034.125 7.619.403	0,40 1,01	45.142 33.337	
	Caixa Seguridade Participacoes	7.019.403	1,01	315.070	
	S.A.	2.473.058	0,33	0.0.0.0	Co.
1.345.100	Hapvida Participacoes e	0.004.400	0.05	77.923	
00.971	Investimentos S.A. 144A <sup>(b)</sup> Pagseguro Digital Ltd. "A"	2.661.186 2.619.616	0,35 0,35	928.455	
	Rede D'Or Sao Luiz S.A. 144A <sup>(b)</sup>	2.526.387	0,34	287.393 254.261	
2				333.958	
		20.933.775	2,78	857.073	
China				824.605	
	Alibaba Group Holding Ltd.	1.025.889	0,14	3.491.535	Zon
	Alibaba Group Holding Ltd.—ADR <sup>(a)</sup>	12.869.595 6.571.297	1,71		
	ANTA Sports Products Ltd. Bilibili, Inc.—ADR <sup>(a)</sup>	4.065.328	0,87 0.54	la de se ele	
	China Feihe Ltd. 144A <sup>(b)</sup>	3.364.922	0,45	Indonesia 15.621.000	Ban
	China Merchants Bank Co., Ltd. "H"	17.528.430	2,33	18.921.700	
89.900	Contemporary Amperex Technology			10.021.100	Dan
454.000	Co., Ltd. "A"	9.693.582	1,29		
	Ecovacs Robotics Co., Ltd. "A" ENN Energy Holdings Ltd.	3.938.399 12.802.371	0,52 1,70	México	
	Full Truck Alliance Co., Ltd.—ADR <sup>(a)</sup>	2.303.265	0,31	1.208.699	
	Hangzhou Robam Appliances Co.,	2.000.200	0,0 .	2.060.850 594.038	
	Ltd. "A"	3.526.496	0,47	3.602.165	
616.499	Luxshare Precision Industry Co.,	0.050.040	0.50	0.002.100	
601 000	Ltd. "A" Meituan "B" 144A	3.856.846 21.353.372	0,52 2,84		
	Ping An Insurance Group Co. of	21.555.572	2,04	Filipinas	
	China Ltd. "H"	9.025.114	1,20	277.330	
153.310	Qingdao Haier Biomedical Co.,			14.940.000	Mor
200 612	Ltd. "A" SF Holding Co., Ltd. "A"	2.181.357	0,29		
	Silergy Corp.	2.793.779 8.106.895	0,37 1,08	Polonia	
	Sunny Optical Technology Group	0.100.000	1,00	390.036	InPo
	Co., Ltd.	10.528.210	1,40	539.116	
	Tencent Holdings Ltd.	48.456.522	6,44		Ban
3.052.000	Topsports International Holdings Ltd. 144A <sup>(b)</sup>	3.567.067	0,47		
465.086	WuXi AppTec Co., Ltd. "H" 144A <sup>(b)</sup>	10.363.086	1,38	Rusia	
	Yunnan Aluminium Co., Ltd. "A"	4.000.592	0,53	1.852.480	Det
805.301	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls			1.401.280	
	Co., Ltd. "A"	2.951.507	0,39	151 602	PJS
		204.873.921	27,24	151.603 975.110	
Chipre				437.563	
•	TCS Group Holding Plc.—GDR <sup>(a)</sup>	11.058.711	1,47	128.644	
			<u> </u>		
Egipto 1 371 539	Commercial International Bank				
	Egypt SAE	4.487.403	0,60	Arabia Saudí	Cou
Grecia				443.459 87.518	
	JUMBO S.A.	4.897.911	0,65	01.010	Out
1 328 600	AIA Group Ltd.(b)	14.087.427	1,87	Singapur	
	Alibaba Health Information	14.007.427	1,07	29.612	Sea
	Technology Ltd.	377.695	0,05	Sudáfrica	
	China Mengniu Dairy Co., Ltd.	7.673.945	1,02	485.605	Clic
	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	11.796.651	1,57	516.983	
	Sino Biopharmaceutical Ltd.	4.171.786	0,56	159.028	
309.500	Techtronic Industries Co., Ltd.	6.423.320	0,85	1.441.767	Irar
		44.530.824	5,92		

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% de
	arias – (continuación)	0002	patimoni
Hungría	OTD David Mont	7.054.540	4.0
	OTP Bank Nyrt	7.851.518	1,0
India 90 221	Avenue Supermarts Ltd. 144A(b)	5.668.967	0,7
	Crompton Greaves Consumer	0.000.007	0,.
	Electricals Ltd.	3.929.225	0,5
	Divi's Laboratories Ltd.	2.935.054	0,3
	FSN E-Commerce Ventures Ltd. ICICI Lombard General Insurance	1.082.563	0,1
	Co., Ltd. 144A <sup>(b)</sup>	6.038.366	0,8
	Info Edge India Ltd.	6.033.517	0,8
	Infosys Ltd.—ADR <sup>(a)</sup>	21.345.181	2,8
	Kotak Mahindra Bank Ltd.	7.521.829	1,0
	SBI Life Insurance Co., Ltd. 144A <sup>(b)</sup>	3.937.123	0,5
	Sona BLW Precision Forgings Ltd. 144A <sup>(b)</sup> Tata Consumer Products Ltd.	3.340.771	0,4
	Wipro Ltd.	8.896.004 7.007.559	1,1 0,9
	Zomato Ltd.	7.087.371	0,8
0.101.000	-	84.823.530	11,2
		04.023.330	11,2
Indonesia 15.621.000	Bank BTPN Syariah Tbk PT	3.900.986	0,5
18.921.700	Bank Central Asia Tbk PT	9.633.607	1,2
	-	13.534.593	1,8
México		10.001.000	.,.
	Arca Continental SAB de CV	7.521.499	1,0
	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV "A"	3.101.414	0,4
	Prologis Property Mexico S.A. de CV	1.344.035	0,1
3.602.165	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	11.644.608	1,5
	-	23.611.556	3,1
Filipinas			
277.330	Jollibee Foods Corp.	1.293.491	0,1
14.940.000	Monde Nissin Corp. 144A <sup>(b)</sup>	5.045.228	0,6
		6.338.719	0,8
Polonia			
	InPost S.A.	4.418.943	0,5
539.116	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski S.A.	5.725.765	0,7
	•	10.144.708	1,3
Rusia			
	Detsky Mir PJSC 144A <sup>(b)</sup>	3.455.732	0,4
1.401.280	Moscow Exchange MICEX-RTS		
151 602	PJSC	2.872.643	0,3
	Ozon Holdings Plc.—ADR <sup>(a)</sup>	6.177.822	0,8
	Renaissance Insurance Group JSC Sberbank of Russia PJSC—ADR <sup>(a)</sup>	1.479.622 7.416.693	0,2 0,9
	Yandex NV "A"	9.409.022	1,2
	•	30.811.534	4,1
Arabia Saudí			
	Saudi National Bank	7.139.600	0,9
87.518	Saudi Tadawul Group Holding Co.(c)	2.449.459	0,3
	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	9.589.059	1,2
Singapur			
	Sea Ltd.—ADR <sup>(a)</sup>	8.895.741	1,1
Sudáfrica			
	Clicks Group Ltd.	8.611.324	1,1
	Mr Price Group Ltd.	6.473.512	0,8
	Santam Ltd.	2.551.628	0,3
1.441.767	Transaction Capital Ltd.	3.851.342	0,5
		21.487.806	2,8

# Goldman Sachs Funds—Emerging Markets Equity ESG Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias		Descripción del valor		Valor de mercado en USD	% de
Acciones	ordina	arias – (continuación)			
Corea del S					
		KB Financial Group, Inc.		3.838.042	0,5
		Krafton, Inc.		3.714.807	0,49
		LG Electronics, Inc.		7.137.369	0,98
		NAVER Corp.		9.888.745 6.183.404	1,32
		NCSoft Corp. Orion Corp.		2.835.815	0,82 0,38
		Samsung Electronics Co., Ltd	d.	34.477.387	4,58
			_	68.075.569	9,0
Taiwán					-,
73:	5.936	Chailease Holding Co., Ltd.		6.545.375	0,87
		MediaTek, Inc.		13.203.757	1,76
15	2.000	Nien Made Enterprise Co., Lt	d.	2.077.361	0,28
		Taiwan Semiconductor			
		Manufacturing Co., Ltd.		50.526.416	6,7
2.84	2.000	United Microelectronics Corp		6.570.840	0,8
20	9.000	Win Semiconductors Corp.		2.731.673	0,3
				81.655.422	10,80
Tailandia					
		Airports of Thailand PCL		3.795.713	0,50
1.40	7.700	Kasikornbank PCL	_	5.534.604	0,74
				9.330.317	1,2
Emiratos Á		<b>Unidos</b> Abu Dhabi Commercial Bank	PJSC	6.038.427	0,8
Estados Un	idos				
	7.922	EPAM Systems, Inc.		5.039.026	0,6
		ONES ORDINARIAS		94.819.770	92,3
				,04.010.110	02,0
Fondos de	inve	rsión – 0,00 %  Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund (Clase de acide distribución X) <sup>(d)(e)</sup>	ciones	136	
Fondos de	136	rsión – 0,00 %  Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund (Clase de aci de distribución X) <sup>(d)</sup> (e) Goldman Sachs US\$ Treasui Liquid Reserves Fund (Clase	ciones Ty de	136	0,00
Fondos de	136	rsión – 0,00 %  Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund (Clase de aci de distribución X) <sup>(d)(e)</sup> Goldman Sachs US\$ Treasui	ciones Ty de		
Fondos de	136	rsión – 0,00 %  Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund (Clase de aci de distribución X) <sup>(d)</sup> (e) Goldman Sachs US\$ Treasui Liquid Reserves Fund (Clase	ciones Ty de	136	0,00
Irlanda	136 124	rsión – 0,00 %  Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund (Clase de aci de distribución X) <sup>(d)</sup> (e) Goldman Sachs US\$ Treasui Liquid Reserves Fund (Clase	ciones Ty de	136 124	0,00 0,00 0,00
Fondos de Irlanda TOTAL DE I (coste USD TOTAL DE VA COTIZAC	136 124 FOND 260) VALOI	rsión – 0,00 %  Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund (Clase de ac de distribución X) <sup>(d)(e)</sup> Goldman Sachs US\$ Treasu Liquid Reserves Fund (Clase acciones de distribución X) <sup>(d)</sup>	y de (f)	136 124 260	0,0
FONDOS DE ITANDA DE ISCOSTE USD TOTAL DE SA COTIZAC DE IGAL (COTIZAC DE IG	136 124 FOND 260) WALOI IÓN E COSTE U MERCODO D	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund (Clase de aci de distribución X)(d)(e) Goldman Sachs US\$ Treasu Liquid Reserves Fund (Clase acciones de distribución X)(d)  OS DE INVERSIÓN  RES MOBILIARIOS ADMITID N UNA BOLSA DE VALORES ISD 671.242.220)  GADO DE LAS INVERSIONES ERIVADOS	os s	136 124 260 <b>260</b>	0,00 0,00 0,00 0,00
FONDOS DE PROMETA DE PROMETA DE PROMETA DE VA COTIZAC DE VALOR DE EXCLUYEN COSTE USD	136 124 FOND 260) VALOI ÓN E OSSE U MERC DO D 671.2	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund (Clase de aci de distribución X)(d)(e) Goldman Sachs US\$ Treasu Liquid Reserves Fund (Clase acciones de distribución X)(d)  OS DE INVERSIÓN  RES MOBILIARIOS ADMITID N UNA BOLSA DE VALORES ISD 671.242.220)  GADO DE LAS INVERSIONES ERIVADOS	os s	136 124 260 <b>260</b> <b>260</b> <b>394.820.030</b>	0,0 0,0 0,0 0,0 92,3
FONDOS DE PROMETA DE PARA COTIZAC DE LA COTIZAC DE INCLUSE USD CONTRATOS USD CONTRATOS	136 124 FOND 260) WALOUIÓN E DOSTE U MERC DO DO DO 671.2 de fu	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund (Clase de ac de distribución X)(d)(e) Goldman Sachs US\$ Treasu Liquid Reserves Fund (Clase acciones de distribución X)(d) OS DE INVERSIÓN RES MOBILIARIOS ADMITID IN UNA BOLSA DE VALORES ISD 671.242.220) ADO DE LAS INVERSIONES ERIVADOS 42.220) turos – 0,02 %	os s	136 124 260 260 260 394.820.030	0,00 0,00 0,00 92,3
FONDOS DE PROPINS DE LA COTIZAC DE LA COTIZAC DE LA COTIZAC DE EXCLUYEN COSTE USD COntratos	136 124 FOND 260) WALOI IÓN E GO DO DO G71.2 de fu  Desc del v. USD Futur Emer	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund (Clase de ac de distribución X) <sup>(d)</sup> (e) Goldman Sachs US\$ Treasur Liquid Reserves Fund (Clase acciones de distribución X) <sup>(d)</sup> OS DE INVERSIÓN  RES MOBILIARIOS ADMITID N UNA BOLSA DE VALORES ISD 671.242.220) CADO DE LAS INVERSIONES ERIVADOS 42.220)  turos – 0,02 %	ciones  y de (f)  OS  S  Valor de nercado de eassignación	136 124 260 <b>260</b> <b>260</b> <b>394.820.030</b> Plusvalia latente en	0,00 0,00 0,00 92,3 92,3
Fondos de rianda  FOTAL DE I Coste USD FOTAL DE VA COTIZAC DE ICAL (COVALOR DE EXCLUYEN (COSTE USD COntratos Número de contratos	136 124 124 136 124 124 100 100 100 100 100 100 100 100 100 10	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund (Clase de ac de distribución X) <sup>(d)</sup> (e) Goldman Sachs US\$ Treasur Liquid Reserves Fund (Clase acciones de distribución X) <sup>(d)</sup> OS DE INVERSIÓN  RES MOBILIARIOS ADMITID N UNA BOLSA DE VALORES ISD 671.242.220) CADO DE LAS INVERSIONES ERIVADOS 42.220)  turos – 0,02 %  ripción alor  Tos sobre el MSCI rging Markets	Valor de ercado de asignación USD	136 124 260 260 260 394.820.030 Plusvalia latente en USD	0,00
FONDOS DE FINANCIA DE FICOSTE USD FOTAL DE VA COTIZAC DE VALOR DE EXCLUYEN COSTE USD COntratos  Número de contratos  676  PLUSVALÍAF-UTUROS  VALOR DE	FOND 260)  WALOI IÓN E E CONTROL DE STATE U  Desce del v:  USD Futur Emer Index  LATE	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund (Clase de ac de distribución X)(d)(e) Goldman Sachs US\$ Treasur Liquid Reserves Fund (Clase acciones de distribución X)(d) OS DE INVERSIÓN RES MOBILIARIOS ADMITID N UNA BOLSA DE VALORES ISD 671.242.220) ADO DE LAS INVERSIONES ERIVADOS 42.220) turos – 0,02 %  ripción la cros sobre el MSCI riging Markets (17/12/2021 Larga 42 ENTE SOBRE CONTRATOS I	Valor de enercado de asignación USD	136 124 260 260 260 394.820.030 Plusvalia latente en USD	0,00 0,00 0,00 92,3 92,3 % depatrimonio
FONDOS DE FINANCIA DE INCOSTE USD FONDOS DE CONTRATOS  Número de contratos  PLUSVALÍA FUTUROS  VALOR DE COSTE USD CO	FOND 260) WALOI ÓN E Desc del v. USD DE Futur Emer Index	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund (Clase de ac de distribución X)(d)(e) Goldman Sachs US\$ Treasur Liquid Reserves Fund (Clase acciones de distribución X)(d) OS DE INVERSIÓN RES MOBILIARIOS ADMITID N UNA BOLSA DE VALORES ISD 671.242.220) ADO DE LAS INVERSIONES ERIVADOS 42.220) turos – 0,02 %  ripción la cros sobre el MSCI riging Markets (17/12/2021 Larga 42 ENTE SOBRE CONTRATOS I	Valor de enercado de asignación USD	136  124  260  260  260  394.820.030  Plusvalia latente en USD  162.150	0,00 0,00 0,00 92,3 92,3 % depatrimoni

TOTAL DE INVERSIONES	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Total inversiones excluyendo derivados		
(coste USD 671.242.220)	694.820.030	92,37
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	162.150	0,02
Otros activos y pasivos	57.230.335	7,61
Patrimonio	752.212.515	100,00

El Comisionista de futuros fue Credit Suisse Securities (USA) LLC.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como

- porcentaje del VL, es del 0,02 %.

  (a) Los valores se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt
- (Igual que el anterior pero a escala internacional)).
  (b) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.

  (c) La valoración de este título la realiza el Tasador. Consulte la Nota 4.

  (d) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- (e) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,092 %.
- (f) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Internet	20,64
Semiconductores	14,29
Bancos	13,49
Venta al por menor	6,23
Seguros	5,26
Alimentación, bebidas y tabaco	5,01
Servicios financieros diversos	4,51
Ordenadores	4,44
Muebles para el hogar	2,46
Atención sanitaria – Servicios	2,07
Otros	13,97
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	92,37
Fondos de inversión	0,00
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	0,02
Otros activos y pasivos	7,61
TOTAL	100,00

# Goldman Sachs Funds—Emerging Markets Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

	Descrinción del	Valor de	0/ dal		Descrinción del	Valor de mercado en	% de
Tenencias	Descripción del valor	mercado en USD	% del patrimonio	Tenencias	Descripción del valor	mercado en USD	% de patrimonio
Valores mobilia	rios admitidos a cotización en u	na bolsa de valo	res oficial	Acciones ordina	arias – (continuación)		
Acciones ordina	arias —97,04 %			Egipto			
Argentina					Commercial International Bank		
59.156	MercadoLibre, Inc.	73.235.719	1,42		Egypt SAE	30.643.217	0,59
Brasil				10.390.245	E-Finance for Digital & Financial	10 067 765	0.04
	Aeris Industria E Comercio De				Investments	12.367.765	0,24
	Equipamentos Para Geracao De					43.010.982	0,83
	Energia S.A.	15.862.818	0,31	Grecia		,	
	Banco Bradesco S.A.—Preferente	23.863.636	0,46		Hellenic Exchanges - Athens Stock		
	Blau Farmaceutica S.A.	11.178.373	0,22		Exchange S.A.	6.854.088	0,13
	Boa Vista Servicos S.A. Caixa Seguridade Participacoes	8.594.154	0,17	1.357.698	JUMBO S.A.	19.295.270	0,38
0.929.551	S.A.	13.807.896	0,27	1.847.044	Sarantis S.A.	18.053.261	0,35
2.482.522	Clear Sale S.A.	4.977.988	0,10		•	44.202.619	0,86
	Hapvida Participacoes e		2,12	-		44.202.010	0,00
	Investimentos S.A. 144A <sup>(a)</sup>	18.220.154	0,35	Hong Kong			
10.681.500	Locaweb Servicos de Internet S.A.	26.472.970	0,51		AIA Group Ltd.	67.105.604	1,30
377.565	Pagseguro Digital Ltd. "A"	9.903.530	0,19	3.241.361	Alibaba Health Information	3.013.311	0,06
1.526.150	Qualicorp Consultoria e Corretora			7 205 000	Technology Ltd. China Mengniu Dairy Co., Ltd.	40.862.355	0,00
	de Seguros S.A.	4.289.265	0,08		Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	49.713.995	0,75
2.508.020	Rede D'Or Sao Luiz S.A. 144A <sup>(a)</sup>	22.794.482	0,44		Sino Biopharmaceutical Ltd.	30.537.785	0,59
		159.965.266	3,10		Techtronic Industries Co., Ltd.	36.516.417	0,33
China				00.000			
	Alibaba Group Holding Ltd.—					227.749.467	4,41
	ADR <sup>(b)</sup>	124.695.859	2,42	Hungría			
2.540.000	ANTA Sports Products Ltd.	40.769.651	0,79	666.804	OTP Bank Nyrt	36.734.141	0,71
1.506.330	Beijing Easpring Material			India			
	Technology Co. Ltd. "A"	24.975.105	0,48	754.549	Amber Enterprises India Ltd.	30.416.400	0,59
	Bilibili, Inc.—ADR <sup>(b)</sup>	30.491.875	0,59		Atul Ltd.	13.420.762	0,26
	China Feihe Ltd. 144A <sup>(a)</sup>	22.684.100	0,44	633.176	Avenue Supermarts Ltd. 144A <sup>(a)</sup>	39.785.128	0,77
12.943.500	China Merchants Bank Co., Ltd. "H"	100.723.300	1,95	610.635	Cartrade Tech Ltd.	7.467.944	0,14
14 500	Contemporary Amperex Technology	100.725.500	1,55	608.036	Computer Age Management		
14.000	Co., Ltd. "A"	1.563.481	0,03		Services Ltd.	24.970.477	0,48
468.614	Contemporary Amperex Technology			3.876.415	Crompton Greaves Consumer	00 407 770	0.45
	Co., Ltd. "A"	50.528.902	0,98	427 500	Electricals Ltd.	23.167.778	0,45
963.424	Ecovacs Robotics Co., Ltd. "A"	24.979.250	0,48		Divi's Laboratories Ltd. FSN E-Commerce Ventures Ltd.	27.795.887 9.812.880	0,54 0,19
	ENN Energy Holdings Ltd.	66.070.148	1,28		Godrej Properties Ltd.	50.038.035	0,13
1.377.544	Full Truck Alliance Co., Ltd.— ADR <sup>(b)</sup>	17 000 740	0.25		ICICI Lombard General Insurance	30.030.033	0,57
4 402 262		17.866.746	0,35	1.0.0.0.1	Co., Ltd. 144A <sup>(a)</sup>	29.055.280	0,56
4.493.302	Hangzhou Robam Appliances Co., Ltd. "A"	22.267.695	0,43	461.463	Info Edge India Ltd.	35.730.721	0,69
8.675.000	Jiumaojiu International Holdings	22.207.000	0,10	3.431.275	Infosys Ltd.	78.766.919	1,53
	Ltd. 144A <sup>(a)</sup>	18.092.363	0,35	1.553.706	Kotak Mahindra Bank Ltd.	40.664.564	0,79
226.558	Kweichow Moutai Co., Ltd. "A"	68.996.707	1,34	961.503	Navin Fluorine International Ltd.	48.001.059	0,93
4.440.576	Luxshare Precision Industry Co.,			1.310.158	Route Mobile Ltd.	31.746.343	0,61
	Ltd. "A"	27.780.447	0,54		SBI Life Insurance Co., Ltd. 144A <sup>(a)</sup>	25.326.908	0,49
	Meituan "B" 144A <sup>(a)</sup>	126.246.912	2,45	3.228.399	Sona BLW Precision Forgings Ltd.	00 005 505	0.00
	Minth Group Ltd.	29.349.804	0,57	0.400.000	144A <sup>(a)</sup>	32.295.505	0,63
7.021.500	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. "H"	49.028.889	0.05		Tata Consumer Products Ltd.	32.388.140	0,63
1 170 397	Qingdao Haier Biomedical Co.,	49.020.009	0,95		TeamLease Services Ltd. Wipro Ltd.	27.427.331 35.898.243	0,53 0,70
1.179.307	Ltd. "A"	16.780.796	0,33		Zomato Ltd.	47.347.298	0,70
2.648.246	SF Holding Co., Ltd. "A"	25.546.552	0,50	23.323.230	Zomato Ltu.	47.547.290	0,92
	Silergy Corp.	67.511.348	1,31			691.523.602	13,40
	Sunny Optical Technology Group			Indonesia			
	Co., Ltd.	50.397.185	0,98	77.562.500	Bank BTPN Syariah Tbk PT	19.369.452	0,38
	Tencent Holdings Ltd.	301.299.107	5,84	133.910.000	Bank Central Asia Tbk PT	68.177.615	1,32
18.238.000	Topsports International Holdings	04.045.014	6 44	279.934.800	BFI Finance Indonesia Tbk PT	19.056.480	0,37
1 774 004	Ltd. 144A <sup>(a)</sup>	21.315.914	0,41	35.946.600	Map Aktif Adiperkasa PT	6.249.400	0,12
	WuXi AppTec Co., Ltd. "H" 144A <sup>(a)</sup>	39.466.498	0,76	282.482.900	Pakuwon Jati Tbk PT	9.734.727	0,19
	Yunnan Aluminium Co., Ltd. "A"  Zepp Health Corp.—ADR <sup>(b)</sup>	22.080.894 6.076.491	0,43 0,12	16.972.514	Semen Indonesia Persero Tbk PT	9.497.175	0,18
	Zhejiang Sanhua Intelligent	0.070.481	U, 1Z			132.084.849	2,56
0.204.400	Controls Co., Ltd. "A"	22.959.965	0,44				2,50
134.300	Zhejiang Sanhua Intelligent		-, "	México	Assa Cartinantal CAR 1 CV	04.070.100	
	Controls Co., Ltd. "A"	492.223	0,01		Arca Continental SAB de CV	34.972.163	0,68
		1.421.038.207	27,55		Gentera SAB de CV	6.126.899	0,12
			27,00	12.409.004	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV "A"	18.750.705	0,36
Chipre	T00 0 11 11 5: 075 (1)	70.00					
810.355	TCS Group Holding Plc.—GDR <sup>(b)</sup>	76.967.518	1,49				

# Goldman Sachs Funds—Emerging Markets Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ordina México – (contina	arias – (continuación) uación)		
4.836.195	Prologis Property Mexico S.A. de CV	10.942.085	0,21
11.537.656	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	37.297.425	0,72
	-	108.089.277	2,09
		100.000.277	2,00
Filipinas	Del Monte Pacific Ltd.	2 220 907	0.05
	Jollibee Foods Corp.	2.339.807 19.774.421	0,05
	Monde Nissin Corp. 144A <sup>(a)</sup>	36.678.399	0,71
	-	58.792.627	1,14
Polonia			.,
	Dino Polska S.A. 144A <sup>(a)</sup>	37.154.924	0,72
2.158.922	InPost S.A.		0,48
	Powszechna Kasa Oszczedności	24.459.676	-,
	Bank Polski S.A.	33.648.124	0,65
		95.262.724	1,85
Rusia	D (   M' D   00 · · · · /a)	04 000 000	
	Detsky Mir PJSC 144A <sup>(a)</sup>	31.039.298	0,60
	Fix Price Group Ltd.—GDR <sup>(a)(b)</sup> Moscow Exchange MICEX-RTS	27.778.205	0,54
0.559.757	PJSC	13.447.549	0,26
655.928	Ozon Holdings Plc.—ADR(b)	26.729.066	0,52
7.074.780	Renaissance Insurance Group JSC	10.735.201	0,21
	Sberbank of Russia PJSC	42.092.007	0,82
569.292	United Medical Group CY Plc.— GDR <sup>(b)</sup>	0.464.467	0.40
620 810	Yandex NV "A"	9.461.467 46.064.962	0,18 0,89
029.019	Tandex NV A		
		207.347.755	4,02
	Saudi National Bank Saudi Tadawul Group Holding	41.532.744	0,81
221.604	Co. (c)	6.207.863	0,12
	-	47.740.607	0,93
Singapur			
8.006.225	Nanofilm Technologies International		
	Ltd.	23.949.418	0,46
	Sea Ltd.—ADR <sup>(b)</sup>	38.080.272	0,74
631.173	TDCX, Inc.—ADR <sup>(b)</sup>	11.802.935	0,23
		73.832.625	1,43
Eslovenia	Nova Liublianaka Banka dd		
1.003.014	Nova Ljubljanska Banka dd— GDR <sup>(b)</sup>	18.556.512	0,36
Sudáfrica			
1.271.354	Clicks Group Ltd.	22.545.158	0,44
2.439.346		16.590.153	0,32
	Mr Price Group Ltd.	31.908.302	0,62
	Santam Ltd.	9.530.850	0,18
10.754.197	Transaction Capital Ltd.	28.727.311	0,56
		109.301.774	2,12
Corea del Sur	File Heldings O	40,000,101	0.00
	Fila Holdings Corp. Hankook Tire & Technology Co.,	12.803.431	0,25
	Ltd.	15.281.535	0,30
	KB Financial Group, Inc.	32.930.493	0,64
	Krafton, Inc.	23.305.088	0,45
	LG Electronics, Inc.	39.726.038	0,77
	NAVER Corp. NCSoft Corp.	62.269.651 48.573.490	1,21 0.94
	NHN KCP Corp.	14.055.621	0,94 0,27
+33.004	-	24.416.372	0,27
298.061	Offort Corp.		
298.061 4.457.295	Samsung Electronics Co., Ltd.	268.292.651	5,20

	Descripción del	Valor de mercado en	% del
Tenencias	valor	USD	patrimonio
Acciones ordina	arias – (continuación)		
Taiwán			
	ASMedia Technology, Inc.	34.901.548	0,68
	Chailease Holding Co., Ltd.	33.539.246	0,65
	MediaTek, Inc.	81.150.361	1,57
	momo.com, Inc. Nien Made Enterprise Co., Ltd.	32.388.762 19.270.262	0,63 0,37
	Taiwan Semiconductor	13.210.202	0,57
	Manufacturing Co., Ltd.	381.260.124	7,39
2.484.189	Tong Hsing Electronic Industries Ltd.	27.453.945	0,53
	United Microelectronics Corp.	41.064.285	0,80
1.293.000	Win Semiconductors Corp.	16.899.779	0,33
		667.928.312	12,95
Tailandia			
14.173.300	Airports of Thailand PCL	25.186.228	0,49
8.997.100	Kasikornbank PCL	35.373.575	0,68
		60.559.803	1,17
Turnula			
Turquía 1 206 119	Mavi Giyim Sanayi ve Ticaret AS		
1.200.110	"B" 144A <sup>(a)</sup>	6.750.898	0,13
Emiratos Árabes	Unidos		
	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	28.795.379	0,56
Reino Unido + 1 411 550	VTEX "A"	20.919.171	0,41
	VIEX II	20.010.111	
Estados Unidos	EDAM Custome Inc	10.0FF 103	0.20
	EPAM Systems, Inc. Samsonite International S.A. 144A <sup>(a)</sup>	19.955.102 21.137.652	0,39 0,41
11.254.100	Samsonite international S.A. 144A		
		41.092.754	0,80
Uruguay			
387.229	Dlocal Ltd.	13.026.384	0,25
TOTAL DE ACCIO	ONES ORDINARIAS	5.006.163.342	97,04
COSTE OSD 3.806	.054.652)	5.006.165.342	97,04
Fondos de inve	rsión – 2,66 %		
Irlanda	iohana Mool Enamina Markata		
20.181.527	iShares MSCI Emerging Markets IMI ESG Screened UCITS ETF	137.476.562	2,66
TOTAL DE FOND			
(coste USD 143.3	OS DE INVERSIÓN 40.789)	137.476.562	2,66
TOTAL DE VALOE	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS A		
	UNA BOLSA DE VALORES OFICIAL		
(coste USD 3.949		5.143.639.904	99,70
	ADO DE LAS INVERSIONES		
(coste USD 3.949	.395.621)	5.143.639.904	99,70
OTROS ACTIVOS	Y PASIVOS	15.157.990	0,30
PATRIMONIO		5.158.797.894	100,00
		Valor de	
		mercado	% del
TOTAL DE INVER	SIONES	USD	patrimonio
Total de inversione	es (coste USD 3.949.395.621)	5.143.639.904	99,70
Otros activos y pa	sivos	15.157.990	0,30
Patrimonio		5.158.797.894	100,00
	stos valores estaba cedida en présta		
Ona parte de e	4- 0	4 00 40 1104101	40 2021.

Una parte de estos valores estaba cedida en préstamo a 30 de noviembre de 2021. Consulte la Nota 6.
 (a) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
 (b) Los valores se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/
GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional)).

<sup>(</sup>c) La valoración de este título la realiza el Tasador. Consulte la Nota 4.

# Goldman Sachs Funds—Emerging Markets Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Internet	20,04
Semiconductores	16,50
Bancos	11,69
Alimentación, bebidas y tabaco	6,16
Venta al por menor	5,66
Servicios financieros diversos	4,68
Seguros	3,96
Ordenadores	2,99
Muebles para el hogar	2,13
Electrónica	1,85
Otros	21,38
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	97,04
Fondos de inversión	2,66
Otros activos y pasivos	0,30
TOTAL	100,00

# Goldman Sachs Funds—Global Environmental Impact Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencia	ıs	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
		rios admitidos a cotización en un arias – 98,57 %	a bolsa de valor	es oficial
Australi				
3	3.037.401	Carbon Revolution Ltd.	2.383.993	0,18
Bélgica	403 108	Umicore S.A.	19.562.561	1,43
China	403.100	officore o.A.	13.302.301	1,40
China	7.100	Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. "A"	765.566	0,05
	304.700	Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. "A"	32.854.666	2,41
13	3.322.976	Xinyi Solar Holdings Ltd.	24.673.564	1,81
	394.088	XPeng, Inc.—ADR <sup>(a)</sup>	21.391.097	1,57
			79.684.893	5,84
Dinama	rca			
	279.977	Chr Hansen Holding A/S	21.109.811	1,55
		Novozymes A/S "B"	28.485.471	2,09
	182.648	Orsted A/S 144A <sup>(b)</sup>	23.820.432	1,74
			73.415.714	5,38
Finlandi	а			
	428.023	Neste OYJ	20.581.728	1,51
Francia				
		Imerys S.A.	11.526.713	0,84
	237.443	Schneider Electric S.E.	42.185.071	3,09
			53.711.784	3,93
Aleman		Infineon Technologies AG	45.335.466	3,32
Irlanda				
munau	178.254	Aptiv Plc.	29.098.183	2,13
	287.708	Kingspan Group Plc.	33.702.610	2,47
	143.144	Trane Technologies Plc.	27.485.079	2,01
			90.285.872	6,61
Israel	79.729	SolarEdge Technologies, Inc.	26.659.783	1,95
Italia 6	6.673.220	Enel SpA	51.246.017	3,75
 Japón				
	209.800	Daikin Industries Ltd.	42.863.517	3,14
		Horiba Ltd.	22.783.750	1,67
		Keyence Corp.	32.159.520	2,35
		Kurita Water Industries Ltd. Nidec Corp.	25.622.093 29.489.715	1,88 2,16
	200.400		152.918.595	11,20
D-( I			132.910.393	11,20
Países I	-	Aalberts NV	31.407.267	2,30
		Koninklijke DSM NV	42.945.485	3,15
		Pryme BV 144A <sup>(b)</sup>	582.873	0,04
		-	74.935.625	5,49
Noruega	<b>a</b>			
7	7.268.707	Aker Carbon Capture ASA	24.737.047	1,81
		Aker Offshore Wind AS	9.967.402	0,73
1	.058.607	Circa Group AS	1.039.851	0,08
			35.744.300	2,62
España 3	3.545.329	Iberdrola S.A.	40.211.458	2,95
Suecia				
	435.672	Re:NewCell AB	12.022.937	0,88
Suiza	799 907	ABB Ltd.	27.883.221	2 04
	100.001	ADD LIU.	Z1.00J.ZZ1	2,04

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ordina	arias – (continuación)		
	Delta Electronics, Inc.	39.518.872	2,90
Reino Unido 6.188.105	DS Smith Plc.	29.645.458	2,17
Estados Unidos			
119.037	Albemarle Corp.	32.958.965	2,42
501.958	Ball Corp.	46.797.544	3,43
145.500	Danaher Corp.	47.836.035	3,50
386.907	Danimer Scientific, Inc.	5.412.829	0,40
202.218	Darling Ingredients, Inc.	14.074.373	1,03
93.687	DocuSign, Inc.	23.790.877	1,74
253.276	Ecolab, Inc.	57.245.441	4,19
288.122	Itron, Inc.	18.523.363	1,36
494.652	NextEra Energy, Inc.	43.841.007	3,21
790.857	Nuvve Holding Corp.	12.258.283	0,90
3.320.360	Smart Wires Technology Ltd.—		
	Swedish Depositary Receipt	9.557.033	0,70
	Tattooed Chef, Inc.	9.775.506	0,72
	Waste Connections, Inc.	28.683.125	2,10
	Waste Management, Inc.	30.223.923	2,21
	Westrock Co.	24.720.655	1,81
	Wolfspeed, Inc.	21.074.561	1,54
348.911	Xylem, Inc.	43.062.596	3,16
		469.836.116	34,42
TOTAL DE ACCIO (coste USD 1.259	DNES ORDINARIAS .594.295)	1.345.584.393	98,57
Fondos de inve	rsión – 0,00 %		
	Goldman Sachs US\$ Treasury		
	Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X) <sup>(c)</sup> (d)	31	0,00
TOTAL DE FOND (coste USD 31)	OS DE INVERSIÓN	31	0,00
	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS N UNA BOLSA DE VALORES		
OFICIAL (coste U	SD 1.259.594.326)	1.345.584.424	98,57
VALOR DE MERO (coste USD 1.259	ADO DE LAS INVERSIONES .594.326)	1.345.584.424	98,57
OTROS ACTIVOS	Y PASIVOS	19.547.361	1,43
PATRIMONIO		1.365.131.785	100,00
		Valor de mercado	% del
TOTAL DE INVER	SIONES	en USD	patrimonio
Total de inversione	es (coste USD 1.259.594.326)	1.345.584.424	98,57
Otros activos y pa		19.547.361	1,43
Patrimonio		1.365.131.785	100,00
(a) Los voloros os	nagacian/actón denominados en Ll	CD /ADD: American	Denseiten

<sup>(</sup>a) Los valores se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional)).

<sup>(</sup>b) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.

<sup>(</sup>c) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

<sup>(</sup>d) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028  $\,\%.$ 

# Goldman Sachs Funds—Global Environmental Impact Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Productos químicos	15,31
Electricidad	11,65
Equipos y componentes eléctricos	10,49
Embalajes y envases	7,41
Fuentes de energía	7,00
Productos para la construcción	6,45
Control medioambiental	6,23
Maquinaria – Varios	5,51
Electrónica	5,19
Semiconductores	4,86
Otros	18,47
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	98,57
Fondos de inversión	0,00
Otros activos y pasivos	1,43
TOTAL	100,00

# Goldman Sachs Funds—Global Equity Income Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencia	5	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% de patrimonio
Valores	mobilia	rios admitidos a cotización en u	na bolsa de valo	res oficial
Accione	s ordina	arias – 97,68 %		
Finlandia	a			
	33.672	Nordea Bank Abp	401.045	1,48
Francia				
	12.581	BNP Paribas S.A.	787.914	2,90
		Gecina S.A.	357.623	1,32
		Klepierre S.A.	285.894	1,05
		Sanofi	218.250	0,80
		Schneider Electric S.E. Vinci S.A.	440.784	1,63
	0.439	VIIICI S.A.	614.555	2,27
			2.705.020	9,97
Alemania		Vonovia S.E.	322.000	1,19
 Irlanda	0.700	vollovia c.E.	022.000	1,10
IIIaiiua	1.908	Accenture Plc. "A"	693.940	2,56
		Medtronic Plc.	351.198	1,29
			1.045.138	3,85
 Italia				-,
	31.931	Enel SpA	245.209	0,90
	36.083	UniCredit SpA	438.818	1,62
			684.027	2,52
 Japón				
	10.300	Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	276.457	1,02
Países B				.,,-
1 41363 1	-	INIC Correct NIV	440.404	4.00
		ING Groep NV	442.131	1,63
		Koninklijke KPN NV Royal Dutch Shell Plc. "A"	270.025	1,00
	14.021	Royal Dutch Shell Fic. A	310.109	1,14
			1.022.265	3,77
Singapu		Singapore Exchange Ltd.	301.690	1,11
<b>-</b>	40.000	Singapore Exchange Ltd.	301.090	1,11
España	39.415	Iberdrola S.A.	447.049	1,65
Suiza				
	4.435	Nestlé S.A.	575.969	2,12
	1.168	Roche Holding AG	455.405	1,68
	83	SGS S.A.	252.353	0,93
	4.425	Swiss Re AG	416.607	1,54
	1.632	Zurich Insurance Group AG	675.605	2,49
			2.375.939	8,76
Taiwán				
	32.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	685.394	2,53
Daina III	al al a	Manufacturing Co., Etc.		2,00
Reino Ur		AstraZeneca Plc.	762.886	2,81
	129.438		561.739	2,07
		DS Smith Plc.	330.445	1,22
		Ferguson Plc.	326.494	1,20
	27.053	National Grid Plc.	362.860	1,34
	9.161	Rio Tinto Plc.	571.789	2,11
			2.916.213	10,75
Estados	Unidos			
	4.000	Ameren Corp.	336.080	1,24
	2.824	American Tower Corp.	752.794	2,78
		Apple, Inc.	628.084	2,32
		AT&T, Inc.	376.001	1,39
		AvalonBay Communities, Inc.	369.054	1,36
		Bristol-Myers Squibb Co.	385.223	1,42
		Cisco Systems, Inc.	606.522	2,24
		Coca-Cola Co.	585.362	2,16
		Eaton Corp., Plc.	667.918	2,46

2.892 Fidelity National Information Services, Inc.  1.385 Home Depot, Inc. 3.137 Honeywell International, Inc. 2.433 Illinois Tool Works, Inc. 3.715 Johnson & Johnson 5.393 JP Morgan Chase & Co. 1.434 McDonald's Corp. 3.518 Microsoft Corp. 3.518 Microsoft Corp. 1.2590 Proter & Gamble Co. 2.590 Proter & Gamble Co. 2.590 Prologis, Inc. 1.938 QUALCOMM, Inc. 3.583 Texas Instruments, Inc. 5.265 Truist Financial Corp. 3.043 Walmart, Inc. 5.269 Xcel Energy, Inc.  13.  TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS (coste USD 23.179.515) 26.  TOTAL DE DERECHOS (coste USD 0)  Fondos de inversión – 2,27 % Irlanda 616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de	438.931 304.585 559.831 642.458 572.801 587.936 859.914 353.452 182.048 562.134 396.270 357.697 697.073 314.215 431.376 342.959 310.718	1,62 1,12 2,06 2,37 2,11 2,17 3,17 1,30 4,36 2,07 1,46 1,32 2,57 1,16 1,59 1,26 49,08
1.942 Ecolab, Inc.  2.892 Fidelity National Information Services, Inc.  1.365 Home Depot, Inc.  3.137 Honeywell International, Inc.  2.433 Illinois Tool Works, Inc.  3.715 Johnson & Johnson  5.393 JP Morgan Chase & Co.  1.434 McDonald's Corp.  3.518 Microsoft Corp.  3.800 Procter & Gamble Co.  2.590 Prologis, Inc.  1.938 QUALCOMM, Inc.  3.583 Texas Instruments, Inc.  5.265 Truist Financial Corp.  3.043 Walmart, Inc.  5.269 Xcel Energy, Inc.  13.  TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS (coste USD 23.179.515)  26.  Derechos – 0,08 %  Alemania  5.739 Vonovia S.E.—Derechos  TOTAL DE DERECHOS (coste USD 0)  Fondos de inversión – 2,27 % Irlanda  616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X)(a)(b)	304.585 559.831 642.458 572.801 587.936 859.914 353.452 182.048 562.134 396.270 357.697 697.073 314.215 431.376 342.959 310.718	1,12 2,06 2,37 2,11 2,17 3,17 1,30 4,36 2,07 1,46 1,32 2,57 1,16 1,59 1,26
2.892 Fidelity National Information Services, Inc.  1.385 Home Depot, Inc. 3.137 Honeywell International, Inc. 2.433 Illinois Tool Works, Inc. 3.715 Johnson & Johnson 5.393 JP Morgan Chase & Co. 1.434 McDonald's Corp. 3.518 Microsoft Corp. 3.518 Microsoft Corp. 1.5269 Protegis, Inc. 1.938 QUALCOMM, Inc. 3.583 Texas Instruments, Inc. 5.265 Truist Financial Corp. 3.043 Walmart, Inc. 5.269 Xcel Energy, Inc.  TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS (coste USD 23.179.515)  26.  TOTAL DE DERECHOS (coste USD 0)  Fondos de inversión – 2,27 % Irlanda 616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X)(a)(b)	304.585 559.831 642.458 572.801 587.936 859.914 353.452 182.048 562.134 396.270 357.697 697.073 314.215 431.376 342.959 310.718	1,12 2,06 2,37 2,11 2,17 3,17 1,30 4,36 2,07 1,46 1,32 2,57 1,16 1,59 1,26
Services, Inc.   1.385   Home Depot, Inc.   1.385   Home Depot, Inc.   3.137   Honeywell International, Inc.   2.433   Illinois Tool Works, Inc.   3.715   Johnson & Johnson   5.393   JP Morgan Chase & Co.   1.434   McDonald's Corp.   3.518   Microsoft Corp.   0.518   Microsoft Corp.   1.518   Microsoft Corp.   1.519   McDonald's Corp.   1.51	559.831 642.458 572.801 587.936 859.914 353.452 182.048 562.134 396.270 357.697 697.073 314.215 431.376 342.959 310.718	2,06 2,37 2,11 2,17 3,17 1,30 4,36 2,07 1,46 1,32 2,57 1,16 1,59 1,26 49,08
1.385 Home Depot, Inc. 3.137 Honeywell International, Inc. 2.433 Illinois Tool Works, Inc. 3.715 Johnson & Johnson 5.393 JP Morgan Chase & Co. 1.434 McDonald's Corp. 3.518 Microsoft Corp. 3.800 Procter & Gamble Co. 2.590 Prologis, Inc. 1.938 QUALCOMM, Inc. 3.583 Texas Instruments, Inc. 5.265 Truist Financial Corp. 3.043 Walmart, Inc. 5.269 Xcel Energy, Inc.  13.  TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS (coste USD 23.179.515) 26.  Derechos — 0,08 % Alemania 5.739 Vonovia S.E.—Derechos  TOTAL DE DERECHOS (coste USD 0)  Fondos de inversión — 2,27 % Irlanda 616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X)(a)(b)	559.831 642.458 572.801 587.936 859.914 353.452 182.048 562.134 396.270 357.697 697.073 314.215 431.376 342.959 310.718	2,06 2,37 2,11 2,17 3,17 1,30 4,36 2,07 1,46 1,32 2,57 1,16 1,59 1,26 49,08
3.137 Honeywell International, Inc. 2.433 Illinois Tool Works, Inc. 3.715 Johnson & Johnson 5.393 JP Morgan Chase & Co. 1.434 McDonald's Corp. 3.518 Microsoft Corp. 3.518 Microsoft Corp. 1.3.800 Procter & Gamble Co. 2.590 Prologis, Inc. 1.938 QUALCOMM, Inc. 3.583 Texas Instruments, Inc. 5.265 Truist Financial Corp. 3.043 Walmart, Inc. 5.269 Xcel Energy, Inc.  13.  TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS (coste USD 23.179.515) 26.  Derechos – 0,08 % Alemania 5.739 Vonovia S.E.—Derechos  TOTAL DE DERECHOS (coste USD 0)  Fondos de inversión – 2,27 % Irlanda 616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X)(a)(b)	642.458 572.801 587.936 859.914 353.452 182.048 562.134 396.270 357.697 697.073 314.215 431.376 342.959 310.718	2,37 2,11 2,17 3,17 1,30 4,36 2,07 1,46 1,32 2,57 1,16 1,59 1,26 49,08
2.433 Illinois Tool Works, Inc. 3.715 Johnson & Johnson 5.393 JP Morgan Chase & Co. 1.434 McDonald's Corp. 3.518 Microsoft Corp. 3.800 Procter & Gamble Co. 2.590 Prologis, Inc. 1.938 QUALCOMM, Inc. 3.583 Texas Instruments, Inc. 5.265 Truist Financial Corp. 3.043 Walmart, Inc. 5.269 Xcel Energy, Inc.  13.  TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS (coste USD 23.179.515) 26.  TOTAL DE DERECHOS (coste USD 0)  Fondos de inversión – 2,27 % Irlanda 616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X)(a)(b)	572.801 587.936 859.914 353.452 182.048 562.134 396.270 357.697 697.073 314.215 431.376 342.959 310.718	2,11 2,17 3,17 1,30 4,36 2,07 1,46 1,32 2,57 1,16 1,59 1,26 49,08
3.715 Johnson & Johnson 5.393 JP Morgan Chase & Co. 1.434 McDonald's Corp. 3.518 Microsoft Corp. 3.800 Procter & Gamble Co. 2.590 Prologis, Inc. 1.938 QUALCOMM, Inc. 3.583 Texas Instruments, Inc. 5.265 Truist Financial Corp. 3.043 Walmart, Inc. 5.269 Xcel Energy, Inc.  13.  TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS (coste USD 23.179.515) 26.  Derechos – 0,08 % Alemania 5.739 Vonovia S.E.—Derechos  TOTAL DE DERECHOS (coste USD 0)  Fondos de inversión – 2,27 % Irlanda 616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X)(a)(b)	587.936 859.914 353.452 182.048 562.134 396.270 357.697 697.073 314.215 431.376 342.959 310.718	2,17 3,17 1,30 4,36 2,07 1,46 1,32 2,57 1,16 1,59 1,26 49,08
5.393 JP Morgan Chase & Co.  1.434 McDonald's Corp.  3.518 Microsoft Corp.  3.800 Procter & Gamble Co.  2.590 Prologis, Inc.  1.938 QUALCOMM, Inc.  3.583 Texas Instruments, Inc.  5.265 Truist Financial Corp.  3.043 Walmart, Inc.  5.269 Xcel Energy, Inc.  13.  TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS (coste USD 23.179.515)  26.  Derechos - 0,08 %  Alemania  5.739 Vonovia S.E.—Derechos  TOTAL DE DERECHOS (coste USD 0)  Fondos de inversión - 2,27 % Irlanda  616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X)(a)(b)	859.914 353.452 182.048 562.134 396.270 357.697 697.073 314.215 431.376 342.959 310.718	3,17 1,30 4,36 2,07 1,46 1,32 2,57 1,16 1,59 1,26 49,08
1.434 McDonald's Corp. 3.518 Microsoft Corp. 3.500 Procter & Gamble Co. 2.590 Prologis, Inc. 1.938 QUALCOMM, Inc. 3.583 Texas Instruments, Inc. 5.265 Truist Financial Corp. 3.043 Walmart, Inc. 5.269 Xcel Energy, Inc.  13.  TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS (coste USD 23.179.515)  Derechos – 0,08 % Alemania 5.739 Vonovia S.E.—Derechos  TOTAL DE DERECHOS (coste USD 0)  Fondos de inversión – 2,27 % Irlanda 616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X)(a)(b)	.182.048 562.134 396.270 357.697 697.073 314.215 431.376 342.959 310.718	4,36 2,07 1,46 1,32 2,57 1,16 1,59 1,26 49,08
3.800 Procter & Gamble Co. 2.590 Prologis, Inc. 1.938 QUALCOMM, Inc. 3.583 Texas Instruments, Inc. 5.265 Truist Financial Corp. 3.043 Walmart, Inc. 5.269 Xcel Energy, Inc.  13.  TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS (coste USD 23.179.515)  26.  Derechos – 0,08 % Alemania 5.739 Vonovia S.E.—Derechos  TOTAL DE DERECHOS (coste USD 0)  Fondos de inversión – 2,27 % Irlanda 616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X)(a)(b)	562.134 396.270 357.697 697.073 314.215 431.376 342.959 310.718	2,07 1,46 1,32 2,57 1,16 1,59 1,26 49,08
2.590 Prologis, Inc.  1.938 QUALCOMM, Inc. 3.583 Texas Instruments, Inc. 5.265 Truist Financial Corp. 3.043 Walmart, Inc. 5.269 Xcel Energy, Inc.  13.  TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS (coste USD 23.179.515)  26.  Derechos – 0,08 % Alemania 5.739 Vonovia S.E.—Derechos  TOTAL DE DERECHOS (coste USD 0)  Fondos de inversión – 2,27 % Irlanda 616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X)(a)(b)	396.270 357.697 697.073 314.215 431.376 342.959 310.718 <b>492.955</b>	1,46 1,32 2,57 1,16 1,59 1,26 49,08
1.938 QUALCOMM, Inc. 3.583 Texas Instruments, Inc. 5.265 Truist Financial Corp. 3.043 Walmart, Inc. 5.269 Xcel Energy, Inc.  13.  TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS (coste USD 23.179.515) 26.  Derechos – 0,08 % Alemania 5.739 Vonovia S.E.—Derechos  TOTAL DE DERECHOS (coste USD 0)  Fondos de inversión – 2,27 % Irlanda 616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X)(a)(b)	357.697 697.073 314.215 431.376 342.959 310.718 492.955	1,32 2,57 1,16 1,59 1,26 49,08
3.583 Texas Instruments, Inc. 5.265 Truist Financial Corp. 3.043 Walmart, Inc. 5.269 Xcel Energy, Inc.  13.  TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS (coste USD 23.179.515) 26.  Derechos – 0,08 % Alemania 5.739 Vonovia S.E.—Derechos  TOTAL DE DERECHOS (coste USD 0)  Fondos de inversión – 2,27 % Irlanda 616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X)(a)(b)	697.073 314.215 431.376 342.959 310.718 492.955	2,57 1,16 1,59 1,26 49,08
5.265	314.215 431.376 342.959 310.718 <b>492.955</b>	1,16 1,59 1,26 49,08 <b>97,68</b>
3.043 Walmart, Inc. 5.269 Xcel Energy, Inc.  13.  TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS (coste USD 23.179.515)  Derechos – 0,08 % Alemania 5.739 Vonovia S.E.—Derechos  TOTAL DE DERECHOS (coste USD 0)  Fondos de inversión – 2,27 % Irlanda 616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X)(a)(b)	431.376 342.959 310.718 <b>492.955</b>	1,59 1,26 49,08 <b>97,68</b>
5.269 Xcel Energy, Inc.  13.  TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS (coste USD 23.179.515)  26.  Derechos – 0,08 % Alemania 5.739 Vonovia S.E.—Derechos  TOTAL DE DERECHOS (coste USD 0)  Fondos de inversión – 2,27 % Irlanda 616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X)(a)(b)	342.959 310.718 <b>492.955</b>	1,26 49,08 <b>97,68</b>
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS (coste USD 23.179.515)  Derechos – 0,08 % Alemania 5.739 Vonovia S.E.—Derechos  TOTAL DE DERECHOS (coste USD 0)  Fondos de inversión – 2,27 % Irlanda 616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X)(a)(b)	.310.718 .492.955	49,08 <b>97,68</b>
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS (coste USD 23.179.515) 26.  Derechos – 0,08 % Alemania 5.739 Vonovia S.E.—Derechos  TOTAL DE DERECHOS (coste USD 0)  Fondos de inversión – 2,27 % Irlanda 616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X)(a)(b)	492.955	97,68
(coste USD 23.179.515) 26.  Derechos – 0,08 % Alemania 5.739 Vonovia S.E.—Derechos  TOTAL DE DERECHOS (coste USD 0)  Fondos de inversión – 2,27 % Irlanda 616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X)(a)(b)		<u> </u>
(coste USD 23.179.515) 26.  Derechos – 0,08 % Alemania 5.739 Vonovia S.E.—Derechos  TOTAL DE DERECHOS (coste USD 0)  Fondos de inversión – 2,27 % Irlanda 616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X)(a)(b)		<u> </u>
Alemania 5.739 Vonovia S.E.—Derechos  TOTAL DE DERECHOS (coste USD 0)  Fondos de inversión – 2,27 % Irlanda 616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X)(a)(b)	21.262	0.08
(coste USD 0)  Fondos de inversión – 2,27 % Irlanda  616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X) <sup>(a)(b)</sup>		0,00
Irlanda 616.374 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X) <sup>(a)(b)</sup>	21.262	0,08
Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X) <sup>(a)(b)</sup>		
	616.374	2,27
	616.374	2,27
TOTAL DE VALORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VALORES OFICIAL (coste USD 23.795.889) 27.	.130.591	100,03
VALOR DE MERCADO DE LAS INVERSIONES (coste USD 23.795.889) 27.	.130.591	100,03
OTROS ACTIVOS Y PASIVOS	(7.480)	(0,03)
PATRIMONIO 27.	.123.111	100,00
	Valor de cado en USD	% del
	.130.591	100,03
Otros activos y pasivos	(7.480)	(0,03)
Patrimonio 27		100,00

<sup>(</sup>a) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

<sup>(</sup>b) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

# Goldman Sachs Funds—Global Equity Income Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Bancos	11,96
Productos farmacéuticos	9,90
Fondo de inversión inmobiliaria	7,97
Semiconductores	6,42
Electricidad	6,39
Software	5,48
Venta al por menor	4,95
Ordenadores	4,88
Telecomunicaciones	4,63
Fabricaciones varias	4,57
Otros	30,53
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	97,68
Fondos de inversión	2,27
Derechos	
Inmobiliaria	0,08
TOTAL DE DERECHOS	0,08
Otros activos y pasivos	(0,03)
TOTAL	100,00

# Goldman Sachs Funds—Global Equity Partners ESG Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencia	ıs	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Valores	mobilia	rios admitidos a cotización en una	bolsa de valo	res oficial
Accion	es ordina	arias – 96,46 %		
Finland		Neste OYJ	1.196.754	1,64
				.,
Irlanda	6 190	Accenture Plc. "A"	2.251.303	3,09
	0.130	Accentate Fig. A	2.231.303	
Japón				
		Hoya Corp.	2.069.421	2,84
		Keyence Corp.	1.998.261	2,74
	17.600	Nidec Corp.	2.032.181	2,78
			6.099.863	8,36
Países I	Bajos			
	7.091	Koninklijke DSM NV	1.554.396	2,13
España	326 703	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	1.766.510	2,42
	02000	Zance Ziizae Vizeaya viigeniana e.i. ii	00.0.0	
Suecia				
	86.915	Hexagon AB "B"	1.306.275	1,79
Suiza				
	10.739	Nestlé S.A.	1.394.663	1,91
		UBS Group AG	1.993.631	2,74
		-	3.388.294	4,65
T-1			0.000.20	
Taiwán	23 405	Taiwan Semiconductor		
	20.100	Manufacturing Co., Ltd.—ADR <sup>(a)</sup>	2.806.494	3,85
Reino U	nido	<del> </del>		
		AstraZeneca Plc.	2.741.411	3,76
	58.787	Compass Group Plc.	1.170.979	1,60
	14.108	Ferguson Plc.	2.188.204	3,00
		InterContinental Hotels Group Plc.	1.863.088	2,55
		Reckitt Benckiser Group Plc.	2.398.872	3,29
	167.966	Rentokil Initial Plc.	1.377.029	1,89
			11.739.583	16,09
Estados	Unidos			
		Alphabet, Inc. "A"	3.255.295	4,46
		American Tower Corp.	2.710.484	3,72
		Ball Corp. Boston Scientific Corp.	2.331.496 2.616.663	3,20 3,59
		Burlington Stores, Inc.	2.311.889	3,17
		Cheniere Energy, Inc.	696.568	0,96
	3.637	Costco Wholesale Corp.	2.015.989	2,76
		Elanco Animal Health, Inc.	1.976.737	2,71
	23.369	Fidelity National Information	0.464.000	2.27
	3 782	Services, Inc. Intuit, Inc.	2.461.223 2.559.166	3,37 3,51
		Marsh & McLennan Cos., Inc.	2.467.631	3,38
		Martin Marietta Materials, Inc.	1.458.314	2,00
		NIKE, Inc. "B"	1.487.538	2,04
		Northern Trust Corp.	2.176.521	2,98
		NVIDIA Corp.	1.651.750	2,26
		Procter & Gamble Co. S&P Global, Inc.	2.835.966 1.489.011	3,89 2,04
		Walt Disney Co.	1.748.985	2,04
	20			
			38.251.226	52,44
		ONES ORDINARIAS	70 360 600	06.46
(coste L	JSD 61.36	3.143)	70.360.698	96,46

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Fondos de inve	rsión – 3,07 %		
1rlanda 2 230 477	Goldman Sachs US\$ Treasury		
2.239.477	Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X) <sup>(b)(c)</sup>	2.239.477	3,07
TOTAL DE FOND (coste USD 2.239	OS DE INVERSIÓN 9.477)	2.239.477	3,07
A COTIZACIÓN E OFICIAL	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS EN UNA BOLSA DE VALORES		
(coste USD 63.60	08.620)	72.600.175	99,53
VALOR DE MERO (coste USD 63.60	CADO DE LAS INVERSIONES 08.620)	72.600.175	99,53
OTROS ACTIVOS	S Y PASIVOS	343.385	0,47
PATRIMONIO		72.943.560	100,00
TOTAL DE INVER	RSIONES	Valor de mercado en USD	% del
Total de inversion Otros activos y pa	es (coste USD 63.608.620) isivos	72.600.175 343.385	99,53 0,47
Patrimonio		72.943.560	100,00

<sup>(</sup>a) Los valores se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional)).

(b) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

<sup>(</sup>c) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Bancos	8,14
Software	6,88
Productos farmacéuticos	6,47
Semiconductores	6,11
Venta al por menor	5,93
Electrónica	5,62
Maquinaria – Varios	4,53
Internet	4,46
Servicios comerciales	3,93
Productos cosméticos/cuidado personal	3,89
Otros	40,50
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	96,46
Fondos de inversión	3,07
Otros activos y pasivos	0,47
TOTAL	100,00

#### Goldman Sachs Funds—Global Equity Partners Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Valores mobilia	rios admitidos a cotización en u	na bolsa de valo	res oficial
Acciones ordina			
605.769	Neste OYJ	29.128.745	1,66
Francia			
187.030	Safran S.A.	21.353.576	1,22
Irlanda			
150.229	Accenture Plc. "A"	54.638.287	3,12
Italia			
2.040.223	Davide Campari-Milano NV	29.923.735	1,71
Japón			
	Hoya Corp.	49.441.521	2,82
	Keyence Corp.	46.834.252	2,68
444.500	Nidec Corp.	51.324.114	2,93
		147.599.887	8,43
Países Bajos	<u> </u>		
174.511	Koninklijke DSM NV	38.254.018	2,18
•	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria		
	S.A.	43.346.610	2,48
Suecia			
2.261.444	Hexagon AB "B"	33.988.006	1,94
Suiza			
	UBS Group AG	49.176.920	2,81
 Taiwán	·		
	Taiwan Semiconductor		
072.104	Manufacturing Co., Ltd.—ADR <sup>(a)</sup>	68.600.991	3,92
Reino Unido			
	AstraZeneca Plc.	68.593.142	3,92
346.037	Ferguson Plc.	53.671.653	3,06
752.893	InterContinental Hotels Group Plc.	45.061.068	2,57
706.389	Reckitt Benckiser Group Plc.	58.065.885	3,32
4.019.381	Rentokil Initial Plc.	32.951.921	1,88
		258.343.669	14,75
Estados Unidos			
	Alphabet, Inc. "A"	64.587.160	3,69
4.302	Alphabet, Inc. "C"	12.599.138	0,72
	American Tower Corp.	68.791.854	3,93
	Ball Corp.	58.150.348	3,32
	Boston Scientific Corp.	64.467.792	3,68
	Burlington Stores, Inc.	56.076.202	3,20
	Cheniere Energy, Inc.	16.897.446 47.936.866	0,97 2.74
	Elanco Animal Health, Inc. Fidelity National Information	47.936.866	2,74
004.724	Services, Inc.	59.476.732	3,40
185.318	Honeywell International, Inc.	37.953.126	2,17
91.726	Intuit, Inc.	62.068.232	3,54
	Marsh & McLennan Cos., Inc.	60.079.381	3,43
	Martin Marietta Materials, Inc.	36.443.450	2,08
	NIKE, Inc. "B"	36.816.693	2,10
	Northern Trust Corp.	50.217.653	2,87
	NVIDIA Corp.	40.803.099	2,33
122.576		70.764.978	4,04
122.576 478.368	Procter & Gamble Co.	36 008 307	2 08
122.576 478.368 77.651	S&P Global, Inc.	36.098.397 40.395.932	
122.576 478.368 77.651		40.395.932	2,31
122.576 478.368 77.651 275.383	S&P Global, Inc.		2,06 2,31 52,58

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Fondos de inve	rsión – 2,31 %		
Irlanda			
40.505.510	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X) <sup>(b)(c)</sup>	40.505.510	2,31
		40.505.510	2,31
TOTAL DE FOND (coste USD 40.50	OS DE INVERSIÓN 05.510)	40.505.510	2,31
	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS		
A COTIZACIÓN E	EN UNA BOLSA DE VALORES JSD 1.351.733.916)	1.735.484.433	99,11
A COTIZACIÓN E OFICIAL (coste L	EN UNA BOLSA DE VALORES USD 1.351.733.916) CADO DE LAS INVERSIONES	1.735.484.433	99,11

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones – 0,08 %

Divisa	Compra Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
USD	24.209.842 GBP	17.608.846	21/01/2022	664.987	0,04
USD	5.866.685 CHF	5.357.359	25/01/2022	5.609	0,00
EUR	91.529.073 USD	103.365.172	10/02/2022	1.018.357	0,06
	PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA 1.688.953 0,1				

Compra Div	visa Venta	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente en USD	% de
9.569.888 E	UR 8.476.243	10/02/2022	(96.769)	(0,00)
17.872.721 JF	PY 2.032.959.312	16/02/2022	(202.571)	(0,02)
			(299.340)	(0,02)
		1.	736.874.046	99,19
ACTIVOS Y PA	SIVOS		14.163.628	
IONIO		1.	1.751.037.674	
DE INVERSION	ES			% del
1.351.733.916)	,		184.433	99,11
rados con fines o	de cobertura	1.6	888.953	0,10
			99.340)	(0,02)
ctivos y pasivos		14.1	163.628	0,81
	9.569.888 E 17.872.721 JI VALÍA LATENTE O CELEBRADO DE MERCADO SIONES (coste II ACTIVOS Y PA IONIO DE INVERSION rersiones excluy 1.351.733.916) a latente sobre rados con fines rados con fines	9.569.888 EUR 8.476.243 17.872.721 JPY 2.032.959.312 VALÍA LATENTE SOBRE CONTRATO: O CELEBRADOS CON FINES DE CO DE MERCADO DE LAS SIONES (coste USD 1.351.733.916) ACTIVOS Y PASIVOS IONIO  DE INVERSIONES rersiones excluyendo derivados (coste 1.351.733.916) a latente sobre contratos de divisas a prados con fines de cobertura lafía latente sobre contratos de divisas a rados con fines de cobertura	Compra Divisa   Venta   vencimiento	Section   Compra Divisa   Venta   Fecha de vencimiento   latente en USD

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Royal Bank of Canada, Standard Chartered Bank y State Street Bank & Trust.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,06 %.

<sup>(</sup>a)Los valores se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional)).

<sup>(</sup>b)Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

 $<sup>^{(</sup>c)}$ El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

# Goldman Sachs Funds—Global Equity Partners Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Bancos	8,16
Electrónica	7,92
Software	6,94
Productos farmacéuticos	6,66
Semiconductores	6,25
Maquinaria – Varios	4,62
Internet	4,41
Productos cosméticos/cuidado personal	4,04
Servicios comerciales	3,94
Fondo de inversión inmobiliaria	3,93
Otros	39,93
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	96,80
Fondos de inversión	2,31
Plusvalia latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	0,10
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	(0,02)
Otros activos y pasivos	0,81
TOTAL	100,00

# Goldman Sachs Funds—Global Future Health Care Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencia	ıs	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Accion	es ordina	rios admitidos a cotización en una arias – 95,81 %	bolsa de valo	res oficial
Australi		CSL Ltd.	7.175.758	2,16
China	235 500	Wuxi Biologics Cayman, Inc. 144A <sup>(a)</sup>	3.230.745	0,97
Dinama				
	233.175	Genmab A/S—ADR <sup>(b)</sup>	9.110.147	2,74
Francia	8.552	Sartorius Stedim Biotech	5.211.869	1,57
Italia	65.062	Stevanato Group SpA	1.564.090	0,47
Japón	03.002	Otevariate Group OpA	1.304.000	0,41
oupo	121.800	Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	3.980.643	1,20
		Hoya Corp.	7.427.458	2,23
	106.700	Kyowa Kirin Co., Ltd.	2.981.868	0,90
			14.389.969	4,33
Países E	-	Argenx S.E.—ADR(b)	4.527.576	1,36
		Pharvaris NV	748.149	0,23
			5.275.725	1,59
Suecia				
	27.221	Olink Holding AB—ADR <sup>(b)</sup>	577.085	0,17
Suiza	7.725	Lonza Group AG	6.343.608	1,91
Reino U		<u> </u>		
		AstraZeneca Plc.	9.503.713	2,86
	245.274	Oxford Nanopore Technologies Plc.	2.254.396	0,68
			11.758.109	3,54
Estados	Unidos 47 006	908 Devices, Inc.	1.112.162	0,34
		Agios Pharmaceuticals, Inc.	3.760.435	1,13
		Alexandria Real Estate Equities, Inc.	6.947.131	2,09
		Align Technology, Inc.	5.787.594	1,74
		Allogene Therapeutics, Inc. Alnylam Pharmaceuticals, Inc.	1.599.679 7.087.628	0,48 2,13
		Arena Pharmaceuticals, Inc.	1.400.899	0,42
		Axonics, Inc.	2.025.052	0,61
	63.986	Beam Therapeutics, Inc.	5.105.443	1,54
		Bio-Techne Corp.	857.212	0,26
		Boston Scientific Corp.	9.382.627	2,83
		Bristol-Myers Squibb Co. Catalent, Inc.	1.960.828 12.155.325	0,59 3,66
		Certara, Inc.	1.754.959	0,53
		Cooper Cos., Inc.	3.766.141	1,13
		Danaher Corp.	7.233.598	2,18
		Dexcom, Inc.	5.039.488	1,52
		Edwards Lifesciences Corp. Eli Lilly & Co.	10.440.284 15.738.346	3,14
		Exelixis, Inc.	1.688.135	4,74 0,51
		Figs, Inc. "A"	690.512	0,21
	65.923	Guardant Health, Inc.	6.921.915	2,08
		Halozyme Therapeutics, Inc.	4.686.267	1,41
		IDEXX Laboratories, Inc.	5.918.512	1,78
		Illumina, Inc. Insulet Corp.	6.217.145 10.891.863	1,87 3,28
		Intuitive Surgical, Inc.	11.823.180	3,56
		MaxCyte, Inc.	1.199.051	0,36
	3.447	Mettler-Toledo International, Inc.	5.191.044	1,56
		Neogen Corp.	1.857.416	0,56
		Neurocrine Biosciences, Inc.	8.943.998	2,69
		Novanta, Inc. Pacific Biosciences of California, Inc.	7.212.519 2.699.748	2,17 0,81
		,		•

		Valor de	
Tenencias	Descripción del valor	mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ordin	arias – (continuación)		
Estados Unidos	- (continuación)		
70.764	PerkinElmer, Inc.	13.132.383	3,95
70.387	Quanterix Corp.	2.859.120	0,86
55.534	Rani Therapeutics Holdings, Inc. "A"	1.666.020	0,50
125.048	Rapid Micro Biosystems, Inc. "A"	1.515.582	0,46
10.097	Repligen Corp.	3.004.766	0,91
	Seagen, Inc.	10.228.453	3,08
16.073	Shockwave Medical, Inc.	2.956.789	0,89
163.019	Sonendo, Inc.	1.641.601	0,49
	Tandem Diabetes Care, Inc.	3.045.404	0,92
36.208	Turning Point Therapeutics, Inc.	1.402.336	0,42
30.702	Twist Bioscience Corp.	2.978.094	0,90
	Ultragenyx Pharmaceutical, Inc.	2.373.528	0,72
	Veeva Systems, Inc. "A"	10.095.117	3,04
28.289	West Pharmaceutical Services, Inc.	12.763.148	3,84
	Y-mAbs Therapeutics, Inc.	766.353	0,23
33.569	Zimmer Biomet Holdings, Inc.	4.108.846	1,24
		253.633.676	76,36
TOTAL DE ACCIO	ONES ORDINARIAS		
(coste USD 308.0	10.741)	318.270.781	95,81
Fondos de inve	rsión – 2,80 %		
Irlanda			
9.296.287	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid		
	Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X) <sup>(c)(d)</sup>	9.296.287	2,80
	de distribución X)	3.230.201	2,00
	,		
	OS DE INVERSIÓN	0.206.207	2.00
(coste USD 9.296	i.287)	9.296.287	2,80
TOTAL DE VALO	:287) RES MOBILIARIOS ADMITIDOS	9.296.287	2,80
(coste USD 9.296 TOTAL DE VALO A COTIZACIÓN E	.287) RES MOBILIARIOS ADMITIDOS IN UNA BOLSA DE VALORES		2,80
(coste USD 9.296 TOTAL DE VALO A COTIZACIÓN E OFICIAL (coste U	.287) RES MOBILIARIOS ADMITIDOS IN UNA BOLSA DE VALORES ISD 317.307.028)	9.296.287	2,80 98,61
TOTAL DE VALO A COTIZACIÓN E OFICIAL (coste L VALOR DE MERC	.287)  RES MOBILIARIOS ADMITIDOS IN UNA BOLSA DE VALORES ISD 317.307.028)  CADO DE LAS INVERSIONES	327.567.068	98,61
(coste USD 9.296 TOTAL DE VALO A COTIZACIÓN E OFICIAL (coste L VALOR DE MERO (coste USD 317.3	.287)  RES MOBILIARIOS ADMITIDOS IN UNA BOLSA DE VALORES ISD 317.307.028)  CADO DE LAS INVERSIONES 107.028)	327.567.068 327.567.068	98,61 98,61
COSTE USD 9.296  TOTAL DE VALO A COTIZACIÓN E OFICIAL (COSTE L VALOR DE MER (COSTE USD 317.3  OTROS ACTIVOS	.287)  RES MOBILIARIOS ADMITIDOS IN UNA BOLSA DE VALORES ISD 317.307.028)  CADO DE LAS INVERSIONES 107.028)	327.567.068 327.567.068 4.608.252	98,61 98,61 1,39
(coste USD 9.296 TOTAL DE VALO A COTIZACIÓN E OFICIAL (coste L VALOR DE MERO (coste USD 317.3	.287)  RES MOBILIARIOS ADMITIDOS IN UNA BOLSA DE VALORES ISD 317.307.028)  CADO DE LAS INVERSIONES 107.028)	327.567.068 327.567.068	98,61 98,61
COSTE USD 9.296  TOTAL DE VALO A COTIZACIÓN E OFICIAL (COSTE L VALOR DE MER (COSTE USD 317.3  OTROS ACTIVOS	.287)  RES MOBILIARIOS ADMITIDOS IN UNA BOLSA DE VALORES ISD 317.307.028)  CADO DE LAS INVERSIONES 107.028)	327.567.068 327.567.068 4.608.252	98,61 98,61 1,39
COSTE USD 9.296 TOTAL DE VALO A COTIZACIÓN E OFICIAL (COSTE L VALOR DE MERC (COSTE USD 317.3 OTROS ACTIVOS PATRIMONIO	.287)  RES MOBILIARIOS ADMITIDOS IN UNA BOLSA DE VALORES ISD 317.307.028)  CADO DE LAS INVERSIONES IO7.028)  S Y PASIVOS	327.567.068 327.567.068 4.608.252 332.175.320  Valor de mercado en	98,61 98,61 1,39 100,00 % del
COSTE USD 9.296  TOTAL DE VALO A COTIZACIÓN E OFICIAL (COSTE L VALOR DE MER (COSTE USD 317.3  OTROS ACTIVOS	.287)  RES MOBILIARIOS ADMITIDOS IN UNA BOLSA DE VALORES ISD 317.307.028)  CADO DE LAS INVERSIONES IO7.028)  S Y PASIVOS	327.567.068 327.567.068 4.608.252 332.175.320 Valor de	98,61 98,61 1,39 100,00 % del
COSTE USD 9.296  TOTAL DE VALO A COTIZACIÓN E OFICIAL (COSTE L VALOR DE MERC (COSTE USD 317.3  OTROS ACTIVOS PATRIMONIO  TOTAL DE INVER	.287)  RES MOBILIARIOS ADMITIDOS IN UNA BOLSA DE VALORES ISD 317.307.028)  CADO DE LAS INVERSIONES IO7.028)  S Y PASIVOS	327.567.068 327.567.068 4.608.252 332.175.320  Valor de mercado en	98,61 98,61 1,39 100,00 % del patrimonio
COSTE USD 9.296  TOTAL DE VALO A COTIZACIÓN E OFICIAL (COSTE L VALOR DE MERC (COSTE USD 317.3  OTROS ACTIVOS PATRIMONIO  TOTAL DE INVER	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS IN UNA BOLSA DE VALORES ISD 317.307.028)  CADO DE LAS INVERSIONES IO7.028)  S Y PASIVOS  RSIONES es (coste USD 317.307.028)	327.567.068 327.567.068 4.608.252 332.175.320  Valor de mercado en USD	98,61 98,61 1,39

<sup>(</sup>a) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.

<sup>(</sup>b)Los valores se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional)).

<sup>(</sup>c) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

 $<sup>^{\</sup>rm (d)}{\rm EI}$  rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

# Goldman Sachs Funds—Global Future Health Care Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Atención sanitaria – Productos	36,67
Biotecnología	25,10
Productos farmacéuticos	15,86
Atención sanitaria – Servicios	6,54
Electrónica	3,79
Software	3,04
Equipos y componentes eléctricos	2,17
Fondo de inversión inmobiliaria	2,09
Construcción e ingeniería	0,34
Internet	0,21
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	95,81
Fondos de inversión	2,80
Otros activos y pasivos	1,39
TOTAL	100,00

# Goldman Sachs Funds—Global Future Technology Leaders Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	rios admitidos a cotización en u	ına bolsa de valore	s oficial
Acciones ordina	arias – 98,45 %		
Argentina 89 150	MercadoLibre, Inc.	110.368.592	1,97
	Werdade Eliste, me.	110.000.002	1,01
Australia	Atlantian Corp. Pla. "A"	91.708.705	1,63
	Atlassian Corp. Plc. "A"	91.700.703	1,03
Brasil 720 107	Pagseguro Digital Ltd. "A"	19.153.067	0.24
	ragseguro Digital Eta. A	19.155.007	0,34
China	Bilibili, Inc. "Z"	51.046.433	0,91
	Kingdee International Software	31.040.433	0,91
	Group Co., Ltd.	132.319.953	2,35
8.160.153	Luxshare Precision Industry Co., Ltd. "A"	E4 0E0 204	0.01
804 659	NetEase, Inc.—ADR <sup>(a)</sup>	51.050.291 88.947.006	0,91 1,58
	Silergy Corp.	132.581.507	2,36
	Weimob, Inc. 144A(b)	68.474.218	1,22
		524.419.408	9,33
Alemania			-,
	Infineon Technologies AG	79.376.579	1,41
Irlanda			-,,,,
	Aptiv Plc.	90.449.162	1.61
	7,507.10.	00:110:102	.,
Japón 386 900	Hoya Corp.	62.066.594	1,10
	Nidec Corp.	107.924.970	1,92
	TDK Corp.	58.342.472	1,04
212.300	Tokyo Electron Ltd.	113.345.915	2,02
		341.679.951	6,08
Países Bajos			
-	Adyen NV 144A <sup>(b)</sup>	105.093.015	1,87
371.233	NXP Semiconductors NV	84.407.247	1,50
		189.500.262	3,37
Rusia			
	Yandex NV "A"	91.040.722	1,62
Singapur			
	Sea Ltd.—ADR <sup>(a)</sup>	52.192.332	0,93
Corea del Sur			
	Krafton, Inc.	27.956.113	0,50
182.340	NAVER Corp.	58.666.461	1,04
		86.622.574	1,54
España			
	Cellnex Telecom S.A. 144A(b)	51.685.954	0,92
Taiwán			0,02
	ASMedia Technology, Inc.	90.086.561	1,60
	Delta Electronics, Inc.	61.585.341	1,10
	MediaTek, Inc.	129.200.395	2,30
	United Microelectronics Corp.	94.981.244	1,69
16.199.000	Vanguard International Semiconductor Corp.	90.775.836	1,62
5.131.000	Win Semiconductors Corp.	67.063.238	1,19
		533.692.615	9,50
Fotodoo Unida		333.332.010	
Estados Unidos 766 837	AppLovin Corp. "A"	69.789.835	1,24
	Bill.com Holdings, Inc.	116.457.371	2,07
	Booz Allen Hamilton Holding Corp.	46.152.561	0,82
	C3.ai, Inc. "A"	10.419.063	0,19
	Cadence Design Systems, Inc.	104.972.029	1,87
1.095.263	Cognizant Technology Solutions Corp. "A"	87.007.693	1,55
346.940	Datadog, Inc. "A"	63.670.429	1,13
	Dynatrace, Inc.	49.434.207	0,88

		V-1 d-	
	Descripción	Valor de mercado en	% del
Tenencias	del valor	USD	patrimonio
Acciones ordina	arias – (continuación)		
Estados Unidos -			
595.323	Electronic Arts, Inc.	75.117.856	1,34
984.269	Entegris, Inc.	154.116.840	2,74
116.536	EPAM Systems, Inc.	74.126.219	1,32
365.720	Etsy, Inc.	104.270.429	1,86
401.704	Expedia Group, Inc.	64.814.940	1,15
812.324	Fidelity National Information		
	Services, Inc.	85.553.964	1,52
512.736	Fiserv, Inc.	50.012.269	0,89
330.694	Global Payments, Inc.	39.587.379	0,71
166.875	HubSpot, Inc.	142.676.456	2,54
2.796.964	Marvell Technology, Inc.	209.184.938	3,72
	Match Group, Inc.	88.620.472	1,58
	MKS Instruments, Inc.	85.799.128	1,53
	Motorola Solutions, Inc.	102.923.461	1,83
	Okta, Inc.	60.915.795	1,08
	ON Semiconductor Corp.	102.413.916	1,82
	Palo Alto Networks, Inc.	132.430.342	2,36
	Paylocity Holding Corp.	86.271.356	1,54
	Procore Technologies, Inc.	42.175.222	0,75
	Qualtrics International, Inc. "A"	52.666.234	0,94
	RingCentral, Inc. "A"	64.558.064	1,15
	SBA Communications Corp.	89.307.282	1,59
	Snap, Inc. "A"	70.512.473	1,26
	Snowflake, Inc. "A"	128.799.734	2,29
595.965	Splunk, Inc.	74.686.334	1,33
1.420.252	Twitter, Inc.	64.252.200	1,14
1.576.288	UiPath, Inc. "A"	79.035.080	1,41
5.288.676	Viavi Solutions, Inc.	79.964.781	1,42
662.355	Wolfspeed, Inc.	82.800.999	1,47
498.781	Workday, Inc. "A"	140.711.108	2,50
	Zscaler, Inc.	51.871.127	0,92
		3.228.079.586	57,45
Uruguay		0.220.010.000	
	Dlocal Ltd.	42.034.593	0,75
(coste USD 4.363	ONES ORDINARIAS .487.662)	5.532.004.102	98,45
TOTAL DE VALO	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS		<u> </u>
	N UNA BOLSA DE VALORES		
	SD 4.363.487.662)	5.532.004.102	98,45
VALOR DE MERC	ADO DE LAS INVERSIONES		
(coste USD 4.363		5.532.004.102	98,45
OTROS ACTIVOS	Y PASIVOS	86.986.473	1,55
PATRIMONIO		5.618.990.575	100,00
		Valor de	
		mercado en	% del
TOTAL DE INVER	SIONES	USD	patrimonio
Total de inversione	es (coste USD 4.363.487.662)	5.532.004.102	98,45
Otros activos y pa		86.986.473	1,55
Patrimonio		5.618.990.575	100,00
(-)			

<sup>(</sup>a) Los valores se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional)).

<sup>(</sup>b) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.

# Goldman Sachs Funds—Global Future Technology Leaders Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Software	31,01
Semiconductores	24,61
Internet	17,21
Electrónica	7,33
Servicios comerciales	5,69
Ordenadores	3,79
Telecomunicaciones	3,25
Piezas de recambio y equipos para automóviles	1,61
Fondo de inversión inmobiliaria	1,59
Equipos y componentes eléctricos	1,10
Otros	1,26
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	98,45
Otros activos y pasivos	1,55
TOTAL	100,00

### Goldman Sachs Funds—Global Millennials Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

			Valor de	
Tanan	alaa.	Descripción del valor	mercado en	% del
Tenend			USD	
		rios admitidos a cotización en u	na bolsa de valo	res oficial
		arias – 96,37 %		
Argen		MercadoLibre, Inc.	71.966.759	2,49
		Worddon Ho.	71.000.700	2,10
Brasil		Locaweb Servicos de Internet S.A.	14.025.482	0,49
		Eddaweb dervices de internet d.A.	14.023.402	0,43
Canac		Shopify, Inc. "A"	69.225.142	2,40
		Shopily, inc. A	09.223.142	2,40
China		Bilibili, Inc.—ADR <sup>(a)</sup>	33.846.353	1.17
		Meituan "B" 144A <sup>(b)</sup>	39.392.172	1,37
	584.554	NetEase, Inc.—ADR <sup>(a)</sup>	64.616.599	2,24
		Sunny Optical Technology Group		
	1 172 200	Co., Ltd.	50.031.834	1,74
		Tencent Holdings Ltd. XPeng, Inc.—ADR <sup>(a)</sup>	69.334.192 38.616.258	2,40 1,34
	711.727	At ong, mo. Abit		
			295.837.408	10,26
Franc				
	107.620	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton S.E.	84.371.827	2,93
		validiti G.E.	04.57 1.027	2,33
Alema		CTS Eventim AG & Co. KGaA	28.182.887	0.00
		C13 EVEITIII AG & CO. NGAA	20.102.007	0,98
Irland		Eunarian Dia	E0 602 024	2.02
	1.298.220	Experian Plc.	58.603.924	2,03
Italia	0.054.005	Devide Comment Miles NV	47 000 050	4.05
		Davide Campari-Milano NV Moncler SpA	47.686.253 74.856.572	1,65 2,60
	1.014.323	Worlder OpA		
			122.542.825	4,25
Países	s Bajos			
	201.136	Koninklijke DSM NV	44.090.403	1,53
Norue	-			
	2.479.842	Adevinta ASA	35.413.392	1,23
Singa		0 111 177(0)		
	151.167	Sea Ltd.—ADR <sup>(a)</sup>	45.412.078	1,57
Corea	del Sur			
+		Krafton, Inc.	8.024.542	0,28
	111.330	NAVER Corp.	35.819.552	1,24
			43.844.094	1,52
Españ	ia			
	2.090.594	EDP Renovaveis S.A.	54.521.721	1,89
Taiwá	n			
		MediaTek, Inc.	87.879.548	3,04
	4.226.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	90.514.893	3,14
		Wandacturing Co., Etc.		
			178.394.441	6,18
Reino	Unido			
		Farfetch Ltd. "A"	65.737.282	2,28
	1.156.204	Ocado Group Plc.	28.393.004	0,98
			94.130.286	3,26
Estad	os Unidos			
		Alphabet, Inc. "C"	173.468.053	6,01
		Amazon.com, Inc.	195.294.649 79.719.358	6,77
		American Tower Corp. Ball Corp.	79.719.358 67.990.402	2,76 2,36
		Bumble, Inc. "A"	39.758.893	1,38
		Electronic Arts, Inc.	37.253.257	1,29
		Etsy, Inc.	44.331.184	1,54
		Guardant Health, Inc.	32.753.175	1,14
		Illumina, Inc. Live Nation Entertainment, Inc.	53.756.000 54.820.873	1,86 1,90
	517.020	Live Mation Entertailinent, Inc.	07.020.073	1,90

		Valor de	
Tenencias	Descripción del valor	mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ordina	arias – (continuación)		
Estados Unidos -	- (continuación)		
252.013	Mastercard, Inc. "A"	79.903.242	2,77
437.269	Match Group, Inc.	58.174.268	2,02
272.844	Meta Platforms, Inc. "A"	91.460.037	3,17
876.592	NextEra Energy, Inc.	77.692.349	2,69
504.948	NIKE, Inc. "B"	85.598.785	2,97
182.547	NVIDIA Corp.	60.766.245	2,11
324.400	PayPal Holdings, Inc.	61.113.716	2,12
247.824	Peloton Interactive, Inc. "A"	11.186.775	0,39
1.120.033	Snap, Inc. "A"	54.691.211	1,90
374.050	T-Mobile US, Inc.	41.762.683	1,45
194.171	Ulta Beauty, Inc.	76.293.669	2,64
417.092	Walt Disney Co.	61.183.225	2,12
		1.538.972.049	53,36
	ONES ORDINARIAS		
(coste USD 2.436	.813.570)	2.779.534.718	96,37
Fondos de inve	rsión – 3,40 %		
Irlanda			
98.210.396	Goldman Sachs US\$ Treasury		
	Liquid Reserves Fund (Clase de	98.210.396	2.40
	acciones de distribución X) <sup>(c)(d)</sup>		3,40
		98.210.396	3,40
TOTAL DE FOND (coste USD 98.21	OS DE INVERSIÓN	98.210.396	3,40
<u>`</u>			
	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS		
	N UNA BOLSA DE VALORES ISD 2.535.023.966)	2.877.745.114	99,77
	·	2.077.745.114	33,11
VALOR DE MERO (coste USD 2.535	CADO DE LAS INVERSIONES	2.877.745.114	99,77
<u>`</u>	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		<u>·</u>
OTROS ACTIVOS	Y PASIVUS	6.523.996	0,23
PATRIMONIO		2.884.269.110	100,00
		Valor de	
TOTAL DE INVER	SIONES	mercado en USD	% del patrimonio
	es (coste USD 2.535.023.966)	2.877.745.114 6.523.996	99,77
Otros activos y pa	51705		0,23
Patrimonio		2.884.269.110	100,00

Una parte de estos valores estaba cedida en préstamo a 30 de noviembre de 2021. Consulte la Nota 6.

<sup>(</sup>a) Los valores se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional)).

<sup>(</sup>b) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.

<sup>(</sup>c) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

<sup>(</sup>d) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

### Goldman Sachs Funds—Global Millennials Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Internet	38,26
Semiconductores	8,29
Confección	5,90
Venta al por menor	5,24
Software	4,98
Electricidad	4,58
Servicios comerciales	4,15
Biotecnología	3,00
Entretenimiento	2,88
Servicios financieros diversos	2,77
Otros	16,32
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	96,37
Fondos de inversión	3,40
Otros activos y pasivos	0,23
TOTAL	100,00

### Goldman Sachs Funds—India Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Valores mobilia	rios admitidos a cotización en una l	oolsa de valore	es oficial	Acciones ordina	arias – (continuación)		
Acciones ordina	arias – 98,78 %			India – (continua 535.680	<b>ción)</b> PB Fintech Ltd.	8.664.683	0,36
304.300	Amber Enterprises India Ltd.	12.266.547	0,52	505.077	Persistent Systems Ltd.	27.895.052	1,17
893.419	Angel One Ltd.	12.091.247	0,51	4.407.843	PNC Infratech Ltd.	18.084.032	0,76
2.564.203	APL Apollo Tubes Ltd.	31.526.876	1,32	1.368.423	Quess Corp., Ltd. 144A <sup>(a)</sup>	16.334.826	0,69
396.992	Apollo Hospitals Enterprise Ltd.	30.108.253	1,26	6.963.219	Railtel Corp. of India Ltd.	10.904.210	0,46
173.831	Atul Ltd.	20.172.979	0,85		Reliance Industries Ltd.	53.171.355	2,23
	Avenue Supermarts Ltd. 144A <sup>(a)</sup>	40.821.767	1,71		Rossari Biotech Ltd.	11.470.171	0,48
	Axis Bank Ltd.	77.468.501	3,25		Route Mobile Ltd.	20.484.753	0,86
	Bajaj Consumer Care Ltd.	8.714.276	0,37		SBI Cards & Payment Services Ltd		0,75
	Bajaj Finserv Ltd.	47.555.979	2,00		SBI Life Insurance Co., Ltd. 144A		1,59
	Balrampur Chini Mills Ltd. Brigade Enterprises Ltd.	18.029.480 10.476.735	0,76 0,44		SJS Enterprises Ltd. Sona BLW Precision Forgings Ltd.	6.284.614	0,26
	Capacit'e Infraprojects Ltd.	2.710.989	0,44	3.333.374	144A <sup>(a)</sup>	35.546.415	1,49
	Care Ratings Ltd.	6.057.435	0,11	756.395	Spandana Sphoorty Financial Ltd.		0,17
	Cartrade Tech Ltd.	6.276.663	0,26		State Bank of India	44.733.943	1,88
	Clean Science & Technology Ltd.	7.274.744	0,31	957.763	Stove Kraft Ltd.	12.175.759	0,51
	Coforge Ltd.	30.028.889	1,26	911.341	Sudarshan Chemical Industries Lt	d. 6.836.461	0,29
	Computer Age Management Services			2.967.848	Sun Pharmaceutical Industries Ltd	1. 29.808.517	1,25
	Ltd.	10.381.641	0,44	1.011.052	Sundram Fasteners Ltd.	11.808.005	0,50
3.125.092	Crompton Greaves Consumer			1.203.500	Tata Communications Ltd.	20.859.361	0,88
	Electricals Ltd.	18.677.422	0,78		Tata Consumer Products Ltd.	32.170.752	1,35
	Delta Corp., Ltd.	9.668.299	0,41		Tata Motors Ltd.	43.652.975	1,83
	Devyani International Ltd.	12.550.777	0,53		Tata Power Co., Ltd.	22.761.747	0,96
	Divi's Laboratories Ltd.	34.094.660	1,43		Tatva Chintan Pharma Chem Ltd.	2.894.360	0,12
	Dixon Technologies India Ltd.	27.623.565	1,16 0,74		TeamLease Services Ltd.	16.875.430	0,71
	Emami Ltd. Escorts Ltd.	17.519.573 11.864.885	0,74		Torrent Pharmaceuticals Ltd. Trent Ltd.	15.271.878	0,64
	Federal Bank Ltd.	13.145.777	0,55		Tube Investments of India Ltd.	10.638.196 14.612.489	0,45 0,61
	Fine Organic Industries Ltd.	15.416.996	0,65		UltraTech Cement Ltd.	44.294.306	1,86
	FSN E-Commerce Ventures Ltd.	8.996.372	0,38		United Spirits Ltd.	32.222.091	1,35
	Gland Pharma Ltd. 144A <sup>(a)</sup>	15.078.972	0,63		Valiant Organics Ltd. 144A <sup>(a)</sup>	2.863.315	0,12
	Godrej Properties Ltd.	27.096.795	1,14		Vinati Organics Ltd.	16.264.355	0,68
	Gokaldas Exports Ltd.	10.144.287	0,43		Voltas Ltd.	21.386.344	0,90
1.867.370	Graphite India Ltd.	10.194.549	0,43		Wipro Ltd.	46.261.015	1,94
1.034.082	Grindwell Norton Ltd.	22.266.493	0,94		Zensar Technologies Ltd.	16.464.917	0,69
2.433.514	Gujarat Gas Ltd.	21.767.266	0,91	19.644.576	Zomato Ltd.	39.875.986	1,67
3.174.944	HCL Technologies Ltd.	48.226.036	2,03			2.352.066.437	98,78
5.330.458	Hindalco Industries Ltd.	29.454.781	1,24			2.332.000.437	90,70
	Hindustan Unilever Ltd. Home First Finance Co. India Ltd.	12.000.840	0,50	TOTAL DE ACCIO (coste USD 2.355	ONES ORDINARIAS i.034.837)	2.352.066.437	98,78
	144A <sup>(a)</sup>	11.934.263	0,50	TOTAL DE VALO	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS A		
	Honeywell Automation India Ltd. ICICI Bank Ltd.	12.214.633 156.865.458	0,51 6,59		UNA BOLSA DE VALORES OFICI		00.70
	ICICI bank Etd.  ICICI Lombard General Insurance Co., Ltd. 144A <sup>(a)</sup>	21.927.202	0,92	VALOR DE MERO	CADO DE LAS INVERSIONES	2.352.066.437	98,78
471.463	Info Edge India Ltd.	36.505.013	1,53	EXCLUYENDO D			
	Infosys Ltd.	100.227.520	4,21	(coste USD 2.355	.034.837)	2.352.066.437	98,78
4.043.332	Infosys Ltd.—ADR(b)	92.956.203	3,90	Contratos do fu	tures (0.03 %)		
927.874	Ipca Laboratories Ltd.	25.930.222	1,09	Contratos de lu	turos – (0,03 %)		
	ISGEC Heavy Engineering Ltd.	10.181.519	0,43		Va merca	lor de do de Minusvalía	
3.448.332	Jindal Steel & Power Ltd.	15.866.685	0,67	Número de	la asign		% del
	JK Cement Ltd.	14.929.746	0,63	contratos Desc	ripción del valor	USD USD	patrimonio
	JK Lakshmi Cement Ltd.	12.236.681	0,51	USD			
	Jubilant Foodworks Ltd.	26.003.363	1,09	714 Futu	ros sobre el		
	Kajaria Ceramics Ltd.	20.680.326	0,87		Nifty 50 Index		
	KEI Industries Ltd. Kotak Mahindra Bank Ltd.	21.712.780	0,91	30/12	2/2021 Larga 24.36	6.678 (666.908)	(0,03)
	L&T Technology Services Ltd. 144A <sup>(a)</sup>	42.296.087 24.107.058	1,78 1,01	MINUSVALÍA LAT	ENTE SOBRE CONTRATOS DE		
1.265.614	Lupin Ltd.  Mahindra & Mahindra Financial	14.916.639	0,63	FUTUROS	CADO DE LAS INVERSIONES	(666.908)	(0,03)
5.025.407	Services Ltd.	12.078.528	0,51	(coste USD 2.355		2.351.399.529	98,75
2.597.325	Mahindra Lifespace Developers Ltd.	8.861.370	0,37		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		
	Mahindra Logistics Ltd. 144A <sup>(a)</sup>	14.240.336	0,60	OTROS ACTIVOS	S Y PASIVOS	29.694.896	1,25
	Marico Ltd.	22.233.706	0,93	PATRIMONIO		2.381.094.425	100,00
402.380	Maruti Suzuki India Ltd.	37.914.778	1,59				
381.136	MTAR Technologies Ltd.	10.742.872	0,45				
	Navin Fluorine International Ltd.	35.253.535	1,48				
	Newgen Software Technologies Ltd.	19.485.048	0,82				
1.690.681	Oberoi Realty Ltd.	18.803.156	0,79				

## Goldman Sachs Funds—India Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Valor de mercado en USD	% del patrimonio
2.352.066.437	98,78
(666.908)	(0,03)
29.694.896	1,25
2.381.094.425	100,00
	mercado en USD 2.352.066.437 (666.908) 29.694.896

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,00 %.

(a) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
(b) Los valores se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional)).

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Bancos	14,05
Ordenadores	12,48
Productos para la construcción	6,23
Productos farmacéuticos	5,78
Alimentación, bebidas y tabaco	5,70
Productos químicos	4,98
Internet	4,55
Seguros	4,51
Fabricantes de automóviles	3,42
Software	3,08
Otros	34,00
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	98,78
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(0,03)
Otros activos y pasivos	1,25
TOTAL	100,00

### Goldman Sachs Funds—Japan Equity Partners Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado (en miles) en JPY	% del patrimonio
Valores mobiliari	os admitidos a cotización en una be	olsa de valores o	ficial
Acciones ordinar			
Japón	,		
853 500	Advantest Corp.	8.563.751	2,71
	AGC, Inc.	11.264.734	3,57
	Ajinomoto Co., Inc.	14.264.463	4,51
	Asics Corp.	6.680.227	2,11
	Daiichi Sankyo Co., Ltd.	6.713.641	2,12
	Daikin Industries Ltd.	1.893.305	0,60
	Fast Retailing Co., Ltd.	2.455.473	0,78
	Fuji Electric Co., Ltd.	12.397.357	3,92
	Hamamatsu Photonics KK	4.698.966	1,49
397.400	Hikari Tsushin, Inc.	6.540.910	2,07
1.076.600	Hoya Corp.	19.446.970	6,16
1.368.700		5.784.619	1,83
139.500	•	9.808.778	3,10
719.300	Kurita Water Industries Ltd.	3.798.673	1,20
	Kyowa Kirin Co., Ltd.	6.181.793	1,96
	Nidec Corp.	17.966.550	5,69
592.500		10.697.069	3,39
1.265.300	Nomura Research Institute Ltd.	6.209.989	1,96
	NTT Data Corp.	11.993.761	3,80
428.500	Obic Co., Ltd.	9.038.556	2,86
	Olympus Corp.	15.833.150	5,01
	ORIX Corp.	12.338.020	3,90
938.700	Otsuka Corp.	4.871.619	1,54
	Recruit Holdings Co., Ltd.	12.983.095	4,11
966.000		18.316.668	5,80
205.100	SMC Corp.	14.869.909	4,71
1.172.400	SoftBank Group Corp.	7.048.957	2,23
1.500.000	Sony Group Corp.	20.735.198	6,56
782.500	Taiyo Yuden Co., Ltd.	4.914.786	1,56
1.620.400		9.215.613	2,92
1.383.000		6.752.810	2,14
4.267.800	·	3.209.681	1,02
4.207.000	2 Holdings Gorp.	307.489.091	97,33
TOTAL DE ACCIO	ONES ORDINARIAS	007.400.001	07,00
	JPY 259.469.808)	307.489.091	97,33
Fondos de invers Irlanda	sión – 0,94 %		
298.951	Goldman Sachs Yen Liquid		
200.001	Reserves Fund (Clase de acciones		
	de acumulación X) <sup>(a)(b)</sup>	2.972.915	0,94
TOTAL DE EOND	OS DE INVERSIÓN		
(coste (en miles)		2.972.915	0,94
	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS N UNA BOLSA DE VALORES		
(coste (en miles)	JPY 262.442.778)	310.462.006	98,27
EXCLUYENDO DI			
(coste (en miles)	JPY 262.442.778)	310.462.006	98,27
Contratos de divi	sas a plazo específicos de una clas	e de acciones -	(0,35 %)

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones – (0,35 %)

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente (en miles) en JPY	% del patrimonio
JPY	798.405.740	GBP	5.218.291	21/01/2022	13.467	0,01
JPY	5.959.361	CHF	48.266	25/01/2022	19	0,00
JPY	376.462.887	EUR	2.918.387	10/02/2022	2.108	0,00
JPY	2.178.092.916	USD	19.060.855	16/02/2022	34.286	0,01
	ALÍA LATENTE CELEBRADOS			OS DE DIVISAS A OBERTURA	49.880	0,02

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones - (continuación)

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	latente (en miles) en JPY	% del
GBP	104.708.283		16.349.101.947	21/01/2022	(598.820)	(0,18)
CHF	1.086.735		135.206.381	25/01/2022	(1.462)	(0,00)
EUR	65.250.873	JPY	8.380.570.172	10/02/2022	(10.551)	(0,00)
USD	393.695.193	JPY	44.829.114.372	16/02/2022	(549.534)	(0,19)
VALO		ADO D	E LAS INVERSION 2.442.778)		(1.160.367)	97,92
OTRO	S ACTIVOS	Y PAS	ivos		6.560.385	2,08
PATR	MONIO				315.911.904	100,00
					Valor de	

TOTAL DE INVERSIONES	mercado (en miles) en JPY	% del patrimonio
Total inversiones excluyendo derivados (coste (en miles) JPY 262.442.778)	310.462.006	98,27
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	49.880	0,02
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	(1.160.367)	(0,37)
Otros activos y pasivos	6.560.385	2,08
Patrimonio	315.911.904	100,00

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Credit Suisse International, Deutsche Bank AG, JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Natwest Markets Plc., Standard Chartered Bank y State Street Bank & Trust.
La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como

porcentaje del VL, es del 0,01 %.

- (a) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- (b) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del (0,184) %.

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Electrónica	13,41
Ordenadores	10,16
Maquinaria – Varios	7,81
Muebles para el hogar	6,56
Productos químicos	5,80
Atención sanitaria – Productos	5,01
Alimentación, bebidas y tabaco	4,51
Telecomunicaciones	4,30
Semiconductores	4,20
Productos para la construcción	4,17
Otros	31,40
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	97,33
Fondos de inversión	0,94
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	0,02
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	(0,37)
Otros activos y pasivos	2,08
TOTAL	100,00

## Goldman Sachs Funds—Japan Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado (en miles) en JPY	% del patrimonio
Valores mobiliari	os admitidos a cotización en una bols	a de valores oficia	ı
Acciones ordinar	rias – 97,18 %		
Japón			
374.900	Advantest Corp.	3.761.629	1,99
398.000	AGC, Inc.	2.198.805	1,16
1.386.700 + 1,052,800	Ajinomoto Co., Inc. Asics Corp.	4.715.151 2.967.737	2,49 1,57
1.019.500	Astellas Pharma, Inc.	1.809.402	0,96
76.600	Bandai Namco Holdings, Inc.	676.737	0,36
322.300	Bell System24 Holdings, Inc.	403.239	0,21
1.511.100	Dai-ichi Life Holdings, Inc.	3.429.842	1,81
1.622.300 48.000	Daiichi Sankyo Co., Ltd. Daikin Industries Ltd.	4.574.163 1.104.236	2,42 0.58
190.500	Denso Corp.	1.580.650	0,38
301.500	Ebara Corp.	1.833.353	0,97
927.400	ENEOS Holdings, Inc.	390.618	0,21
8.400	Fast Retailing Co., Ltd.	563.551	0,30
671.500	Fuji Electric Co., Ltd.	3.978.411	2,10
2.938.800 230.800	Fujikura Ltd. Hamamatsu Photonics KK	1.677.003 1.607.889	0,89 0,85
122.900	Hikari Tsushin, Inc.	2.022.843	1,07
162.800	Hitachi Ltd.	1.083.092	0,57
311.700	Hoya Corp.	5.630.337	2,98
203.900	Ibiden Co., Ltd.	1.444.649	0,76
673.500	Infomart Corp.	692.618	0,37
295.100 74.800	Internet Initiative Japan, Inc. IR Japan Holdings Ltd.	1.434.329 530.951	0,76 0,28
1.857.200	Isuzu Motors Ltd.	2.823.729	1,49
1.172.700	ITOCHU Corp.	3.809.641	2,01
323.900	Japan Airport Terminal Co., Ltd.	1.612.486	0,85
529.800	Japan Steel Works Ltd.	1.809.245	0,96
492.300 345.700	JSR Corp.	2.080.637	1,10
	Kadokawa Corp.	2.076.176	1,10
238.100 70.200	Keisei Electric Railway Co., Ltd. Keyence Corp.	734.714 4.936.030	0,39 2,61
139.100	Kureha Corp.	1.093.554	0,58
175.700	Kurita Water Industries Ltd.	927.884	0,49
1.088.400	Kyowa Kirin Co., Ltd.	3.424.924	1,81
846.800	Lixil Corp.	2.355.245	1,24
215.000 986.800	MISUMI Group, Inc. Mitsubishi Estate Co., Ltd.	1.025.830 1.535.081	0,54 0,81
4.733.800	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	2.830.176	1,50
470.500	Nidec Corp.	6.117.130	3,23
292.100	Nifco, Inc.	904.754	0,48
875.500	Nippon Gas Co., Ltd.	1.239.295	0,65
647.400 126.900	Nippon Sanso Holdings Corp. Nitori Holdings Co., Ltd.	1.552.622 2.291.068	0,82 1,21
343.900	Nomura Research Institute Ltd.	1.687.833	0,89
1.629.000	NTT Data Corp.	3.892.697	2,06
111.100	Obic Co., Ltd.	2.343.486	1,24
1.973.900	Olympus Corp.	4.999.609	2,64
130.600	Open House Co., Ltd.	840.014	0,44
1.422.900 379.200	ORIX Corp. Otsuka Corp.	3.178.665 1.967.954	1,68 1,04
942.100	Persol Holdings Co., Ltd.	3.090.122	1,63
707.900	Recruit Holdings Co., Ltd.	4.861.021	2,57
87.200	Rorze Corp.	1.046.196	0,55
240.000	Sato Holdings Corp.	508.315	0,27
312.000	Seiko Holdings Corp.	681.372	0,36
314.500 80.400	Shin-Etsu Chemical Co., Ltd. SMC Corp.	5.963.346 5.829.063	3,15 3,08
716.500	SoftBank Group Corp.	4.307.896	2,28
112.300	Sompo Holdings, Inc.	522.596	0,28
760.700	Sony Group Corp.	10.515.510	5,56
319.500	Suntory Beverage & Food Ltd.	1.273.654	0,67
262.200	Taiyo Yuden Co., Ltd.	1.646.846	0,87
522.300	Tokio Marine Holdings, Inc. Tokyo Electron Ltd.	2.970.448	1,57

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado (en miles) en JPY	% del patrimonio
	rias – (continuación)		
Japón – (continu	•		
1.287.100	Tokyo Steel Manufacturing Co., Ltd.	1.535.638	0,81
+ 27,800	, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,	110.729	0,06
778.300	Tokyu Corp.	1.216.916	0,64
589.600	Topcon Corp.	1.048.455	0,55
167.600	Toyota Industries Corp.	1.554.023	0,82
3.676.900	Toyota Motor Corp.	7.343.755	3,88
378.300	Toyota Tsusho Corp.	1.860.740	0,98
153.000	Ulvac, Inc.	993.662	0,52
660.400	Unicharm Corp.	3.224.552	1,70
434.700	Usen-Next Holdings Co., Ltd.	1.410.703	0,75
449.000	Ushio, Inc.	942.307	0,50
85.100	ValueCommerce Co., Ltd.	385.355	0,20
514.700	Yamato Holdings Co., Ltd.	1.285.580	0,68
1.708.400	Z Holdings Corp.	1.284.835	0,68
		183.905.791	97,18
	ONES ORDINARIAS ) JPY 161.345.653)	183.905.791	97,18
Fondos de invers	sión – 0,94 %		
178.506	Goldman Sachs Yen Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de acumulación X) <sup>(a)(b)</sup>	1.775.154	0,94
	DOS DE INVERSIÓN ) JPY 1.775.224)	1.775.154	0,94
A COTIZACIÓN E	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS N UNA BOLSA DE VALORES OFICIAL JPY 163.120.877)	185.680.945	98,12
EXCLUYENDO D	ADO DE LAS INVERSIONES ERIVADOS JPY 163.120.877)	185.680.945	98,12
Contratos de div	risas a plazo específicos de una clas	e de acciones -	- (0,25 %)
			,

				Fecha de	Plusvalía latente (en miles) en	
Divisa	Compra	Divisa	Venta	vencimiento	JPY	patrimonio patrimonio
JPY	4.051.344	SEK	321.786	20/01/2022	29	0,00
JPY	439.268.295	GBP	2.894.950	21/01/2022	3.808	0,00
JPY	1.256.875.527	EUR	9.753.548	10/02/2022	5.744	0,01
JPY	164.153.147	USD	1.434.972	16/02/2022	2.760	0,00
PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA 12.341					0,01	

A PLA	ZO CELEBRA	DOS CO	N FINES DE CO	BERTURA	12.341	0,01
Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente (en miles) en JPY	% del patrimonio
SEK	7.000.202	JPY	92.225.977	20/01/2022	(4.726)	(0,00)
GBP	71.011.835	JPY 11.	086.888.187	21/01/2022	(405.245)	(0,22)
EUR	196.942.355	JPY 25.	297.196.824	10/02/2022	(34.526)	(0,02)
USD	31.461.886	JPY 3.	582.198.342	16/02/2022	(43.625)	(0,02)
			RE CONTRATOS N FINES DE COE		(488.122)	(0,26)
	R DE MERCA (en miles) JF		S INVERSIONE: 0.877)	3	185.205.164	97,87
OTRO	S ACTIVOS Y	PASIVOS	1		4.022.627	2,13
PATRII	MONIO				189.227.791	100,00

#### Goldman Sachs Funds—Japan Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

TOTAL DE INVERSIONES	Valor de mercado (en miles) en JPY	% del
Total inversiones excluyendo derivados (coste (en miles) JPY		
163.120.877)	185.680.945	98,12
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo		
celebrados con fines de cobertura	12.341	0,01
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo		
celebrados con fines de cobertura	(488.122)	(0,26)
Otros activos y pasivos	4.022.627	2,13
Patrimonio	189.227.791	100,00

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Credit Suisse International, Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Natwest Markets Plc., Standard Chartered Bank y State Street Bank & Trust.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,00 %.

- Una parte de estos valores estaba cedida en préstamo a 30 de noviembre de 2021. Consulte la Nota 6.
- (a) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- $^{\rm (b)}\,$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del (0,184) %.

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% dei patrimonio
Acciones ordinarias	
Electrónica	7,84
Maquinaria – Varios	6,66
Ordenadores	6,20
Muebles para el hogar	5,56
Fabricantes de automóviles	5,37
Productos farmacéuticos	5,19
Semiconductores	5,12
Productos químicos	4,55
Servicios comerciales	4,48
Seguros	3,66
Otros	42,55
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	97,18
Fondos de inversión	0,94
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados	
con fines de cobertura	0,01
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados	
con fines de cobertura	(0,26)
Otros activos y pasivos	2,13
TOTAL	100,00

### Goldman Sachs Funds—US Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencia	s	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% de
Valores	mobiliario	os admitidos a cotización en una bolsa de	valores oficia	ıl		ias – (continuación)		
Accione	s ordinari	ias - 98,05 %			Estados Unidos -	•		
Dinamar						Globe Life, Inc.	3.768.227	0,42
	82 405	Genmab A/S—ADR <sup>(a)</sup>	3.223.080	0,36	99.475	Healthpeak Properties, Inc.	3.374.192	0,38
Irlanda	02.433	Octimal Alo—Abit	3.223.000	0,30	71.020	Hess Corp.	5.353.488	0,60
mumau	31.489	Allegion Plc.	3.979.580	0,45	11.228 9.973	Home Depot, Inc.	4.538.470 4.198.832	0,51 0,47
	16.921	ICON Plc.	4.653.613	0,52	8.305	Humana, Inc. IDEXX Laboratories, Inc.	5.244.691	0,47
		Trane Technologies Plc.	5.370.712	0,61	20.165	Illinois Tool Works, Inc.	4.747.446	0,53
			14.003.905	1,58	50.391	International Business Machines Corp.	6.001.064	0,68
Países E	Bajos					ITT, Inc.	4.183.957	0,00
	24.044	NXP Semiconductors NV	5.466.884	0,61	36.895	Johnson & Johnson	5.839.003	0,47
Suiza					94.371	JP Morgan Chase & Co.	15.047.456	1,69
	35.822	Chubb Ltd.	6.519.962	0,73	46.920	Kilroy Realty Corp.	3.030.094	0,34
Reino U	nido				15.459	KLA Corp.	6.461.553	0,73
	65.251	AstraZeneca Plc.—ADR <sup>(a)</sup>	3.612.948	0,41	62.200	Lamb Weston Holdings, Inc.	3.214.496	0,36
	60.342	Coca-Cola Europacific Partners Plc.	3.055.115	0,34	46.103	Lennar Corp. "A"	4.993.416	0,56
	22.764	Linde Plc.	7.288.350	0,82	79.548	Liberty Media Corp Liberty SiriusXM "A"	3.948.763	0,44
	68.216	Michael Kors Holdings Ltd.	4.055.441	0,46	30.979	Lincoln Electric Holdings, Inc.	4.264.569	0,48
			18.011.854	2,03	30.297	M&T Bank Corp.	4.509.102	0,51
Estados	Unidos			-	55.363	Marvell Technology, Inc.	4.140.599	0,47
	18.629	Adobe, Inc.	12.880.463	1,45	29.799	Mastercard, Inc. "A"	9.448.071	1,06
		Advance Auto Parts, Inc.	4.977.446	0,56	36.064	McCormick & Co., Inc.	3.131.798	0,35
	152.264	AES Corp.	3.610.179	0,56	33.058	McDonald's Corp.	8.148.136	0,92
		Alphabet, Inc. "A"	24.040.226	2,70	38.349	Meta Platforms, Inc. "A"	12.854.968	1,45
		Alphabet, Inc. "C"	19.578.159	2,20	57.981	Microchip Technology, Inc.	4.962.594	0,56
		Amazon.com, Inc.	37.988.656	4,27	180.731	Microsoft Corp.	60.725.616	6,83
	37.444	Ameren Corp.	3.146.045	0,35	22.929	MKS Instruments, Inc.	3.636.769	0,41
	42.541	•	6.570.883	0,74	70.512	Mondelez International, Inc. "A"	4.236.361	0,48
		American Financial Group, Inc.	4.378.992	0,49	46.833	Monster Beverage Corp.	4.044.498	0,46
		American Water Works Co., Inc.	3.787.850	0,43	51.359	NetApp, Inc.	4.729.650	0,53
		AMETEK, Inc.	4.401.046	0,50	9.848	Netflix, Inc.	6.628.984	0,75
		Apple, Inc.	51.686.660	5,81	32.862	Neurocrine Biosciences, Inc.	2.785.712	0,31
		AT&T, Inc.	7.754.448	0,87	73.082	NextEra Energy, Inc.	6.477.258	0,73
	20.091	AvalonBay Communities, Inc.	4.811.594	0,54		NVIDIA Corp.	13.634.765	1,53
	277.005	Bank of America Corp.	12.479.075	1,40	9.161	O'Reilly Automotive, Inc.	5.914.433	0,67
	41.940	Berkshire Hathaway, Inc. "B"	11.690.775	1,32	7.567	Palo Alto Networks, Inc.	4.203.847	0,47
	38.607	BioMarin Pharmaceutical, Inc.	3.374.252	0,38	9.450	Paycom Software, Inc.	4.241.065	0,48
	34.601	Booz Allen Hamilton Holding Corp.	2.944.199	0,33	26.120	PayPal Holdings, Inc.	4.920.747	0,55
	121.246	Boston Scientific Corp.	4.687.370	0,53	24.882	PerkinElmer, Inc.	4.617.602	0,52
	113.699	Bristol-Myers Squibb Co.	6.128.376	0,69	36.712	Pfizer, Inc.	1.949.774	0,22
	95.130	Bumble, Inc. "A"	3.348.576	0,38	42.316	Pinnacle Financial Partners, Inc.	4.114.808	0,46
	32.903	Cadence Design Systems, Inc.	6.077.184	0,68	35.773	Pioneer Natural Resources Co.	6.437.709	0,72
	59.030	Centene Corp.	4.269.050	0,48	26.269	PPG Industries, Inc.	4.106.895	0,46
		Cisco Systems, Inc.	9.164.393	1,03	72.938	Procter & Gamble Co.	10.789.718	1,21
		CMS Energy Corp.	2.967.037	0,33	59.590	Public Service Enterprise Group, Inc.	3.792.308	0,43
		Coca-Cola Co.	4.585.177	0,52	13.559	Public Storage	4.490.334	0,51
		Cognizant Technology Solutions Corp. "A"	4.426.158	0,50	26.551	Quest Diagnostics, Inc.	4.047.434	0,46
	15.286	Constellation Brands, Inc. "A"	3.427.121	0,39	58.233	Raymond James Financial, Inc.	5.806.995	0,65
		Cummins, Inc.	3.486.262	0,39	14.315	Rockwell Automation, Inc.	4.835.178	0,54
	72.823	CVS Health Corp.	6.575.189	0,74	39.952	Ross Stores, Inc.	4.355.168	0,49
		Danaher Corp.	9.424.521	1,06	17.658	S&P Global, Inc.	8.208.851	0,92
	150.170	Devon Energy Corp.	6.437.788	0,72	11.860	Saia, Inc.	3.964.561	0,45
	55.543 46.404	Diamondback Energy, Inc.	6.090.845 5.141.000	0,69 0.58	6.697	Salesforce.com, Inc.	1.988.473	0,22
	46.404 150.986	Discover Financial Services Discovery, Inc. "C"	5.141.099	0,58	22.565	Seagen, Inc.	3.716.907	0,42
	51.553	East West Bancorp, Inc.	3.517.974 3.974.736	0,40 0,45	5.368	Sherwin-Williams Co.	1.792.536	0,20
		Ecolab, Inc.	4.124.865	0,45	9.037	SVB Financial Group	6.492.090	0,73
	33.321	Electronic Arts, Inc.	4.124.605	0,46	28.359	Target Corp.	6.948.806	0,78
	35.196	Eli Lilly & Co.	8.749.022	0,47	14.063	Tesla, Inc.	16.397.458	1,84
		EPAM Systems, Inc.	4.331.705	0,49	39.264	Texas Instruments, Inc.	7.638.811	0,86
	13.009	Essex Property Trust, Inc.	4.483.292	0,50	14.406	Ulta Beauty, Inc.	5.660.405	0,64
	15.266	Estee Lauder Cos., Inc. "A"	5.142.199	0,58	16.214	United Parcel Service, Inc. "B"	3.264.689	0,37
	77.919	Fastenal Co.	4.713.320	0,58	30.382	UnitedHealth Group, Inc.	13.511.179	1,52
	50.660	Fidelity National Information Services,	5.020	3,00	13.374	Veeva Systems, Inc. "A"	3.938.509	0,44
	55.000	Inc.	5.335.511	0,60	57.885	Ventas, Inc.	2.816.684	0,32
	55.456	Fortive Corp.	4.205.783	0,47	25.497	Verisk Analytics, Inc.	5.845.697	0,66
	125.392	Freeport-McMoRan, Inc.	4.744.833	0,53	37.295	Visa, Inc. "A"	7.309.820	0,82
	62.564	General Electric Co.	6.030.544	0,68	124.619	Vontier Corp.	3.961.638	0,45
				2,30	31.885	Walmart, Inc.	4.520.018	0,51

### Goldman Sachs Funds—US Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ordina	arias – (continuación)		
<b>Estados Unidos</b>	s – (continuación)		
18.014	Walt Disney Co.	2.642.474	0,30
12.339	West Pharmaceutical Services, Inc.	5.566.987	0,63
16.204	Workday, Inc. "A"	4.571.310	0,51
62.657	Wyndham Hotels & Resorts, Inc.	4.965.567	0,56
38.455	Yum! Brands, Inc.	4.789.955	0,54
25.121	Zimmer Biomet Holdings, Inc.	3.074.810	0,35
		824.412.170	92,74
(coste USD 585		871.637.855	98,05
Fondos de inve	rsion = 0,55 %		
4.849.639	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X) <sup>(b)(c)</sup>	4.849.639	0,55
TOTAL DE FON (coste USD 4.84	DOS DE INVERSIÓN 19.639)	4.849.639	0,55
	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS N UNA BOLSA DE VALORES		
(coste USD 590.0	53.923)	876.487.494	98,60
VALOR DE MERO EXCLUYENDO D	CADO DE LAS INVERSIONES ERIVADOS		
(coste USD 590.0	53.923)	876.487.494	98,60

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones - 0,21 %

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
EUR	174.653.776	USD	197.237.383	10/02/2022	1.944.985	0,22
			ON FINES DE	OS DE DIVISAS COBERTURA	1.944.985	0,22
Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
USD	4.971.097	EUR	4.408.067	10/02/2022	(56.044)	(0,01)
			BRE CONTRATION FINES DE	TOS DE DIVISAS COBERTURA	(56.044)	(0,01)
	R DE MERCA USD 590.05		LAS INVERSIO		878.376.435	98,81
OTRO	S ACTIVOS Y	PASIV	os		10.564.559	1,19
PATRII	MONIO			1	888.940.994	100,00
				V	alor de	

TOTAL DE INVERSIONES	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Total inversiones excluyendo derivados (coste USD 590.053.923)	876.487.494	98,60
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	1.944.985	0,22
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	(56.044)	(0,01)
Otros activos y pasivos	10.564.559	1,19
Patrimonio	888.940.994	100,00

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A. y HSBC Bank Plc.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del  $\rm VL$ , es del 0,22 %.

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Internet	12,22
Software	11,68
Ordenadores	8,01
Venta al por menor	5,62
Bancos	5,24
Semiconductores	5,17
Productos farmacéuticos	4,01
Servicios financieros diversos	3,85
Atención sanitaria – Productos	3,68
Atención sanitaria – Servicios	3,45
Otros	35,12
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	98,05
Fondos de inversión	0,55
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados	
con fines de cobertura	0,22
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados	
con fines de cobertura	(0,01)
Otros activos y pasivos	1,19
TOTAL	100,00

<sup>(</sup>a) Los valores se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional).

<sup>(</sup>b) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

 $<sup>^{\</sup>rm (c)}$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

## Goldman Sachs Funds—US Focused Growth Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Valores mobilia	rios admitidos a cotización en	una bolsa de valor	es oficial
Acciones ordina	arias – 97,31 %		
Australia			
1.972	Atlassian Corp. Plc. "A"	784.678	1,57
Dinamarca			
	Genmab A/S—ADR <sup>(a)</sup>	849.343	1,70
Irlanda			
	Aptiv Plc.	1.111.991	2,23
Reino Unido	Confetability "A"	440 204	0.04
Estados Unidos	Farfetch Ltd. "A"	418.384	0,84
	Adaptive Biotechnologies Corp.	334.692	0,67
	Adobe, Inc.	1.903.479	3,82
	Alphabet, Inc. "A"	4.470.567	8,96
	Amazon.com, Inc.	3.696.271	7,41
	American Well Corp. "A"	154.751	0,31
	Apple, Inc.	4.815.476	9,66
3.212	Bill.com Holdings, Inc.	975.581	1,96
5.857	Chegg, Inc.	158.959	0,32
1.937	Coupa Software, Inc.	394.276	0,79
	Danimer Scientific, Inc.	105.177	0,21
	Equinix, Inc.	1.060.575	2,13
	Guardant Health, Inc.	534.975	1,07
	HubSpot, Inc.	2.435.867	4,88
	Insulet Corp.	1.043.498	2,09
	Intuitive Surgical, Inc. Live Nation Entertainment, Inc.	1.975.045	3,96 1.53
	Marvell Technology, Inc.	762.014 913.335	1,83
	Mastercard, Inc. "A"	2.657.597	5,33
	Netflix, Inc.	1.828.894	3,67
	NIKE, Inc. "B"	2.137.817	4,29
	NVIDIA Corp.	3.849.424	7,72
1.950	Okta, Inc.	435.260	0,87
6.136	PayPal Holdings, Inc.	1.155.961	2,32
2.782	Seagen, Inc.	458.251	0,92
	ServiceNow, Inc.	1.562.906	3,13
	Snap, Inc. "A"	425.407	0,85
	Snowflake, Inc. "A"	860.468	1,73
	Tesla, Inc.	1.090.210	2,19
	Verial Application Inc. "A"	862.561	1,73
	Verisk Analytics, Inc. Workday, Inc. "A"	1.298.815 1.005.722	2,60
3.303	Workday, Ilic. A	45.363.831	2,02 90,97
TOTAL DE ACCIO	DNES ORDINARIAS	40.000.001	30,37
(coste USD 26.23	ONES ORDINARIAS 87.107)	48.528.227	97,31
Fondos de invers			
	Goldman Sachs US\$ Treasury		
1.400.400	Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X) <sup>(b)(c)</sup>	1.433.458	2,88
TOTAL DE FOND (coste USD 1.433	OS DE INVERSIÓN 3.458)	1.433.458	2,88
	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS EN UNA BOLSA DE VALORES		
(coste USD 27.67	(0.565)	49.961.685	100,19
VALOR DE MERO (coste USD 27.67	CADO DE LAS INVERSIONES (0.565)	49.961.685	100,19
OTROS ACTIVOS	S Y PASIVOS	(93.887)	(0,19)
PATRIMONIO		49.867.798	100,00

TOTAL DE INVERSIONES	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Total de inversiones (coste USD	49.961.685	
27.670.565)	(93.887)	100,19
Otros activos y pasivos	, ,	(0,19)
Patrimonio	49.867.798	100,00

- (a) Los valores se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional).
   (b) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- $^{\rm (c)}\,$  EI rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Internet	22,60
Software	21,63
Ordenadores	9,66
Semiconductores	9,55
Atención sanitaria – Productos	6,72
Servicios financieros diversos	5,33
Servicios comerciales	5,24
Confección	4,29
Biotecnología	3,69
Piezas de recambio y equipos para automóviles	2,23
Otros	6,37
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	97,31
Fondos de inversión	2,88
Otros activos y pasivos	(0,19)
TOTAL	100,00

### Goldman Sachs Funds—US Small Cap Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	<b>.</b>	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	Tenencias		Descripción del valor		Valor merc en U	ado	% de
		rios admitidos a cotización en una			Acciones o			ıuación)			
		arias – 97,56 %	. Bolou do valo	100 0110101	Estados Ur						
Rélgica	o oranic	arias 07,00 /0					ONE Gas,		663.		0,82
- o.g. o u	4.808	Galapagos NV—ADR(a)	234.342	0,29			Onto Innov		1.199.		1,49
rlanda							Ovintiv, Inc		508.		0,63
	12.663	Alkermes Plc.	285.044	0,35				mier Bancorp, Inc.	691.		0,86
Reino Un								k Hotel Trust	778.		0,97
	11.418	Michael Kors Holdings Ltd.	678.800	0,84				nancial Partners, Inc.	1.193.		1,48
Estados							PJT Partne		623.		0,78
	8.557	AAON, Inc.	663.852	0,82				grations, Inc.	787.		0,98
	20.021		660.893	0,82			Primerica, I		589.1 483.		0,73
	13.007	Acadia Healthcare Co., Inc.	731.774	0,91			Quanterix (				0,60 0,99
	13.676	ACADIA Pharmaceuticals, Inc.	261.075	0,32			-	ources Corp.	795. 1.004.:		1,25
	15.545	Adient Plc.	688.799	0,86			RBC Bearing Renasant (	-	849.		1,06
	11.340		405.405	0,50				chnologies, Inc.	936.		1,16
	20.318	•	645.097	0,80			Revolve Gr	-	1.429.		1,78
		Alteryx, Inc. "A"	490.456	0,61			RLI Corp.	oup, inc.	545.		0,68
	19.671		961.715	1,19							
	6.180	'	723.925	0,90		5.284 3.654	Saia, Inc.	echnologies Holdings,	1.766.3 Inc. 728.3		2,19 0,90
	24.773		686.708	0,85				0 .			
	8.501		463.134	0,58				Entertainment, Inc.	1.488.		1,85
		ASGN, Inc.	973.843	1,21				surance Group, Inc.	593.		0,74
	24.678		1.390.359	1,73			Semtech C	•	838.		1,04
	16.051		1.002.867	1,25				Medical, Inc.	1.033.4		1,28
	8.477		464.031	0,58			Sprinklr, Inc		304.9		0,38
	7.771	Badger Meter, Inc.	808.961	1,01			Syneos He		1.287.		1,60
	9.140		732.205	0,91			Tenable Ho	•	1.007.8		1,25
	17.487	'	1.000.256	1,24			Terreno Re	, ,	1.313.		1,63
	7.450		594.436	0,74			Texas Road		865.		1,07
	6.564		735.168	0,91			Timken Co.		688.		0,85
	16.133		964.108	1,20				nmunity Banks, Inc.	1.057.0		1,31
	74.296	, , ,	304.100	1,20			Utz Brands		560.		0,70
	74.230	Inc. "A"	451.348	0,56			Viavi Soluti		416.4		0,52
	3.902	Chart Industries, Inc.	699.707	0,87			-	r Federal, Inc.	935.		1,16
	34.863	·	637.993	0,79			-	Industries, Inc.	521.0		0,65
	18.650		890.724	1,11			Workiva, In		782.		0,97
	12.901	'	409.736	0,51			•	Hotels & Resorts, Inc.	859.		1,07
	8.403		1.109.448	1,38			YETI Holdii	-	719.		0,89
	32.786	'	901.943	1,12				erapeutics, Inc.	208.0		0,26
	9.429		1.583.883	1,97	1	9.069	Zurn Water	Solutions Corp.	680.9		0,85
	14.799	Cytokinetics, Inc.	566.950	0,70					77.330.	059	96,08
	12.095	•	353.537	0,44	TOTAL DE			ARIAS			
	5.540		1.127.445	1,40	(coste USD	71.942	.899)		78.5	528.245	97,56
	21.621		929.919	1,16	Fondos de	inversi	ón – 2.35 %	, n			
		First Merchants Corp.	781.920	0,97	Irlanda		,				
	5.952	·	1.216.886	1,51	4.00	7.005	0-1-10	LIOA T			
	7.180		1.254.346	1,56	1.88			achs US\$ Treasury erves Fund (Clase de			
	16.068		880.526	1,09				e distribución X) <sup>(b)(c)</sup>	1.8	87.635	2,35
	22.510	• • • • • • • • • • • • • • • • • • • •	456.728	0,57	-						
		Green Dot Corp. "A"	364.163	0,45	TOTAL DE			RSION		07.005	
	21.900		745.695	0,93	(coste USD	1.887.0	535)		1.8	87.635	2,35
		Healthcare Realty Trust, Inc.	907.154	1,13	TOTAL DE	VALOR	ES MOBILI	ARIOS ADMITIDOS			
		Houlihan Lokey, Inc.	1.027.574	1,28	A COTIZAC	IÓN EN	UNA BOL	SA DE VALORES OF	ICIAL		
		IDACORP, Inc.	1.038.757	1,29	(coste USD	73.830	.534)		80.4	15.880	99,91
		KBR, Inc.	1.247.258	1,55	VALOR DE	MERCA	ADO DE LA	S INVERSIONES			
	17.005	·	620.342	0,77	EXCLUYEN						
		Kratos Defense & Security			(coste USD	73.830	.534)		80.4	15.880	99,91
		Solutions, Inc.	778.682	0,97				· · ·			4.0/
	12.285	MACOM Technology Solutions			Contratos	de divis	as a plazo	específicos de una c	lase de accio	nes – 0,0	1 %
		Holdings, Inc.	916.584	1,14						Plusvalía	
	39.636	Magnolia Oil & Gas Corp. "A"	763.786	0,95					Fecha de	latente	% de
	10.777	Malibu Boats, Inc. "A"	754.390	0,94	Divisa	Compr	a Divisa	Venta	vencimiento		patrimonio
	10.547	MasTec, Inc.	1.008.821	1,25					-		-
	9.257	Meritage Homes Corp.	1.065.666	1,32	EUR	935.56	2 USD	1.056.431	10/02/2022	10.523	0,01
	9.953	Moog, Inc. "A"	703.976	0,87	PLUSVAL Í	A LATFI	NTE SOBRI	CONTRATOS DE D	IVISAS		
	9.215	National Research Corp.	370.904	0,46				FINES DE COBERT		10.523	0,01
	3.755	Nevro Corp.	328.525	0,41	-						
	4.591	Nexstar Media Group, Inc. "A"	701.092	0,87							
	30.469	NMI Holdings, Inc. "A"	599.630	0,75							
	7 620	Omnicell, Inc.	1.349.582	1,68							

## Goldman Sachs Funds—US Small Cap Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones – (continuación)

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% de patrimonio
USD	50.003	EUR	44.345	10/02/2022	(570)	(0,00)
DIVISAS	ALÍA LATEN A PLAZO C					
COBERT	URA				(570)	(0,00)
	E MERCAD SD 73.830.5		INVERSI	ONES	80.425.833	99,92
OTROS A	CTIVOS Y	PASIVOS			63.976	0,08
PATRIMO	ONIO				80.489.809	100,00
TOTAL D	E INVERSIO	ONES			Valor de mercado en USD	% del
Total inve 73.830.53	rsiones excl 34)	uyendo deri	vados (co	ste USD	80.415.880	99,91
	latente sobr			s a plazo	10.523	0,01
celebrado	a latente sol	de cobertura		as a plazo	(570)	(0,00)
Patrimon	vos y pasivo	JS			63.976 <b>80.489.809</b>	0,08 <b>100,00</b>

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Barclays Bank Plc., Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc. y Royal Bank of Canada.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,01  $\,\%$ .

 $<sup>^{(</sup>c)}$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Bancos	9,25
Semiconductores	6,70
Atención sanitaria – Productos	5,93
Fondo de inversión inmobiliaria	5,13
Servicios financieros diversos	4,08
Distribución/Venta al por mayor	4,01
Software	3,83
Servicios comerciales	3,65
Aeroespacial y defensa	3,51
Seguros	2,90
Otros	48,57
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	97,56
Fondos de inversión	2,35
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	0,01
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	(0,00)
Otros activos y pasivos	0,08
TOTAL	100,00

<sup>(</sup>a) Los valores se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional)).

<sup>(</sup>b) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

## Goldman Sachs Funds—US Technology Opportunities Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencia	s	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Valores	mobiliari	os admitidos a cotización en una l	oolsa de valores of	icial
Accione	s ordina	rias – 98,62 %		
Argentir		•		
·		Managed Street Inc.	5 000 400	4.00
		MercadoLibre, Inc.	5.989.492	1,22
Australi	a			
	34.701	Atlassian Corp. Plc. "A"	13.807.875	2,82
Canadá				
	5.081	Shopify, Inc. "A"	8.160.289	1,67
China				
	138 700	Meituan "B" 144A <sup>(a)</sup>	4.280.550	0,88
Irlanda	100.100	moladii B 1101	1.200.000	0,00
	25.398	Accenture Plc. "A"	9.237.253	1,89
Países E		7.000.11.01.71	0.207.200	.,00
	39.533	NXP Semiconductors NV	8.988.618	1,84
Taiwán	39.333	IVAF Semiconductors IV	0.900.010	1,04
·aiwaii	00.515	Triver Ormina ! :		
	63.513	Taiwan Semiconductor	7 615 944	1 56
Estados	Haidaa	Manufacturing Co., Ltd.—ADR(b)	7.615.844	1,56
Estados	Ullidos			
	18.954	Adobe, Inc.	13.105.175	2,68
	5.469	Alphabet, Inc. "A"	15.938.416	3,26
	10.251	Alphabet, Inc. "C"	30.021.796	6,14
	8.817	Amazon.com, Inc.	31.518.394	6,45
		American Tower Corp.	11.275.645	2,31
	62.549	Analog Devices, Inc.	11.515.271	2,36
	134.847	FF -7	21.868.138	4,47
	214.966		11.904.817	2,44
	13.329	Equinix, Inc.	11.001.090	2,25
	58.054			
		Services, Inc.	6.114.247	1,25
	9.533		8.150.620	1,67
	25.956	•	10.849.089	2,22
	17.260	'	11.908.882	2,44
	256.209	37.	19.161.871	3,92
	21.376	•	6.777.475	1,39
	58.675		19.668.447	4,02
	87.260 135.138	. 65	7.468.583	1,53
		'	45.406.368	9,29
	11.721 12.161	Netflix, Inc. NVIDIA Corp.	7.889.757	1,61 0,83
	18.442	•	4.048.154 10.245.453	2,10
	17.023		7.639.752	1,56
	72.329	•	13.626.060	2,79
	41.558	, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,	12.339.401	2,79
	16.773		11.343.412	2,32
	102.041	-	4.982.662	1,02
	23.577	Snowflake, Inc. "A"	8.538.411	1,75
	72.487		9.084.071	1,86
	65.449		12.733.103	2,60
	220.222		8.661.331	1,77
	98.088	• .	4.918.132	1,01
	50.480	·	14.240.913	2,91
			423.944.936	86,74
TOTAL	DE ACCIO	ONES ORDINARIAS	, , ,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,	00,7 1
	SD 418.7		482.024.857	98,62
		•		

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del
Fondos de i	nversión – 0,00 %		p
Irlanda	77 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución		
	X) <sup>(c)(d)</sup>	77	0,00
	TOTAL DE FONDOS DE INVERSIÓN (coste USD 77)	77	0,00
	E VALORES MOBILIARIOS ADMITIDOS ZACIÓN EN UNA BOLSA DE VALORES OFICIAL		
	(coste USD 418.722.472)	482.024.934	98,62
VALOR	DE MERCADO DE LAS INVERSIONES (coste USD 418.722.472)	482.024.934	98,62
	OTROS ACTIVOS Y PASIVOS	6.743.931	1,38
	PATRIMONIO	488.768.865	100,00
TOTAL DE IN	VERSIONES	Valor de mercado en USD	% de patrimonic
Total de invers	siones (coste USD 418.722.472)	482.024.934	98,62
Otros activos	y pasivos	6.743.931	1,38
Patrimonio		488.768.865	100,00

<sup>(</sup>a) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.

 $<sup>^{\</sup>rm (d)}\,$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Software	31,64
Internet	30,14
Semiconductores	19,30
Ordenadores	6,36
Fondo de inversión inmobiliaria	4,56
Servicios comerciales	2,79
Telecomunicaciones	2,44
Servicios financieros diversos	1,39
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	98,62
Fondos de inversión	0,00
Otros activos y pasivos	1,38
TOTAL	100,00

<sup>(</sup>b) Los valores se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional)).

<sup>(</sup>c) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

## Goldman Sachs Funds—Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias		Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Valores r	nobilia	rios admitidos a cotización en una b	olsa de valo	res oficial
Acciones Canadá	s ordina	arias - 99,47 %		
	6.636	Algonquin Power & Utilities Corp.	90.424	1,82
		Ballard Power Systems, Inc.	23.068	0,46
		Boralex, Inc. "A"	83.259	1,68
		Capital Power Corp.	54.034	1,09
		Innergex Renewable Energy, Inc. Northland Power, Inc.	48.244 173.357	0,97 3,49
		TransAlta Corp.	67.861	1,37
			540.247	10,88
Dinamarc		0		
		Orsted A/S 144A <sup>(a)</sup>	295.003	5,94
	4.150	Vestas Wind Systems A/S	141.467 436.470	2,85 8,79
Finlandia			400.470	0,70
	807	Fortum OYJ	23.461	0,47
Francia				
Alemania		Albioma S.A.	25.063	0,51
Aleiliailia		E.ON S.E.	112.886	2,27
		Encavis AG	24.269	0,49
	6.615	RWE AG	259.677	5,23
			396.832	7,99
Israel	223	SolarEdge Technologies Inc	74.567	1.50
Italia	223	SolarEdge Technologies, Inc.	74.507	1,50
	42.521	Enel SpA	326.534	6,58
	10.294	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	76.486	1,54
-			403.020	8,12
Portugal				
	45.094	EDP - Energias de Portugal S.A.	250.805	5,05
España				
		Acciona S.A.	38.303	0,77
		EDP Renovaveis S.A.	38.233	0,77
		Iberdrola S.A.	315.979	6,36
	1.034	Siemens Gamesa Renewable Energy S.A.	28.735	0,58
	1.385	Solaria Energia y Medio Ambiente S.A.	26.688	0,54
			447.938	9,02
Reino Un				
		Atlantica Sustainable Infrastructure Plc.	93.653	1,89
		Drax Group Plc. SSE Plc.	83.357 232.920	1,68 4,69
	11.241	GOL FIG.	409.930	8,26
Estados l	Jnidos		,	
		Aemetis, Inc.	36.748	0,74
		AES Corp.	122.747	2,47
		American Electric Power Co., Inc.	123.143	2,48
		Archaea Energy, Inc. Avangrid, Inc.	107.500 37.441	2,17 0,75
		Brookfield Renewable Corp. "A"	81.171	1,63
		CMS Energy Corp.	100.522	2,02
	502	Darling Ingredients, Inc.	34.939	0,70
		Dominion Energy, Inc.	122.527	2,47
		Eneti, Inc.	11.205	0,23
		Enphase Energy, Inc.	166.742	3,36
		Green Plains, Inc.	51.837	1,04
		Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital, Inc.	37.236	0,75
	362	IDACORP, Inc.	38.528	0,78
		NextEra Energy Inc	94.389	1,90
	4.2/6	NextEra Energy, Inc.	378.982	7,63

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	rias – (continuación)		
Estados Unidos -	Ormat Technologies, Inc.	39.158	0.79
	Plug Power, Inc.	50.441	1.02
	Renewable Energy Group, Inc.	32.517	0.65
	Shoals Technologies Group, Inc. "A"	25.358	0,53
	Sunnova Energy International, Inc.	34.089	0,69
	Sunrun. Inc.	90.392	1.82
	Xcel Energy, Inc.	113.061	2,28
		1.930.673	38,88
(coste USD 4.989	DNES ORDINARIAS 0.169)	4.939.006	99,47
(coste USD 4.989		4.939.006	99,47
(coste USD 4.989 TOTAL DE VALO A COTIZACIÓN E	.169) RES MOBILIARIOS ADMITIDOS N UNA BOLSA DE VALORES	4.939.006 4.939.006	99,47
(coste USD 4.989 TOTAL DE VALO A COTIZACIÓN E OFICIAL (coste USD 4.989 VALOR DE MERC	.169) RES MOBILIARIOS ADMITIDOS N UNA BOLSA DE VALORES 1.169) CADO DE LAS INVERSIONES	4.939.006	99,47
(coste USD 4.989 TOTAL DE VALO A COTIZACIÓN E OFICIAL (coste USD 4.989 VALOR DE MERC (coste USD 4.989	2.169) RES MOBILIARIOS ADMITIDOS EN UNA BOLSA DE VALORES 2.169) CADO DE LAS INVERSIONES 2.169)	4.939.006 4.939.006	99,47 99,47
(coste USD 4.989 TOTAL DE VALO A COTIZACIÓN E OFICIAL (coste USD 4.989 VALOR DE MERC	2.169) RES MOBILIARIOS ADMITIDOS EN UNA BOLSA DE VALORES 2.169) CADO DE LAS INVERSIONES 2.169)	4.939.006	99,47
(coste USD 4.989 TOTAL DE VALO A COTIZACIÓN E OFICIAL (coste USD 4.989 VALOR DE MERC (coste USD 4.989	2.169) RES MOBILIARIOS ADMITIDOS EN UNA BOLSA DE VALORES 2.169) CADO DE LAS INVERSIONES 2.169)	4.939.006 4.939.006	99,47 99,47
(coste USD 4.989 TOTAL DE VALO A COTIZACIÓN E OFICIAL (coste USD 4.989 VALOR DE MERC (coste USD 4.989 OTROS ACTIVOS	2.169) RES MOBILIARIOS ADMITIDOS IN UNA BOLSA DE VALORES 2.169) CADO DE LAS INVERSIONES 2.169) S Y PASIVOS Valor o	4.939.006 4.939.006 26.506	99,47 99,47 0,53
TOTAL DE VALO A COTIZACIÓN E OFICIAL (coste USD 4.989 VALOR DE MERC (coste USD 4.989 OTROS ACTIVOS PATRIMONIO  TOTAL DE INVER	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS IN UNA BOLSA DE VALORES  0.169) CADO DE LAS INVERSIONES 0.169) S Y PASIVOS  Valor of RESIONES 0.169	4.939.006 4.939.006 26.506 4.965.512 de mercado en	99,47 99,47 0,53 100,00 % del patrimonio
(coste USD 4.989 TOTAL DE VALO A COTIZACIÓN E OFICIAL (coste USD 4.989 VALOR DE MERC (coste USD 4.989 OTROS ACTIVOS PATRIMONIO  TOTAL DE INVER Total de inversior (coste USD 4.989	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS IN UNA BOLSA DE VALORES  2.169) 2.ADO DE LAS INVERSIONES 2.169) 3 Y PASIVOS  Valor of RESIONES 2.169)	4.939.006 4.939.006 26.506 4.965.512 de mercado en USD 4.939.006	99,47 99,47 0,53 100,00 % del patrimonio
TOTAL DE VALO A COTIZACIÓN E OFICIAL (coste USD 4.989 VALOR DE MERC (coste USD 4.989 OTROS ACTIVOS PATRIMONIO  TOTAL DE INVER	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS IN UNA BOLSA DE VALORES  2.169) 2.ADO DE LAS INVERSIONES 2.169) 3 Y PASIVOS  Valor of RESIONES 2.169)	4.939.006 4.939.006 26.506 4.965.512 de mercado en USD	99,47 99,47 0,53 100,00 % del patrimonio

<sup>(</sup>a) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Electricidad	75,30
Fuentes de energía	21,95
Construcción e ingeniería	0,77
Servicios financieros diversos	0,75
Agricultura	0,70
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	99,47
Otros activos y pasivos	0,53
TOTAL	100,00

## Goldman Sachs Funds—Global Infrastructure Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del
Valores mobilia	rios admitidos a cotización en ur		
Acciones ordina Australia		ia poloa ao valo	i do dilolai
80.766	APA Group	549.509	1,28
37.237	NEXTDC Ltd.	321.369	0,75
132.079	Transurban Group	1.288.731	2,99
		2.159.609	5,02
Canadá			
	Boralex, Inc. "A"	222.881	0,52
	Enbridge, Inc.	2.125.665	4,94
	Fortis, Inc.	403.132	0,93
	Keyera Corp. Northland Power, Inc.	460.334 511.357	1,07 1,19
	Pembina Pipeline Corp.	946.510	2,20
	TransCanada Corp.	971.508	2,25
20.0.0	Tunicounida corp.	5.641.387	13,10
China			
	ENN Energy Holdings Ltd.	721.154	1,67
	GDS Holdings Ltd.—ADR <sup>(a)</sup>	208.135	0,48
238.000	Jiangsu Expressway Co., Ltd. "H"	<u>231.421</u> 1.160.710	0,54
Dinamarca		1.160.710	2,69
	Orsted A/S 144A <sup>(b)</sup>	226.926	0,53
Francia			-,
2.707	Aéroports de Paris	318.489	0,74
	Engie S.A.	457.882	1,06
	Veolia Environnement S.A.	237.928	0,55
22.649	Vinci S.A.	2.154.986	5,01
Alemania		3.169.285	7,36
	Vonovia S.E.	258.487	0,60
Hong Kong			-,
174.000	Guangdong Investment Ltd.	231.687	0,54
	Hong Kong & China Gas Co., Ltd.	364.136	0,84
254.001	Kunlun Energy Co., Ltd.	240.013	0,56
Italia		835.836	1,94
	Atlantia SpA	538.034	1,25
	Enav SpA 144A <sup>(b)</sup> Enel SpA	336.577 421.044	0,78 0,98
34.020	Life opA	1.295.655	3,01
España			- 7-
4.309	Aena SME S.A. 144A(b)	636.409	1,48
	Cellnex Telecom S.A. 144A <sup>(b)</sup>	1.655.121	3,85
8.150	EDP Renovaveis S.A.	212.548	0,49
Tailandia		2.504.078	5,82
	Airports of Thailand PCL	284.679	0,66
Reino Unido			-,,,,
170.440	Life Science REIT Plc.	226.789	0,53
724	Linde Plc.	231.803	0,54
	National Grid Plc.	2.357.887	5,48
125.745	Tritax EuroBox Plc. 144A <sup>(b)</sup>	183.141	0,42
Estados Unidos		2.999.620	6,97
	AES Corp.	428.961	1,00
	Ameren Corp.	466.227	1,08
	American Tower Corp.	4.236.597	9,84
	American Water Works Co., Inc.	1.389.416	3,23
	Archaea Energy, Inc.	202.490	0,47
	Atmos Energy Corp.	739.260	1,72
	CenterPoint Energy, Inc.	755.783	1,76
	Cheniere Energy, Inc.	1.519.035	3,53
	CMS Energy Corp.	552.933	1,28
	Consolidated Edison Inc	225 650	
4.088	Crown Castle International Corn	325.650 2 365 516	
4.088 12.737	Consolidated Edison, Inc. Crown Castle International Corp. Edison International	325.650 2.365.516 565.155	0,76 5,49 1,31

		Valor de	
Tenencias	Descripción del valor	mercado en USD	% del patrimonio
	rias – (continuación)		
Estados Unidos -			
9.496	Eversource Energy	802.032	1,86
26.610	Kinder Morgan, Inc.	419.640	0,98
3.356	NextEra Energy Partners LP	287.710	0,67
8.423	NextEra Energy, Inc.	746.530	1,73
	ONEOK, Inc.	771.713	1,79
	PG&E Corp.	352.795	0,82
	SBA Communications Corp.	1.154.703	2,68
	Sempra Energy	1.174.007	2,73
	Targa Resources Corp.	1.067.423	2,48
	WEC Energy Group, Inc.	306.761	0,71
28.327	Williams Cos., Inc.	780.126	1,81
		21.875.135	50,81
TOTAL DE ACCIO (coste USD 41.25	DNES ORDINARIAS 5.756)	42.411.407	98,51
Derechos – 0,04	%		
	Vonovia S.E.—Derechos	16.038	0,04
TOTAL DE DERE	CHOS		
(coste USD 0)	,	16.038	0,04
Fondos de invers Irlanda	sión – 1,66 %		
715.286	Goldman Sachs US\$ Treasury		
	Liquid Reserves Fund (Clase de	е	
	acciones de distribución X)(c)(d)	715.286	1,66
	OS DE INVERSIÓN	745 200	4.66
(coste USD 715.2	(86)	715.286	1,66
	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS IN UNA BOLSA DE VALORES	8	
(coste USD 41.97	1.042)	43.142.731	100,21
VALOR DE MERO	CADO DE LAS INVERSIONES		
(coste USD 41.97		43.142.731	100,21
OTROS ACTIVOS	S Y PASIVOS	(89.668)	(0,21)
PATRIMONIO		43.053.063	100,00
TOTAL DE INVER		Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Total de inversion	ies	43.142.731	
(coste USD 41.97			100,21
Otros activos y pa	,	(89.668)	(0,21)
Patrimonio		43.053.063	100,00
(a) Les veleres es	negocian/están denominados er	LICD (ADD: American	Denesitent

<sup>(</sup>a) Los valores se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional).

(b) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.

(c) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

 $<sup>^{(</sup>d)}$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

### Goldman Sachs Funds—Global Infrastructure Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Electricidad	26,22
Oleoductos y gaseoductos	22,33
Fondo de inversión inmobiliaria	20,04
Construcción e ingeniería	12,52
Servicios comerciales	4,78
Agua	4,32
Gas	4,23
Telecomunicaciones	1,23
Fuentes de energía	1,14
Inmobiliaria	0,60
Otros	1,10
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	98,51
Fondos de inversión	1,66
Derechos Inmobiliaria	0,04
TOTAL DE DERECHOS	0,04
Otros activos y pasivos	(0,21)
TOTAL	100,00

### Goldman Sachs Funds—Global Real Estate Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

		Descripción	Valor de mercado en	% del		Descripción			Valor de rcado en	% de
Tenencias	3	del valor	USD	patrimonio	Tenencias	del valor			USD	patrimoni
Valores	mobilia	rios admitidos a cotización en una	a bolsa de valo	res oficial	Acciones ordina	arias – (continuaci	ón)			
Accione	s ordina	arias – 96,84 %			Reino Unido - (c	•				
Australia						Segro Plc.			943.773	2,2
		APN Industria REIT	1.164.527	2,71		Tritax Big Box REIT			739.159	1,7
		Centuria Office REIT	629.779	1,47		Tritax EuroBox Plc. UNITE Group Plc.	144A <sup>(a)</sup>		351.871 851.101	0,8 1,9
		Charter Hall Long Wale REIT Charter Hall Retail REIT	947.091 1.038.418	2,21 2,42	59.512	UNITE Gloup Fic.				1,9
		Cromwell Property Group	469.851	1,09				4.	.790.491	11,1
	46.889		373.898	0,87	Estados Unidos					
		Stockland	1.232.519	2,87	4.766	Alexandria Real Est	ate Equities, I	nc.	971.168	2,20
		_	5.856.083	13,64	1.855	American Tower Co	p.		494.487	1,1
			5.650.065	13,04	27.945	Brandywine Realty	Trust		367.197	0,86
Bélgica						CoreSite Realty Cor	•		661.243	1,54
	12.450	Warehouses De Pauw CVA	586.482	1,36		Crown Castle Intern	ational Corp.		126.847	0,30
Islas Vírg	jenes Br	itánicas				CubeSmart	lna		443.115	1,03
	692.000	SF Real Estate Investment Trust	309.674	0,72		Digital Realty Trust, Duke Realty Corp.	Inc.		478.777 566.901	1,12 1,32
Canadá						Equinix, Inc.			744.466	1,73
Oanada	11 647	Allied Properties Real Estate				Extra Space Storage	e Inc		668.868	1,56
	11.047	Investment Trust	388.826	0,91		Federal Realty Inves			557.511	1,30
	12.910	Canadian Apartment Properties		•		Healthpeak Properti			735.318	1,71
		REIT	585.573	1,36		Highwoods Propertie			338.366	0,79
	8.108	Granite Real Estate Investment				Life Storage, Inc.			466.983	1,09
	00.004	Trust	639.712	1,49	15.920	MGM Growth Prope	rties LLC "A"		597.637	1,39
	26.604	Summit Industrial Income REIT	476.266	1,11	6.957	Omega Healthcare I	nvestors, Inc.		192.570	0,45
			2.090.377	4,87	300	Orion Office REIT, Ir	IC.		5.337	0,01
Francia					31.437	PennyMac Mortgage	e Investment			
	6.920	Covivio	578.261	1,35	0.040	Trust			570.267	1,33
		Gecina S.A.	793.871	1,85		Prologis, Inc.			.516.230	3,53
	30.697	Klepierre S.A.	654.737	1,52		Realty Income Corp RLJ Lodging Trust			208.373 298.063	0,49 0,69
		<u> </u>	2.026.869	4,72		Simon Property Gro	un Inc		.075.547	2,50
			2.020.009	4,72		SITE Centers Corp.	αρ, πο.		271.607	0,63
Hong Ko	-					Ventas, Inc.			414.097	0,96
1.	791.000	China Merchants Commercial Real	004.040	4.40		Welltower, Inc.			660.142	1,54
		Estate Investment Trust	601.940	1,40	4.598	WP Carey, Inc.			360.437	0,84
Irlanda								13	.791.554	32,12
	391.147	Hibernia REIT Plc.	585.708	1,36					.701.004	02,12
Japón					(coste USD 37.57	NES ORDINARIAS		41	.583.912	96,84
	168	Comforia Residential REIT, Inc.	475.950	1,11	(COSTE OOD 37.37	2.900)		41.	.505.512	30,04
	690	ESCON Japan Reit Investment							Valor de	
		Corp.	832.793	1,94		<b>.</b>			mercado	0/ 1
		GLP J-REIT	739.774	1,72	Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés	en USD	% de patrimonio
		Hulic Reit, Inc.	537.196	1,25						
		Japan Metropolitan Fund Invest	267.592	0,62 2,91	Acciones prefer	rentes – 2,39 %				
		Kenedix Retail REIT Corp.  LaSalle Logiport REIT	1.246.969 654.628	1,53	Estados Unidos					
		Sankei Real Estate, Inc.	529.041	1,23	12.415	PS Business Parks,				
		United Urban Investment Corp.	1.010.144	2,35		Inc. – Serie Y –	Heb	E 200 %	316.831	0.74
		_			27 552	Preferente	USD	5,200 %	316.831	0,74
			6.294.087	14,66	21.553	SL Green Realty Corp. – Serie I –				
Países B	ajos					Preferente	USD	6,500 %	710.867	1,65
	9.494	CTP NV	200.391	0,47				_	1.027.698	2,39
Singapur									1.021.030	2,38
		Ascendas India Trust	243.906	0,57		NES PREFERENTE	S		4 007 000	
	465.152	Ascendas Real Estate Investment			(coste USD 1.021	.032)			1.027.698	2,39
		Trust	996.925	2,32						
		Elite Commercial REIT	629.730	1,47						
		ESR-REIT	522.662	1,22						
		Lendlease Global Commercial REIT	795.541	1,85						
	∠/3.085	Mapletree Industrial Trust	528.780	1,23						
			3.717.544	8,66						
España	65.058	Merlin Properties Socimi S.A.	732.712	1,71						
Reino Un										
		Big Yellow Group Plc.	834.630	1,94						
		British Land Co., Plc.	229.570	0,53						
		Life Science REIT Plc.	219.755	0,51						
	170.419	LondonMetric Property Plc.	620.632	1,45	1	s adiuntas forman p	arto interre	to do	toe ootada-	financia
					∟as nota	s auruntas rorman b	acie integrar	de est		

### Goldman Sachs Funds—Global Real Estate Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Fondos de inve	rsión – 1,00 %		
Irlanda 430.462	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X) <sup>(b)(c)</sup>	430.462	1,00
TOTAL DE FOND (coste USD 430.4	OS DE INVERSIÓN 62)	430.462	1,00
	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS IN UNA BOLSA DE VALORES (5.074)	43.042.072	100,23
VALOR DE MERO (coste USD 39.02	CADO DE LAS INVERSIONES (5.074)	43.042.072	100,23
OTROS ACTIVOS	Y PASIVOS	(99.706)	(0,23)
PATRIMONIO		42.942.366	100,00
TOTAL DE INVER	RSIONES	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Total de inversione Otros activos y pa	es (coste USD 39.025.074) sivos	43.042.072 (99.706)	100,23 (0,23)
Patrimonio		42.942.366	100,00

<sup>(</sup>a) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.

<sup>(</sup>c) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Fondo de inversión inmobiliaria	96,84
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	96,84
Acciones preferentes	2,39
Fondos de inversión	1,00
Otros activos y pasivos	(0,23)
TOTAL	100,00

<sup>(</sup>b) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

# Goldman Sachs Funds—North America Energy & Energy Infrastructure Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

		Valor de	
Tenencias	Descripción del valor	mercado en USD	% del patrimonio
	rios admitidos a cotización en un		
Acciones ordina		ia boisa de vaio	ies official
Canadá			
	Canadian Natural Resources Ltd.	1.820.516	3,34
	Cenovus Energy, Inc.	178.049 2.006.956	0,33
	Enbridge, Inc. Enerplus Corp.	176.901	3,68 0,32
	Gibson Energy, Inc.	417.461	0,77
	Imperial Oil Ltd.	282.567	0,52
	Keyera Corp.	941.129	1,73
	Northland Power, Inc.	108.904 1.634.455	0,20
	Pembina Pipeline Corp. Suncor Energy, Inc.	1.526.768	3,00 2,80
	Tidewater Renewables Ltd.	221.349	0,41
19.604	Tourmaline Oil Corp.	671.506	1,23
38.545	TransCanada Corp.	1.822.583	3,34
		11.809.144	21,67
Dinamarca			
6.223	Vestas Wind Systems A/S	212.132	0,39
Francia	(a)		
5.584	TotalEnergies S.E.—ADR <sup>(a)</sup>	257.869	0,47
Israel	SolarEdge Technologies, Inc.	111.683	0,21
Países Bajos	- Oolar Lage Teermologies, Inc.	111.000	0,21
	Royal Dutch Shell Plc. "A"—ADR(a)	265.588	0,49
Reino Unido	<del>-</del>		
	Atlantica Sustainable Infrastructure		
	Plc.	203.898	0,37
12.061	BP Plc.—ADR <sup>(a)</sup>	314.551	0,58
		518.449	0,95
Estados Unidos		101.070	2.25
	Aemetis, Inc. AES Corp.	191.973 382.039	0,35 0,70
	Antero Midstream Corp.	443.750	0,70
	Antero Resources Corp.	378.968	0,70
	CenterPoint Energy, Inc.	168.452	0,31
	Cheniere Energy, Inc.	2.746.466	5,04
	Chevron Corp. CIVITAS RESOURCES, Inc.	2.287.505 297.291	4,20 0,55
	CNX Resources Corp.	189.547	0,35
	ConocoPhillips	1.487.104	2,73
	Darling Ingredients, Inc.	702.821	1,29
	Devon Energy Corp.	1.075.308	1,97
	Diamondback Energy, Inc.	1.806.429	3,32
	DT Midstream, Inc. DTE Energy Co.	1.120.097 143.759	2,06 0,26
	Duke Energy Corp.	107.099	0,20
	Enphase Energy, Inc.	225.458	0,41
	EOG Resources, Inc.	1.107.178	2,03
	EQT Corp.	182.396	0,33
	Equitrans Midstream Corp.	479.802	0,88
	Exelon Corp. Exxon Mobil Corp.	250.480 3.272.126	0,46 6,00
	Hess Corp.	777.394	1,43
	Hess Midstream LP "A"	739.296	1,36
	Kinder Morgan, Inc.	731.712	1,34
	Marathon Oil Corp.	852.766	1,56
	Marathon Petroleum Corp. NextEra Energy Partners LP	1.101.174 136.997	2,02 0,25
	NextEra Energy, Inc.	167.777	0,25
	ONEOK, Inc.	2.891.294	5,31
	Ovintiv, Inc.	549.663	1,01
	PDC Energy, Inc.	289.717	0,53
	Phillips 66	615.752	1,13
	Pioneer Natural Resources Co. Plains GP Holdings LP "A"	1.054.026 1.930.687	1,93 3,54
	Rattler Midstream LP	118.637	0,22

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	arias – (continuación)		
Estados Unidos			
	Renewable Energy Group, Inc.	144.580	0,27
	Sempra Energy	141.462	0,26
	Targa Resources Corp.	4.216.436	7,74
	Valero Energy Corp.	878.428	1,61
91.986	Williams Cos., Inc.	2.533.294	4,65
		38.917.140	71,42
TOTAL DE ACCIO	ONES ORDINARIAS	52.092.005	95,60
<u> </u>		32.032.003	
Fondos de inve Irlanda	rsion – 3,73 %		
	Goldman Sachs US\$ Treasury		
3	Liquid Reserves Fund (Clase de		
	acciones de distribución X)(b)(c)	9	0,00
Estados Unidos			
	JPMorgan Alerian MLP Index ETN	2.032.353	3,73
TOTAL DE FOND (coste USD 1.795	OS DE INVERSIÓN 5.433)	2.032.362	3,73
A COTIZACIÓN E OFICIAL	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS EN UNA BOLSA DE VALORES		
(coste USD 44.33	33.595)	54.124.367	99,33
VALOR DE MERO (coste USD 44.33	CADO DE LAS INVERSIONES 33.595)	54.124.367	99,33
OTROS ACTIVOS	S Y PASIVOS	366.521	0,67
PATRIMONIO		54.490.888	100,00
TOTAL DE INVER	RSIONES	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Total de inversion	es (coste USD 44.333.595)	54.124.367	99,33
Otros activos y pa	,	366.521	0,67
Patrimonio		54.490.888	100,00

<sup>(</sup>a) Los valores se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional)).

 $<sup>^{\</sup>rm (c)}\,$  EI rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Oleoductos y gaseoductos	45,88
Petróleo y gas	42,47
Electricidad	2,70
Fuentes de energía	2,25
Agricultura	1,29
Servicios comerciales	1,01
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	95,60
Fondos de inversión	3,73
Otros activos y pasivos	0,67
TOTAL	100,00

<sup>(</sup>b) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Valores mobilia Acciones ordina	rios admitidos a cotización en una b arias – 97,43 %	oolsa de valores	oficial	Acciones ordin China – (continu	arias – (continuación) ación)		
Brasil				723.500	China Petroleum & Chemical Corp. "A"	459.955	0,02
763.500	Alpargatas S.A.—Preferente	5.356.388	0,19		China Petroleum & Chemical Corp. "H"	45.040.400	1,58
1.719.100	Ambev S.A.—ADR <sup>(a)</sup>	4.942.413	0,17	10.886.000	China Shenhua Energy Co., Ltd. "H"	22.654.655	0,80
268.855	Arezzo Industria e Comercio S.A.	3.241.872	0,11	21.600	China Tourism Group Duty Free Corp.,		
3.299.310	Banco Bradesco S.A.	10.109.306	0,36		Ltd. "A"	701.783	0,03
5.111.940	Banco Bradesco S.A.—ADR(a)	18.224.066	0,64		China Yangtze Power Co., Ltd. "A"(c)	11.428.151	0,40
416.900	Braskem S.A. "A"—Preferred	3.823.295	0,13	9.921.000	China Yongda Automobiles Services	15.117.580	0.50
	Cia de Transmissao de Energia Eletrica Paulista—Preferente	3.361.876	0,12	7.918.994	Holdings Ltd. Chongqing Changan Automobile Co., Ltd. "A"	21.740.357	0,53 0,76
6.697.900	Cia Energetica de Minas			522 000	Chongqing Rural Commercial Bank	21.740.007	0,70
	Gerais—ADR <sup>(a)</sup>	15.773.554	0,56	022.000	Co., Ltd. "H"	178.368	0,01
	Embraer S.A.—ADR <sup>(a)</sup>	936.563	0,03	10.123.000		9.178.754	0,32
	Enauta Participacoes S.A.	459.380	0,02	832.000	CITIC Securities Co., Ltd. "H"	1.993.310	0,07
	Energisa S.A.	5.925.787	0,21		Contemporary Amperex Technology		
	Equatorial Energia S.A.	810.202	0,03		Co., Ltd. "A"	12.778.061	0,45
	Grendene S.A.	3.130.436	0,11	1.880.000	COSCO SHIPPING Development Co.,		
485.400	Itau Unibanco Holding S.A.	1.740.381	0,06		Ltd. "H"	348.524	0,01
2.418.500	Itau Unibanco Holding S.A.—Preferente	9.686.264	0,34	907.560	COSCO SHIPPING Holdings Co., Ltd. "A"	2.489.217	0,09
465.800	JBS S.A.	2.927.677	0,10	13.666.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	14.215.511	0,50
534.500	Marfrig Global Foods S.A.	2.231.378	0,08		Dago New Energy Corp.—ADR <sup>(a)</sup>	11.638.675	0,41
	Natura & Co. Holding S.A.	209.686	0,01		Dongfeng Motor Group Co., Ltd. "H"	4.852.968	0,17
795.400	Petro Rio S.A.	2.878.858	0,10		Dongyue Group Ltd.	4.489.546	0,16
	Petroleo Brasileiro S.A.—ADR <sup>(a)</sup>	13.651.502	0,48		FAW Jiefang Group Co., Ltd. "A"	2.081.707	0,07
	Petroleo Brasileiro S.A.—Preferente	10.212.578	0,36		FinVolution Group—ADR <sup>(a)</sup>	1.604.064	0,06
	Sao Martinho S.A.	5.210.840	0,18		Focus Media Information Technology	1.001.001	0,00
	SLC Agricola S.A.	370.054	0,01	0.100.200	Co., Ltd. "A"	3.520.148	0,12
1.424.200	•	3.517.014	0,12	1.219.200	GF Securities Co., Ltd. "H"	2.129.091	0,08
	Transmissora Alianca de Energia Eletrica S.A.	3.907.828	0,12	4.359.500	Great Wall Motor Co., Ltd. "H" Guangzhou Baiyunshan	18.387.724	0,65
508 200	Unipar Carbocloro	3.307.020	0, 14		Pharmaceutical Holdings Co., Ltd. "H"	361.858	0,01
300.200	S.A."B"—Preferente	8.248.586	0,29	2.236.000	Haitian International Holdings Ltd.	6.138.208	0,22
2 356 800	Vale S.A.—ADR <sup>(a)</sup>	29.742.816	1,05		Haitong Securities Co., Ltd. "H"	1.764.844	0,06
	Vibra Energia S.A.	1.482.444	0,05		Hangzhou Tigermed Consulting Co., Ltd. "A"	317.111	0,01
		172.113.044	6,05	91.015.000	Industrial & Commercial Bank of China		
Canadá					Ltd. "H"	48.277.915	1,70
	Atlas Corp.	5.474.332	0,19	207.900	JD.com, Inc.—ADR <sup>(a)</sup>	18.251.541	0,64
	Alias Corp.	3.474.332	0,13	41.600	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock		
Chile					Co., Ltd. "A"	1.144.558	0,04
383.819	Banco Santander Chile—ADR(a)	6.828.140	0,24	67.101	JiuGui Liquor Co., Ltd. "A"	2.381.908	0,08
4.721.138	Cencosud S.A.	7.110.455	0,25	146.500	JNBY Design Ltd.	246.939	0,01
103.027	Cia Cervecerias Unidas S.A.—ADR(a)	1.651.008	0,06	21.600	Kweichow Moutai Co., Ltd. "A"	6.578.134	0,23
3.653.464	Falabella S.A.	11.478.911	0,40	12.776.000	Lenovo Group Ltd.	13.147.111	0,46
	<del>-</del>	07.000.544		460.900	Li Auto, Inc.—ADR <sup>(a)</sup>	16.638.490	0,59
		27.068.514	0,95	678.000	Li Ning Co., Ltd.	7.754.462	0,27
China				8.904.000	Lifetech Scientific Corp.	4.849.333	0,17
95.438.000	Agricultural Bank of China Ltd. "H"	31.585.222	1,11	1.879.300	Luxi Chemical Group Co., Ltd. "A"	4.581.847	0,16
	Alibaba Group Holding Ltd.—ADR <sup>(a)</sup>	72.298.464	2,54		Maanshan Iron & Steel Co., Ltd. "H"	1.118.175	0,04
	Angang Steel Co., Ltd. "H"	394.788	0,01	884.900	Meituan "B" 144A <sup>(b)</sup>	27.309.725	0,96
	ANTA Sports Products Ltd.	1.364.339	0,05	1.226.000	Metallurgical Corp. of China Ltd. "H"	312.334	0,01
	BAIC Motor Corp., Ltd. "H" 144A(b)	442.033	0,02	32.700	NetEase, Inc.—ADR <sup>(a)</sup>	3.614.658	0,13
	Bank of China Ltd. "H"	51.939.043	1,83	62.400	NIO, Inc.—ADR <sup>(a)</sup>	2.576.496	0,09
	Bank of Communications Co., Ltd."H"	3.519.477	0,12	5.001.000	PetroChina Co., Ltd. "A"	3.706.514	0,13
	BYD Co., Ltd. "A"	1.669.192	0,06	29.228.000	PetroChina Co., Ltd. "H"	12.769.053	0,45
	BYD Co., Ltd. "H"	24.484.360	0,86	814.500	Pharmaron Beijing Co., Ltd. "H"		
	CGN Power Co., Ltd. "H" 144A <sup>(b)</sup>	2.072.602	0,00		144A <sup>(b)</sup>	16.908.160	0,59
	China BlueChemical Ltd. "H"	2.275.915	0,07		PICC Property & Casualty Co., Ltd. "H"	1.952.548	0,07
	China CITIC Bank Corp., Ltd. "H"	9.983.050	0,08	5.413.000	Postal Savings Bank of China Co., Ltd.		
	China Construction Bank Corp. "H"				"H" 144A <sup>(b)</sup>	3.686.525	0,13
	·	66.774.811	2,35	180.067	Shanghai Bairun Investment		
	China Feihe Ltd. 144A <sup>(b)</sup>	1.534.501	0,05		HoldingGroup Co., Ltd. "A"	1.658.902	0,06
	China Hongqiao Group Ltd. China International Marine Containers	3.307.232	0,12	30.090.761	Shanghai International Port Group Co., Ltd. "A"	22.681.856	0,80
	Group Co., Ltd. "H"	3.543.400	0,13	228.400	Shenzhou International Group		
1.884.000	China Longyuan Power Group Corp., Ltd. "H"	3.886.207	0,14		Holdings Ltd. Sichuan Swellfun Co., Ltd. "A"	4.337.948 9.501.526	0,15 0,33
965.000	China Medical System Holdings Ltd.	1.594.143	0,06				2,50
	China Meidong Auto Holdings Ltd.	1.066.769	0,04				

Page	Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
2,225,000   Semicriment Lath "In"   689 313   0.02   1,706 381   NHPC List   0.707,723   0.02   2,225,000   Semicriment Campalage Camp		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·				,		
1-712000 Stanform Afford Stanford Sta	15.000	Silergy Corp.	2.533.405	0,09	52.626	Mindtree Ltd.	3.039.011	0,11
March   Marc	2.082.000	Sinotrans Ltd. "H"	669.313	0,02	1.706.361	NHPC Ltd.	707.723	0,02
March   Marc	2.225.000	Sinotruk Hong Kong Ltd.	3.309.650	0,12	6.226.919	NMDC Ltd.	11.083.178	0,39
Suchou Mawwell Fechnologies Co.   B. 817.792   C. 20	1.712.000	Sun King Technology Group Ltd.	1.144.400	0,04	2.393.930	Power Finance Corp., Ltd.	3.714.739	
S.548B0Z   TERE A O. LILI 'A'   19.08.881   0.58   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59   0.59						• •	2.667.676	0.09
Time			8.317.792	0,29		•		
Reconst Music Enterlainment Group	5.348.802	TBEA Co., Ltd. "A"	19.368.861	0,68				-,-
Montpole	1.825.800	Tencent Holdings Ltd.	107.892.582	3,79			230.880	0,01
Top-point infermational Hodings Ltd.   144A    144A	49.500	Tencent Music Entertainment Group—			245.734	Tata Communications Ltd.	4.259.123	0,15
144/N   372,8356			354.420	0,01	1.079.511	Tata Consultancy Services Ltd.	50.804.692	1,79
1719.00   Winshisot Chemical Group Co., Ltd. "A"   234.88 pt   0.83   278.74 pt   0.83   278.74 pt   0.83   278.74 pt   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.83   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14   0.14	3.190.000		0.700.050	0.40	96.174	Tata Elxsi Ltd.	7.409.706	0,26
1710 0.00   Muxil Biologica Cayman, Inc., 144A***   23.48,8911   0.83   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85   7.85					28.825	Vardhman Textiles Ltd.	781.918	0,03
1917/675   2hejiang NHU Co., Ltd. "A"   4108.333   0.14   1917/31960   2hejiang Semic Gamment Co., Ltd. "A"   4108.333   0.14   1917/39400   2hejiang Semic Gamment Co., Ltd. "A"   250.94.965   0.83   24.28   250.0165   0.83   23.0161   250.0165   0.83   24.28   250.0165   0.83   250.0165   0.83   250.0165   0.83   250.0165   0.83   250.0165   0.83   250.0165   0.83   250.0165   0.83   250.0165   0.83   250.0165   0.83   250.0165   0.83   250.0165   0.83   250.0165   0.83   250.0165   0.83   250.0165   0.83   0.94   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00					4.971.147	Wipro Ltd.	42.245.204	1,48
Mathematical Properties   Mathematical Pro						- ·	070 740 000	
1,371,986   Zhejang Semir Garment Co. Ltd. "A"   2,304,986   0.48   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06   19.739 4/06 4/06   19.739 4/06 4/06 4/06 4/06 4/06 4/06 4/06 4/06							278.749.326	9,80
Real Real Real Results   Real Real Real Real Real Real Real Real					Indonesia			
B.032.082   Zhuzhou Kibing Group Co., Lid. 'A'   20.320.478   34.28   57.200   Charcen Psychand Indonesia This PT   24.299   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0					19.739.400	Bank Pembangunan Daerah Jawa		
Page						Barat Dan Banten Tbk PT	1.874.365	0,07
Page	8.032.062	Zhuzhou Kibing Group Co., Ltd. "A"	20.320.478	0,71	63.786.500			
Pagubilica Check   16.572   Komeroni Banka AS   633.284   0.02   14.2020   0.000   Mitra Keluraga syeaher Tak PT   2.366.713   0.00   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000			975.088.758	34,28			3.317.922	
Telephone   Tele					57.200	Charoen Pokphand Indonesia Tbk PT	24.299	0,00
Part	•						2.365.713	0,08
Services	16.572	Komercni Banka AS	633.284	0,02	79.269.300			
Holding S.A.   Hellenic Felecommunications   Hellenic Felecommun	Grecia					Tbk PT	22.173.548	0,78
Holding S.A.   Hellenic Felecommunications   Hellenic Felecommun	317.868	Eurobank Ergasias Services and					29.755.847	1,05
Page			319.008	0,01				<del></del>
Page	362.310	Hellenic Telecommunications						
Mong Kong		Organization S.A.	6.225.045	0,22				
Hong Kong		_	6 544 053	0.23				
15.922.000   Bosideng International Holdings Ltd.   11.242.198   0.39   3.834.942   Fibra Uno Administracion S.A. de CV   3.553.079   0.12			0.544.055	0,23				
1.040.963   China Merchants Port Holdings Co., Ltd.   1.610.707   0.06   466.000   China Resources Gas Group Ltd.   2.420.750   0.08   66.000   GeV—ADR(**)   26.412.235   0.89   679.246   0.03   68.600   Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB   789.246   0.03   68.600   Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB   789.246   0.03   68.000   Grupo Aeroportuario del Sureste SAB   66.07   679.246   0.03   68.000   Grupo Aeroportuario del Sureste SAB   66.07   679.246   0.03   68.000   Grupo Aeroportuario del Sureste SAB   66.07   679.246   0.03   68.000   Grupo Aeroportuario del Sureste SAB   66.07   679.246   0.03   68.000   Grupo Aeroportuario del Sureste SAB   66.07   679.246   0.05   679.246   0.05   679.246   0.05   679.246   0.05   679.246   0.05   679.246   0.05   679.246   0.05   679.246   0.05   679.246   0.05   679.247   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.	Hong Kong							
A66.000   China Resources Gas Group Ltd.	15.922.000	Bosideng International Holdings Ltd.	11.242.198				3.553.079	0,12
Table	1.040.963	China Merchants Port Holdings Co., Ltd.	1.610.707		356.213		05 440 005	0.00
2.556.000   Kingboard Holdings Ltd.   12.891.061   0.45   12.574   Grupo Aeroportuario del Sureste SAB   0.08   3.0076.000   Sino Ripopharmaceutical Ltd.   2.439.777   0.09   581.969   Megacable Holdings SAB de CV   1.608.030   0.06   0.06   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.0		•	2.420.750		00.000		25.412.235	0,89
12.591.006   Number   Number	7.240.000	Concord New Energy Group Ltd.	745.458		68.600		700 246	0.03
3.330.000 Sino Biopharmaceutical Ltd.	2.556.000	Kingboard Holdings Ltd.	12.891.061	0,45	12 574		709.240	0,03
Sinc Biopharmaceutical Ltd.   2.439.770   0.98   581.969   Megacable Holdings SAB de CV   1.608.030   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.06   0.0	30.076.000	Kunlun Energy Co., Ltd.	28.419.777		12.574		2 268 098	0.08
1,465.000   Xiny Glass Holdings Ltd.   3,596.005   0,13	3.330.000	Sino Biopharmaceutical Ltd.	2.439.770	0,09	581 969			
Hungria   328.779   MOL Hungarian Oil & Gas Pic.   2.470.894   0.09   3.453.400   Metropolitan Bank & Trust Co.   3.419.744   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10   0.10	6.905.000	SITC International Holdings Co., Ltd.	27.831.615	0,98	001.000	- Toldings of the de ov	1.000.000	
No.	1.465.000	Xinyi Glass Holdings Ltd.	3.596.005	0,13			92.417.846	3,25
No.		_	91 197 341	3 21	Filipinas			
No.   Services, Inc.   10.388.208   0.36   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38   0.38			01.107.041	0,21	•	International Container Terminal		
Note	-				2.01020		10.388.208	0,36
No.	328.779	MOL Hungarian Oil & Gas Plc.	2.470.894	0,09	3 453 400	Metropolitan Bank & Trust Co	3 410 744	
390.100   Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.   3.563.739   0.13	India				3.433.400	Metropolitari Barik & Trust Co.	3.419.744	
Zone Ltd.   3.563.739   0,13   Polonia		Adani Ports & Special Economic					13.807.952	0,48
Aditya Birla Fashion and Retail Ltd.	000.100		3.563.739	0,13	Polonia			
95.523   Apollo Hospitals Enterprise Ltd.   7.244.556   0,25   2.688.943   Pollskie Gornictwo Naftowe i Gazownictwo S.A.   3.582.070   0,13	469.404					Aliar Pank S A	422 472	0.01
1.816   Blue Dart Express Ltd.		*					432.472	0,01
1.713   Bosch Ltd.   369.216   0,01					2.000.943		3 582 070	0.13
1.156.696   Chambal Fertilizers and Chemicals Ltd.   5.614.171   0,20   Catar		·				Gazownictwo G.A.	0.302.070	
Ltd.         5.614.171         0,20 catar           6.326         Coforge Ltd.         458.272         0,02 catar           491.088         Cummins India Ltd.         5.751.730 catar         0,20 catar         531.468 catar QSC ca			000.210	0,01			4.014.542	0,14
6.326 Coforge Ltd. 458.272 0,02 245.030 Commercial Bank PSQC 442.437 0,02 491.088 Cummins India Ltd. 5.751.730 0,20 531.468 Industries Qatar QSC 2.119.449 0,07 193.136 Emami Ltd. 1.358.612 0,05 2.761.617 Masraf AI Rayan QSC 3.678.617 0,13 15.414.784 GAIL India Ltd. 26.730.692 0,94 253.725 Gujarat Narmada Valley Fertilizers & Chemicals Ltd. 1.437.317 0,05 Rusia 175.972 Hindustan Zinc Ltd. 783.201 0,03 14.528.750 AIrosa PJSC 25.107.043 0,88 255.690 ICICI Bank Ltd.—ADR(a) 4.832.541 0,17 134.370 Magnit PJSC—GDR(a) 2.125.733 0,07 1.386.850 Indian Oil Corp., Ltd. 7.803.681 0,27 1.386.830 Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC 2.843.020 0,10 1.444A(b) 22.999 0,00 344.335 Novolipetsk Steel PJSC—GDR(a) 10.033.922 0,36 1.444A(b) 22.999 0,00 17.222 PhosAgro PJSC—GDR(a) 384.740 0,01 1.2802.566 Infosys Ltd.—ADR(a) 64.430.854 2,26 1.256.00 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000 1.00	1.100.000		5.614.171	0,20	Catar			
491.088         Cummins India Ltd.         5.751.730         0,20         531.468         Industries Qatar QSC         2.119.449         0,07           193.136         Emami Ltd.         1.358.612         0,05         2.761.617         Masraf Al Rayan QSC         3.678.617         0,13           15.414.784         GAIL India Ltd.         26.730.692         0,94         Emamil Ltd.         6.240.503         0,22           253.725         Gujarat Narmada Valley Fertilizers & Chemicals Ltd.         1.437.317         0,05         Rusia         Rusia           175.972         Hindustan Zinc Ltd.         783.201         0,03         14.528.750         Alrosa PJSC         25.107.043         0,88           255.690         ICICI Bank Ltd.—ADR(a)         4.832.541         0,17         134.370         Magnit PJSC—GDR(a)         2.125.733         0,07           4.916.597         Indian Railway Finance Corp., Ltd.         7.803.681         0,27         1.386.830         Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC         2.843.020         0,10           74.157         Indian Railway Finance Corp., Ltd.         22.999         0,00         17.222         PhosAgro PJSC—GDR(a)         10.033.922         0,36           2.802.560         Infosys Ltd.—ADR(a)         64.430.854         2,26         17.2	6.326	Coforge Ltd.	458.272			Commercial Bank PSOC	442 437	0.02
193.136 Emami Ltd. 1.358.612 0,05 2.761.617 Masraf Al Rayan QSC 3.678.617 0,13  15.414.784 GAIL India Ltd. 26.730.692 0,94  253.725 Gujarat Narmada Valley Fertilizers & Chemicals Ltd. 1.437.317 0,05 Rusia  175.972 Hindustan Zinc Ltd. 783.201 0,03 14.528.750 Alrosa PJSC 25.107.043 0,88  255.690 ICICI Bank Ltd.—ADR(a) 4.832.541 0,17 134.370 Magnit PJSC—GDR(a) 2.125.733 0,07  4.916.597 Indian Oil Corp., Ltd. 7.803.681 0,27 1.386.830 Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC 2.843.020 0,10  74.157 Indian Railway Finance Corp., Ltd. 344.40(b) 22.999 0,00 344.335 Novolipetsk Steel PJSC—GDR(a) 10.033.922 0,36  2.802.560 Infosys Ltd.—ADR(a) 64.430.854 2,26		•						
15.414.784   GAIL India Ltd.   26.730.692   0,94   27.515.017   Masiar Ri Nayaii QSC   3.075.017   0,15								
253.725 Gujarat Narmada Valley Fertilizers & Chemicals Ltd. 1.437.317 0,05 Chemicals Ltd. 1.437.317 0,05 Rusia  175.972 Hindustan Zinc Ltd. 783.201 0,03 14.528.750 Alrosa PJSC 25.107.043 0,88 255.690 ICICI Bank Ltd.—ADR(a) 4.832.541 0,17 134.370 Magnit PJSC—GDR(a) 2.125.733 0,07 1.386.891 Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC 2.843.020 0,10 Indian Railway Finance Corp., Ltd. 144A(b) 22.999 0,00 344.335 Novolipetsk Steel PJSC—GDR(a) 10.033.922 0,36 1.380.250 Infosys Ltd.—ADR(a) 64.430.854 2,26					2.701.017	wasiai Ai Nayaii QoC	3.070.017	
Chemicals Ltd.   1.437.317   0,05   Rusia			2000.002	0,0 .			6.240.503	0,22
175.972 Hindustan Zinc Ltd. 783.201 0,03 14.528.750 Alrosa PJSC 25.107.043 0,88 255.690 ICICI Bank Ltd.—ADR <sup>(a)</sup> 4.832.541 0,17 134.370 Magnit PJSC—GDR <sup>(a)</sup> 2.125.733 0,07 4.916.597 Indian Oil Corp., Ltd. 7.803.681 0,27 1.386.830 Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC 2.843.020 0,10 1.344.00 Alrosa PJSC—GDR <sup>(a)</sup> 1.386.830 Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC 2.843.020 0,10 1.344.400 22.999 0,00 344.335 Novolipetsk Steel PJSC—GDR <sup>(a)</sup> 10.033.922 0,36 1.380.200 Infosys Ltd.—ADR <sup>(a)</sup> 64.430.854 2,26	20020		1.437.317	0,05	Pueia			
255.690 ICICI Bank Ltd.—ADR <sup>(a)</sup> 4.832.541 0,17 134.370 Magnit PJSC—GDR <sup>(a)</sup> 2.125.733 0,07 4.916.597 Indian Oil Corp., Ltd. 7.803.681 0,27 1.386.830 Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC 2.843.020 0,10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 1	175.972					Alrosa PISC	25 107 042	0.00
4.916.597 Indian Oil Corp., Ltd. 7.803.681 0,27 1.386.830 Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC 2.843.020 0,10  74.157 Indian Railway Finance Corp., Ltd. 144A <sup>(b)</sup> 22.999 0,00 17.222 PhosAgro PJSC—GDR <sup>(a)</sup> 10.033.922 0,36  2.802.560 Infosys Ltd.—ADR <sup>(a)</sup> 64.430.854 2,26								
74.157 Indian Railway Finance Corp., Ltd.  144A <sup>(b)</sup> 22.999 0,00 2.802.560 Infosys Ltd.—ADR <sup>(a)</sup> 64.430.854 22.999 1,00 344.335 Novolipetsk Steel PJSC—GDR <sup>(a)</sup> 17.222 PhosAgro PJSC—GDR <sup>(a)</sup> 384.740 0,01						•		
144A <sup>(b)</sup> 22.999 0,00 17.222 PhosAgro PJSC—GDR <sup>(a)</sup> 384.740 0,01 2.802.560 Infosys Ltd.—ADR <sup>(a)</sup> 64.430.854 2,26				-,		•		
2.802.560 Infosys Ltd.—ADR <sup>(a)</sup> 64.430.854 2,26			22.999	0,00		•		
· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	2.802.560	Infosys Ltd.—ADR <sup>(a)</sup>			11.222	FIIOSAGIO FUSC—GDR®	304.740	0,01
	378.071	Mahindra & Mahindra Ltd.	4.216.468	0,15				

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% de patrimonio
Acciones ordina	arias – (continuación)			Acciones ordina	arias – (continuación)		
Rusia - (continua	•			Corea del Sur - (	,		
	Ros Agro Plc.—GDR <sup>(a)</sup>	587.692	0,02	5.758	Shin Heung Energy & Electronics		
	Sberbank of Russia PJSC	48.342.715	1,70	4.005	Co., Ltd.	269.306	0,0
	Severstal PAO—GDR <sup>(a)</sup>	13.079.816	0,46		Shinsegae, Inc.	250.525	0,0
	Severstal PAO—GDR <sup>(a)</sup>	2.765.357	0,10		Shinsung Tongsang Co., Ltd. SK Square Co., Ltd.	725.271 15.001.731	0,03 0,53
177.300	TMK PJSC	182.525	0,01		SK Telecom Co., Ltd.	18.633.756	0,5
		105.452.563	3,71		Suheung Co., Ltd.	2.130.674	0,07
Arabia Saudí					TK Chemical Corp.	2.641.066	0,09
	Al Rajhi Bank	3.247.751	0,11	88.844	Unid Co., Ltd.	7.427.095	0,26
	Alinma Bank	3.005.568	0,11	105.977	Value Added Technology Co., Ltd.	2.933.558	0,10
39.977	Banque Saudi Fransi	428.371	0,02		Woori Financial Group, Inc.	470.402	0,02
57.054	Mouwasat Medical Services Co.	2.597.511	0,09	15.069	Youngone Corp.	492.724	0,02
209.854	Riyad Bank	1.566.242	0,06			419.646.469	14,7
	SABIC Agri-Nutrients Co.	2.022.756	0,07	Tabuén			
	Saudi Arabian Mining Co.	3.702.845	0,13	Taiwán 2 034 000	Ardentec Corp.	4.087.212	0,14
	Saudi Basic Industries Corp.	7.483.695	0,26		Asia Polymer Corp.	1.205.980	0,12
537.361	Saudi Industrial Investment Group	4.332.863	0,15		Brighton-Best International Taiwan, Inc.	3.487.789	
		28.387.602	1,00		Capital Securities Corp.	800.383	
Sudáfrica					Cathay Financial Holding Co., Ltd.	7.548.207	0,27
	Absa Group Ltd.	7.567.469	0,27		Chailease Holding Co., Ltd.	12.896.221	0,45
	Anglo American Platinum Ltd.	4.597.774	0,16		China Motor Corp.	1.340.132	0,05
	Barloworld Ltd.	2.362.583	0,08	2.023.000	Elite Semiconductor Microelectronics	44 744 555	0.4
789.027	Coronation Fund Managers Ltd.	2.712.303	0,10	4 000	Technology, Inc. eMemory Technology, Inc.	11.741.555 310.409	0,41 0,01
3.412.311	FirstRand Ltd.	11.984.545	0,42		Evergreen Marine Corp. Taiwan Ltd.	8.817.291	0,0
21.812	Kumba Iron Ore Ltd.	621.432	0,02		Faraday Technology Corp.	9.060.228	0,32
613.358	Momentum Metropolitan Holdings	694.607	0,02		FocalTech Systems Co., Ltd.	7.175.871	0,25
	Motus Holdings Ltd.	401.106	0,01	4.650.300	Fubon Financial Holding Co., Ltd.	12.225.124	0,43
	Northam Platinum HoldingsLtd.	2.425.219	0,09	166.000	Global Mixed Mode Technology, Inc.	1.578.266	0,06
	PSG Group Ltd.	256.463	0,01		Greatek Electronics, Inc.	5.027.714	0,18
	SPAR Group Ltd.	161.633	0,01		Himax Technologies, Inc.—ADR <sup>(a)</sup>	9.066.440	
2.143.407	Standard Bank Group Ltd.	17.423.434	0,61		Holtek Semiconductor, Inc.	899.575	
		51.208.568	1,80		International Games System Co., Ltd. Lite-On Technology Corp.	3.314.771 4.105.549	0,12 0,14
Corea del Sur					Nan Ya Plastics Corp.	5.820.895	
	BGF retail Co., Ltd.	294.945	0,01		Nantex Industry Co., Ltd.	5.841.781	0,21
	BNK Financial Group, Inc.	578.851	0,02		Novatek Microelectronics Corp.	34.332.234	1,21
94.908	Dentium Co., Ltd.	4.293.466	0,15	1.604.360	President Securities Corp.	1.360.771	0,05
	Devsisters Co., Ltd.	805.037	0,03		Realtek Semiconductor Corp.	9.404.250	0,33
	DGB Financial Group, Inc.	6.510.875	0,23		Sesoda Corp.	651.558	0,02
	DI Dong II Corp.	551.443	0,02		Sigurd Microelectronics Corp.	751.830	
	DIO Corp. Hana Financial Group, Inc.	998.366 32.849.997	0,03 1,15		Sitronix Technology Corp. Taiwan Fertilizer Co., Ltd.	9.248.733 1.281.000	0,33 0,04
	Handsome Co., Ltd.	654.442	0,02		Taiwan Mobile Co., Ltd.	1.060.855	
	Hyosung TNC Co., Ltd.	12.801.555	0,45		Taiwan Semiconductor Manufacturing	1.000.000	0,0
	Hyundai Engineering & Construction				Co., Ltd.	113.454.186	3,99
	Co., Ltd.	1.765.578	0,06		Unimicron Technology Corp.	5.433.711	0,19
	Hyundai Motor Co.	7.835.515	0,28		United Microelectronics Corp.	32.530.516	
	JB Financial Group Co., Ltd.	2.368.778	0,08		Wan Hai Lines Ltd.	33.141.500	
	KB Financial Group, Inc. KCC Corp.	35.324.590	1,24	3.487.000	Yuanta Financial Holding Co., Ltd.	2.971.387	0,10
	Kia Motors Corp.	315.742 47.676.328	0,01 1,68			361.973.924	12,73
	Korea Investment Holdings Co., Ltd.	1.342.699	0,05	Toilondia			-
	Kumho Petrochemical Co., Ltd.	9.639.402	0,34	Tailandia 247 800	Advanced Info Service PCL	1.517.362	0,05
	LF Corp.	557.846	0,02		Bangkok Chain Hospital PCL	4.434.892	
	LG Corp.	2.543.181	0,09		Chularat Hospital PCL "F"	6.737.020	
	LOTTE Fine Chemical Co., Ltd.	201.256	0,01		Indorama Ventures PCL	11.679.687	0,41
	Meritz Financial Group, Inc.	1.371.885	0,05		Kiatnakin Phatra Bank PCL	350.551	0,01
	Mirae Asset Daewoo Co., Ltd.	11.651.518	0,41		Precious Shipping PCL	5.248.336	
	MK Electron Co., Ltd.	452.761	0,02		PTT Exploration & Production PCL	1.554.154	0,06
	NAVER Corp.	6.049.396	0,21		PTT Global Chemical PCL	24.068.544	
	NH Investment & Securities Co., Ltd. NHN Corp.	5.936.956 734.071	0,21 0,03		Regional Container Lines PCL	7.486.163	
	Samsung C&T Corp.	3.328.989	0,03		Siam Commercial Bank PCL Supalai Plc.	6.643.565 314.126	
	Samsung Electronics Co., Ltd.	147.999.561	5,20		Vibhavadi Medical Center PCL	334.535	
	Samsung Electronics Co.,		-,	5.17 1.100			
	Ltd.—Preferente	14.779.346	0,52			70.368.935	2,47
	Samsung SDI Co., Ltd.—Preferente	4.415.675	0,15				

Tenencias	Descrip del valo			m	Valor de nercado en USD	% del patrimonio
Acciones ordin	arias – (	continuació	n)			
Turquía						
		krilik Kimya Sa	nayii AS		2.388.310	0,08
		ola Icecek AS			2.778.408	0,10
		omotiv Sanayi			5.428.676	0,19
154.470	Mavı Gı B"144	yim Sanayi ve	Ticaret AS		864.601	0,03
13.690.543		lekomunikasyo	on AS		10.175.386	0,36
			Makineleri AS		98.393	0,00
		I Iletisim Hizme			224.698	0,01
3.264.697	Turkiye	Garanti Banka	asi AS		2.852.460	0,10
11.498.952	Yapi ve	Kredi Bankasi	iAS		2.799.112	0,10
	·		-	2	27.610.044	0,97
Emiratos Árabes	Unidos					
		abi Islamic Ba	nk PJSC		464.681	0,02
		s NBD Bank F			79.114	0,00
			-		543.795	0,02
Catadaa Unidaa					0.000	
Estados Unidos 412.000	Nextee	Automotive G	Group Ltd.		538.128	0,02
TOTAL DE ACCIO (coste USD 2.902				2.77	71.306.264	97,43
Fondos de inve	rsión –	0,88 %				
Irlanda						
24.897.197	Reserve		Treasury Liquid e de acciones de	2	24.897.197	0,88
TOTAL DE FOND		NVERSIÓN			24 007 407	0.00
(coste USD 24.89					24.897.197	0,88
TOTAL DE VALO COTIZACIÓN EN (coste USD 2.92)	UNA BO	LSA DE VAL		2.79	96.203.461	98,31
VALOR DE MER			SIONES			
EXCLUYENDO D (coste USD 2.92)	ERIVAD	os	SIONES	2.79	96.203.461	98,31
Contratos de fu	-	-				
Número de			Valor o mercac de asignació	lo Ia M	linusvalía latente	% del
	cripción d	el valor	us		USD	patrimonio
751 Futu	ros sobre	e el MSCI rkets Index				
	2/2021		Larga 45.690.84	10 (2.	234.800)	(0,08)
MINUSVALÍA LA DE FUTUROS	TENTE S	OBRE CONTI	RATOS	(2.	234.800)	(0,08)
Contratos de d	ivisas a	plazo espec	íficos de una cla	ase d	e acciones	- 0,00 %
Divisa Compra	n Divisa	Venta	Fecha de vencim	ionto	Plusvalía latente en	% del patrimonio
CHF 282.824		305.647	23/12/		3.401	0,00
EUR 890.937 PLN 416.162		1.008.957 100.201	23/12/ 23/12/		5.677 1.021	0,00
PLUSVALÍA LAT	ENTE SC	BRE CONTR	ATOS DE DIVISA		1.021	
PLAZO CELEBR	ADOS C	ON FINES DE	COBERTURA		10.099	0,00
Divisa Compra	a Divisa	Venta	Fecha de vencim	iento	Minusvalía latente USD	% del patrimonio

USD

7.025 CHF

6.532

23/12/2021

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones – (continuación)

					Minusvalía	
Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha d vencimient		% del patrimonio
USD	29.822	EUR	26.464	23/12/202	1 (317)	(0,00)
USD	4.037	PLN	16.808	23/12/202	1 (51)	(0,00)
	PLAZO CE		CONTRATO		(480)	(0,00)
VALOR DE INVERSION (coste USD	IES		2	2.793.978.280	98,23	
OTROS AC	TIVOS Y PA	ASIVOS		50.323.642	1,77	
PATRIMON	10			- 2	2.844.301.922	100,00
TOTAL DE	INVERSION	NES			Valor de mercado en USD	% del patrimonio de los Accionistas
Total inversi (coste USI	ones excluy D 2.927.711		vados		2.796.203.461	98,31
Minusvalía I	atente sobr	e contrato:	s de futuros		(2.234.800)	(0,08)
celebrados	s con fines	de cobertu			10.099	0,00
	atente sobr		s de divisas : ra	a plazo	(480)	(0,00)
Otros activo			ıu		50.323.642	1,77
Patrimonio					2.844.301.922	100,00

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Deutsche Bank AG, JP Morgan Chase Bank N.A., State Street Bank & Trust y UBS AG.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,00 %.

- Una parte de estos valores estaba cedida en préstamo a 30 de noviembre de 2021. Consulte la Nota 6
- (a) Los valores se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional)).
- (b) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (c) La valoración de este título la realiza el Tasador. Consulte la Nota 4.
- (d) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- $^{\rm (e)}\,$  EI rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

(0,00)

(112)

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio de los Accionistas
Acciones ordinarias	
Semiconductores	14,49
Bancos	13,69
Internet	8,18
Ordenadores	6,47
Fabricantes de automóviles	5,74
Servicios financieros diversos	5,72
Productos químicos	5,21
Petróleo y gas	4,74
Telecomunicaciones	3,83
Venta al por menor	3,48
Otros	25,88
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	97,43
Fondos de inversión	0,88
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(0,08)
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	0,00
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	(0,00)
Otros activos y pasivos	1,77
TOTAL	100,00

Valores mobilitations admittidous a cottraction on unis bords de valores official Acciones ordinarias - 97,43 (Water Chamber 1978) Acciones ordinarias - 97,43 (Water Chamber 1978) Acciones ordinarias - 197,43 (Water Chamber 1978) Acciones ordinar	Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en EUR	% del	Tenenci	as	Descripción del valor	Valor de mercado en EUR	% de
Acciones ordinarias = 97,43 %   Acciones								EUR	patrimon
Austria  Aus	Acciones ordina		a bolsa de valor	es oficial		nia – (cont	tinuación)		
Austria 67/14 BAWAG Group AG 144A/aii 9, 406.302 0.10 15.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07 14.07		PHD Croup Plo	26 022 716	1.40		01.121		2.941.332	0,1
6.0746 BAWAG Group AG 144APi  7. 49.030 Eresis Group Barik Al Charles  8. 1989 10 Ralfeisen Barik International AG  8. 889.0944 0.51  8. 889.094 0.51  8. 133.082 Dieterran S.A.NV  8. 1979 0.04  8. 133.082 Dieterran S.A.NV  8. 1979 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8. 1970 0.04  8.		вне віоир гіс.	20.033.7 10	1,49		2.091.316	E.ON S.E.	22.920.823	1,3
*** 49.400 Erete Gritup Bank AG						15.432	Gerresheimer AG	1.250.764	0,0
138.810   Rainfeisen Bank International Age   8.89   994   0.51   42.2021   Heriela AG & Co. KGAA - Preferente   2.955.000   2.924   4.88   6839.733   Infrareo Technologies AG   2.955.065   630.733   Infrareo Technologies AG   2.955.065   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   630.735   6					+	5.702	Hapag-Lloyd AG 144A <sup>(a)</sup>	1.277.248	0,0
Seligica						55.449	HelloFresh S.E.	5.123.488	0,2
Selegical   Sele	130.010	Raineisen Bank international AG	3.597.955	0,21					0,1
1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.986     1.98			8.889.994	0,51			o .		0,1
17.070   Muerchener Ruceversicherungs    17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.070   17.	Bélgica						· ·		1,4
Command   Comm	13.052	D'ieteren S.A./NV	2.122.255	0,12				33.134.838	1,9
Dinamarca   3.543   AP Moller - Maerisk Als 'A'   9.018.965   0.52   3.543   AP Moller - Maerisk Als 'A'   9.018.965   0.52   3.563   58 Siemens Healthineans AG 144A(**)   2.33.53.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769   3.355.769	6.386	Melexis NV	667.976	0,04		17.670		4 218 712	0,2
184,848 SAP S.E.   21,294,489   33,578   33,578   33,578   36,655   32,578   33,789   36,655   32,578   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   33,789   36,655   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,899   34,89			2 700 231	0.16		44.711			0,2
3.543 AP Moller - Maersk AS "P"   9.018.385   0.52   336.055 Stelletter Presidentine Les AS INVA-Y   2.3.53.761   19.408   336.50   19.408   1.44   19.470   19.408   337.671   19.408   19.408   1.68   19.470   19.408   19.470   19.470   19.408   1.68   19.470   19.470   19.470   19.408   1.68   19.470   19.470   19.408   1.68   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470   19.470			2.790.231	0,10					1,2
7.395 AP Moller - Maersk AS: "B" 19.946 888 1.14 19.479 Violence Chemie AS 2.75016 22.75016 335.599 Novo Nortida AS: "B" 29.028.889 1.66 70.104 Pandera AIS 77.33.471 0.44 67.283.702 3.85 77.014 Pandera AIS 759.076 Kesko OY.J "B" 21.066.535 1.21 661.645 Nokia OY.J "B" 21.066.535 1.21 661.645 Nokia OY.J "B" 22.002.882.71 0.19 57.6451 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 0.45 10.2002 Novebee Bank Alp (negociado en Finindrola) 7.926.094 10.2002 Novebee Bank Alp						356.655	Siemens Healthineers AG 144A(a)	23.353.769	1,3
37.671   DFDS A/S   1.556 .089   0.09   37.670   No.0 Nordiscl. A/S 'B'   20.028 .889   1.68   315.595.628   315.595.628   30.030   30.030   Novo Nordiscl. A/S 'B'   20.028 .889   1.68   37.620   No.0 Nordiscl. A/S 'B'   20.028 .889   1.68   37.620   No.0 Nordiscl. A/S 'B'   21.066.535   1.21   Strael   1.20   Nordiscl. Bank Abp (negociado en Finlandia)   7.926.094   Nordiscl. Bank Abp (negociado en Sucicia)   1.6978.820   0.57   1.60   Nordiscl. Bank Abp (negociado en Sucicia)   1.6978.820   0.57   1.60   1.6978.820   0.37   2.73.751   Banca Farmafactoring SpA   1.41   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50   1.50						137.795	Volkswagen AG—Preferente	22.468.853	1,2
305.509   Novo Nordisk AVS 'B'   200.28 889   1,66						19.470	Wacker Chemie AG	2.975.016	0,1
Finlandia				-				315 595 828	18,0
Finlandia								0.0000.020	
Finlandia	70.104	Tandora Avo		-	Irlanda		DCC Pla	2 444 607	0.1
Finlandia			67.283.702	3,85					0,1 0,0
September   Sept	Finlandia					14.002	Experium no.		
T86.451   Nordea Bank Abp (negociato en Finlandia)   7.926.094   0.45   267.424   Plus500 Ltd.   4.053.513	759.976	Kesko OYJ "B"	21.066.535					3.032.902	0,1
Finlandia    1622067 Nordea Bank Abp (negociado en Suecia)			3.286.721	0,19	Israel				
Tellisticities	756.451		7 000 004	0.45		267.424	Plus500 Ltd.	4.053.513	0,2
Suecial   16.978.820   0.97   734.297   Azimut Holding SpA   17.882.934   149.030   Sampo CV1 \(^{\alpha}\)   6.393.337   0.37   273.751   Banca Farnalactoring SpA 144A\(^{\alpha}\)   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075   1.819.075	1 622 067	/	7.926.094	0,45	14-11-				
149,030   Sampo OYJ 'A'   5.393.387   0.37   198.345   TieletEVRY OYJ   5.121.288   0.29   113.954   Banca General SpA   4.125.135   33.396   Tokmanni Group Corp.   622.835   0.04   13.956.60   3.52   13.954   Banca General SpA   4.125.135   33.396   Tokmanni Group Corp.   622.835   0.04   13.956.60   3.52   2.990.733   Banca Berloila SpA   7.793.092   17.395   Banca Farmafactoring SpA 1.427.4753   4.125.135   33.396   Tokmanni Group Corp.   622.835   0.04   13.912   Ferrar IV   3.262.394   7.393.092   3.1912   Ferrar IV   3.262.394   3.1912   Ferrar IV	1.022.007		16.978.820	0.97	Italia	724 207	Asimus Lladina CaA	17 002 024	4.0
188.345 TelcEVRY OVJ 5.121.268 0.29 13.994 Banca Generali SpA 4.125.135 13.396 Tokmanni Group Corp. 62.2835 0.04 135.770 Banca Mediolanum SpA 1.274.763 15.77 14.125 15.285 0.04 155.770 Banca Mediolanum SpA 1.274.763 15.77 14.125 15.285 0.04 155.770 Banca Mediolanum SpA 1.274.763 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15.275 0.04 15	149.030	,							1,0 0,1
33.396   Tokmanni Group Corp.   622.835   0.04   153.770   Banca Mediolanum SpA   1.274.753   2.990.733   Banco BPM SpA   7.393.092   3.902   3.912   Ferrari NV   3.262.394   3.912   3.912   Ferrari NV   3.262.394   5.912   Ferrari NV   3.262.394   5.912   Ferrari NV   3.262.395   5.912   Ferrari NV   3.262.395   Ferrari N			5.121.268				• .		0,1
Francia  Fra	33.396	Tokmanni Group Corp.	622.835	0,04			·		0,0
Trancia   13   12   Ferral NV   3   262.364   13   13   12   13   12   13   12   13   13		топпани отобр остр.	61 395 660	3 52			•		0,4
59.261   Air Liquide S.A.   8.685.292   0.50   150.94   Multice SJA   2.676.094			01.393.000	3,32			•		0,1
8.681 Arkema S.A.       1.010.902 0.06       + 49.291       Salvatore Ferragamo SpA       992.721         182.938 AXA S.A.       4.436.247 0.25       - 49.291       Salvatore Ferragamo SpA       992.721         397.203 Compagnie de Saint-Gobain       22.513.466       1.29       Luxemburgo         496.566 Dassault Systemes S.E.       26.869.186       1.69         487.535 Electricite de France S.A.       11.107.501       0,64         1.826.111 Engle S.A.       23.312.133       1.34         4.882 Hermes International       8.162.302       0.47         34.616 Ipsen S.A.       3.005.361       0,17         40.883 Kering S.A.       27.802.881       1,59       50.118 BE Semiconductor Industries NV       4.231.964         234.156 Legrand S.A.       22.395.766       1,31       23.649 Flow Traders 1444/60       736.430         55.864 L'Oreal S.A.       22.436.600       1,28       857.154 Koninklijke Ahold Delhaize NV       25.491.760         12.649 LWMH Moët Hennessy Louis Vuitton S.E.       8.715.161       0,50       1.469 QIAGEN NV       72.099         122.054 Permod Ricard S.A.       24.703.730       1,41       97.548 Randstad NV       5.443.011         37.920 Publicie Groupe S.A.       21.487.650       1,23       920.316 Royal Dutch Shell Pic. "A"       16.96						150.545	Moncler SpA	9.758.327	0,5
182.938   AXA S.A.		-				15.668	Reply SpA	2.676.094	0,1
23.176   Capgemini S.E.   4.746.445   0,27   397.203   Compagnie de Saint-Gobain   22.513.466   1,29   Luxemburgo   Luxemburgo   Luxemburgo   194.197   Eurofins Scientific S.E.   22.367.610   194.197   Eurofins Scientific S.E.   24.367.631   1,59   50.118   Els Eericonductor Industries NV   27.867.559   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197   194.197					+	49.291	Salvatore Ferragamo SpA	992.721	0,0
Suppose								49.284.495	2,8
A96.566   Dassault Systemes S.E.   26.869.186   1,54   194.197   Eurofins Scientific S.E.   22.367.610		. •							
R87.535   Electricite de France S.A.		. •			Luxem	-			
4.892   Hermes International   8.162.302   0,47   68.707   ASM International NV   27.867.559     34.616   Ipsen S.A.   3.005.361   0,17   80.572   ASML Holding NV   57.947.383     40.883   Kering S.A.   27.820.881   1,59   50.118   BE Semiconductor Industries NV   4.231.964     234.156   Legrand S.A.   22.839.576   1,31   23.649   Flow Traders 144A(a)   736.430     55.864   L'Oreal S.A.   22.345.600   1,28   857.154   Koninklijke Ahold Delhaize NV   25.491.760     12.649   LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton   8.E.   8.715.161   0,50   1.469   QIAGEN NV   72.099     122.054   Pernod Ricard S.A.   24.703.730   1,41   97.545   Randstad NV   5.443.011     372.920   Publicis Groupe S.A.   21.487.650   1,23   920.315   Royal Dutch Shell Plc. "A"   16.966.927     70.231   Renault S.A.   2.008.958   0,12   220.384   Royal Dutch Shell Plc. "A"   16.966.927     70.231   Renault S.A.   7.395.076   0,42   179.264   Signify NV 144A(a)   7.310.386     33.454   Sartorius Stedim Biotech   17.917.962   1,03   1.713.052   Stellantis NV   26.199.417     224.133   Schneider Electric S.E.   34.996.127   2,00   97.008   Wolters Kluwer NV   9.715.351     2299.868   Société Genérale S.A.   8.267.361   0,47   0,47     10.191   Trigano S.A.   1.601.006   0,09   313.947.923   17.98   385.235   Aker BP ASA   10.609.003     335.844   Covestro AG 144A(a)   16.761.974   0,96   65.452   Daimler AG   5.429.942   0,31   65.5897   Deutsche Post AG   3.3734.336   1,93   0.114   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.154   0.1		*	11.107.501			194.197	Eurofins Scientific S.E.	22.367.610	1,2
34.616   Ipsen S.A.   3.005.361   0,17   80.572   ASML Holding NV   57.947.383   40.883   Kering S.A.   27.820.881   1,59   50.118   BE Semiconductor Industries NV   4.231.964   234.156   Legrand S.A.   22.839.576   1,31   23.649   Flow Traders 144A(a)   736.430   736.430   736.430   736.840   736.430   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840   736.840	1.826.111	Engie S.A.	23.312.133	1,34	Países	Bajos			
40.843   Kering S.A.   27.820.881   1,59   50.118   BE Semiconductor Industries NV   4.231.964   234.156   Legrand S.A.   22.839.576   1,31   23.649   Flow Traders 144A(a)   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430   736.430	4.892	Hermes International	8.162.302	0,47		68.707	ASM International NV	27.867.559	1,6
234.156   Legrand S.A.   22.839.576   1,31   23.649   Flow Traders 144A <sup>(a)</sup>   736.430     55.864   L'Oreal S.A.   22.345.600   1,28   857.154   Koninklijke Ahold Delhaize NV   25.491.760     12.649   LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton S.E.   8.715.161   0,50   1.469   QIAGEN NV   72.099     122.054   Pernod Ricard S.A.   24.703.730   1,41   97.545   Randstad NV   5.443.011     372.920   Publicis Groupe S.A.   21.487.650   1,23   920.315   Royal Dutch Shell Plc. "A"   16.966.927     70.231   Renault S.A.   2.008.958   0,12   220.384   Royal Dutch Shell Plc. —ADR "B*(b)   8.134.748     454.243   Rexel S.A.   7.395.076   0,42   179.264   Signify NV 144A(a)   7.310.386     33.454   Sartorius Stedim Biotech   17.917.962   1,03   1.713.052   Stellantis NV   26.199.417     224.133   Schneider Electric S.E.   34.996.127   2,00   97.008   Wolters Kluwer NV   9.715.351     299.868   Société Générale S.A.   8.267.361   0,47     10.191   Trigano S.A.   1.601.006   0,09     313.947.923   17,98   Noruega   385.235   Aker BP ASA   10.609.003     467.480   BASF S.E.   27.071.767   1,55   135.117   Nordic Semiconductor ASA   4.063.560     299.25,860   Norsk Hydro ASA   16.893.830     292.580   Norsk Hydro ASA   16.893.830     292.580   Norsk Hydro ASA   3.214.197     65.492   Daimler AG   5.429.942   0,31     33.844   Covestro AG 144A(a)   16.761.974   0,96     65.492   Daimler AG   5.429.942   0,31     36.897   Deutsche Boerse AG   1.917.829   0,11     635.897   Deutsche Boerse AG   1.917.829   0,11     635.897   Deutsche Post AG   3.3734.336   1,93		•	3.005.361	0,17			•		3,3
S5.864   L'Oreal S.A.   22.345.600   1,28   857.154   Koninklijke Ahold Delhaize NV   25.491.760     12.649   LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton S.E.   8.715.161   0,50   1,469   QIAGEN NV   72.099     122.054   Pernod Ricard S.A.   24.703.730   1,41   97.545   Randstad NV   5.443.011     372.920   Publicis Groupe S.A.   21.487.650   1,23   920.315   Royal Dutch Shell Plc. "A"   16.966.927     70.231   Renault S.A.   2.008.958   0,12   220.384   Royal Dutch Shell Plc. "A"   16.966.927     70.231   Renault S.A.   2.008.958   0,12   220.384   Royal Dutch Shell Plc. "ADR "B" (b) 8.134.748     454.243   Rexel S.A.   7.395.076   0,42   179.264   Signify NV 144A(a)   7.310.386     33.454   Sartorius Stedim Biotech   17.917.962   1,03   1.713.052   Stellantis NV   26.199.417     224.133   Schneider Electric S.E.   34.996.127   2,00   97.008   Wolters Kluwer NV   9.715.351     299.868   Société Générale S.A.   8.267.361   0,47     10.191   Trigano S.A.   1.601.006   0,09     Alemania   467.480   BASF S.E.   27.071.767   1,55   385.235   Aker BP ASA   10.609.003     292.868   Société Genérale S.E.   17.959.012   1,03   2.925.860   Norsk Hydro ASA   4.063.560     293.312   Brenntag S.E.   17.959.012   1,03   74.256   Yara International ASA   3.214.197     65.492   Daimler AG   5.429.942   0,31   2.90.079   Deutsche Bank AG   3.082.990   0,18   13.689   Deutsche Boerse AG   1.917.829   0,11     635.897   Deutsche Post AG   3.373.4336   1,93   1.93   1.94		•							0,2
12.649   LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton S.E.   8.715.161   0,50   1.469   QIAGEN NV   72.099     122.054   Pernod Ricard S.A.   24.703.730   1,41   97.545   Randstad NV   5.443.011     372.920   Publicis Groupe S.A.   21.487.650   1,23   920.315   Royal Dutch Shell Plc. "A"   16.966.927     70.231   Renault S.A.   2.008.958   0,12   220.334   Royal Dutch Shell Plc. "A"   16.966.927     70.231   Renault S.A.   7.395.076   0,42   179.264   Signify NV 144A(a)   7.310.386     33.454   Sartorius Stedim Biotech   17.917.962   1,03   1.713.052   Stellantis NV   26.199.417     224.133   Schneider Electric S.E.   34.996.127   2,00   97.008   Wolters Kluwer NV   9.715.351     299.868   Société Générale S.A.   8.267.361   0,47     10.191   Trigano S.A.   1.601.006   0,09     Alemania   467.480   BASF S.E.   27.071.767   1,55   135.117   Nordic Semiconductor ASA   4.063.560     267.366   Bayerische Motoren Werke AG   22.710.068   1,30     235.312   Brenntag S.E.   17.959.012   1,03   74.256   Yara International ASA   3.214.197     65.492   Daimler AG   5.429.942   0,31     335.844   Covestro AG 144A(a)   16.761.974   0,96     65.492   Daimler AG   5.429.942   0,31     33.884   Covestro AG 144A(a)   16.761.974   0,96     65.897   Deutsche Bank AG   3.082.960   0,18     13.889   Deutsche Boerse AG   1.917.829   0,11     65.897   Deutsche Boerse AG   3.734.336   1,93		=							0,0
S.E.   8.715.161   0,50   1.469   QIAGEN NV   72.099     122.054   Pernod Ricard S.A.   24.703.730   1,41   97.545   Randstad NV   5.443.011     372.920   Publicis Groupe S.A.   21.487.650   1,23   920.315   Royal Dutch Shell Pic. "A"   16.966.927     70.231   Renault S.A.   2.008.958   0,12   220.384   Royal Dutch Shell Pic. "A"   16.966.927     70.231   Renault S.A.   7.395.076   0,42   179.264   Signify NV 144A(a)   7.310.386     33.454   Sartorius Stedim Biotech   17.917.962   1,03   1.713.052   Stellantis NV   26.199.417     224.133   Schneider Electric S.E.   34.996.127   2,00   97.008   Wolters Kluwer NV   9.715.351     299.868   Société Générale S.A.   8.267.361   0,47     10.191   Trigano S.A.   1.601.006   0,09     Alemania   467.480   BASF S.E.   27.071.767   1,55   387.689   Golden Ocean Group Ltd.   7.351.077     467.480   BASF S.E.   27.071.767   1,55   135.117   Nordic Semiconductor ASA   4.063.560     235.312   Brenntag S.E.   17.959.012   1,03   74.256   Yara International ASA   3.214.197     65.492   Daimler AG   5.429.942   0,31   42.131.667     13.689   Deutsche Boerse AG   1.917.829   0,11   635.897   Deutsche Post AG   33.734.336   1,93   1,93   1,93   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74   1,74			22.345.600	1,28					1,4
122.054   Pernod Ricard S.A.   24.703.730   1,41   97.545   Randstad NV   5.443.011   372.920   Publicis Groupe S.A.   21.487.650   1,23   920.315   Royal Dutch Shell Plc. "A"   16.966.927   16.966.927   17.0231   Renault S.A.   2.008.958   0,12   220.384   Royal Dutch Shell Plc.—ADR "B"   8.134.748   16.966.927   17.962   13.34.54   Sartorius Stedim Biotech   17.917.962   1,03   1.713.052   Stellantis NV   26.199.417   224.133   Schneider Electric S.E.   34.996.127   2,00   97.008   Wolters Kluwer NV   9.715.351   299.868   Société Générale S.A.   8.267.361   0,47   10.191   Trigano S.A.   1.601.006   0,09   313.947.923   17.98   385.235   Aker BP ASA   10.609.003   887.689   Golden Ocean Group Ltd.   7.361.077   1.55   135.117   Nordic Semiconductor ASA   4.063.560   2.925.860   Norsk Hydro ASA   16.893.830   2.925.860   Norsk Hydro ASA   3.214.197   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.667   42.131.66	12.649		8 715 161	0.50					0,2 0,0
372.920   Publicis Groupe S.A.   21.487.650   1,23   920.315   Royal Dutch Shell Plc. "A"   16.966.927	122.054								0,0
70.231 Renault S.A. 2.008.958 0,12 220.384 Royal Dutch Shell Plc.—ADR "B"(b) 8.134.748 454.243 Rexel S.A. 7.395.076 0,42 179.264 Signify NV 144A(a) 7.310.386 33.454 Sartorius Stedim Biotech 17.917.962 1,03 1.713.052 Stellantis NV 26.199.417 224.133 Schneider Electric S.E. 34.996.127 2,00 97.008 Wolters Kluwer NV 9.715.351 299.868 Société Générale S.A. 8.267.361 0,47 10.191 Trigano S.A. 8.267.361 0,47 1601.006 0,09 313.947.923 17.98									0,3
A54.243   Rexel S.A.   7.395.076   0,42   179.264   Signify NV 144A(a)   7.310.386		•					•		0,3
33.454   Sartorius Stedim Biotech   17.917.962   1,03   1.713.052   Stellantis NV   26.199.417									0,4
299.868 Société Générale S.A.  10.191 Trigano S.A.  1.601.006  1.601.006  1.601.006  1.601.006  1.601.006  1.601.006  1.601.006  1.601.006  1.601.006  1.601.006  1.601.006  1.601.006  1.601.006  1.601.006  1.601.006  1.601.006  1.609.003  1.601.007  1.601.007  1.601.007  1.601.007  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.601.008  1.600.003  1.600.003  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.600.008  1.6			17.917.962	1,03		1.713.052	Stellantis NV		1,5
10.191   Trigano S.A.   1.601.006   0,09   313.947.923   17,98   Noruega   385.235 Aker BP ASA   10.609.003   887.689   Golden Ocean Group Ltd.   7.351.077   1,55   135.117 Nordic Semiconductor ASA   4.063.560   267.366   Bayerische Motoren Werke AG   22.710.068   1,30   2.925.860 Norsk Hydro ASA   16.893.830   2.925.860 Norsk Hydro ASA   16.893.830   2.925.860 Norsk Hydro ASA   16.893.830   2.925.860 Norsk Hydro ASA   3.214.197   2.90.079   Deutsche Bank AG   3.082.960   0,18   42.131.667   2.90.079   Deutsche Borse AG   1.917.829   0,11   635.897   Deutsche Post AG   33.734.336   1,93   3.214.197   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.225   3.22						97.008	Wolters Kluwer NV	9.715.351	0,5
1.601.006   0,09   Noruega   313.947.923   17,98   385.235 Aker BP ASA   10.609.003   887.689 Golden Ocean Group Ltd.   7.351.077   1,55   135.117 Nordic Semiconductor ASA   4.063.560   267.366   Bayerische Motoren Werke AG   22.710.068   1,30   2.925.860 Norsk Hydro ASA   16.893.830   2.925.860 Norsk Hydro ASA   16.893.830   2.925.860 Norsk Hydro ASA   3.214.197   335.444   Covestro AG 144A(a)   16.761.974   0,96   65.492   Daimler AG   5.429.942   0,31   290.079   Deutsche Bank AG   3.082.960   0,18   13.689   Deutsche Boerse AG   1.917.829   0,11   635.897   Deutsche Post AG   33.734.336   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,93   1,								194.529 303	11,1
313,947,923   17,98   385,235 Aker BP ASA   10,609,003   17,351,077   1,675   135,117 Nordic Semiconductor ASA   4,063,560   2,925,860 Norsk Hydro ASA   16,893,830   2,925,860 Norsk Hydro ASA   2,925,860 Norsk Hydro ASA   3,214,197   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709   2,90,709	10.191	Trigano S.A.	1.601.006	0,09				104.020.000	11,1
Alemania         887.689 Golden Ocean Group Ltd.         7.351.077           467.480 BASF S.E.         27.071.767         1,55         135.117 Nordic Semiconductor ASA         4.063.560           267.366 Bayerische Motoren Werke AG         22.710.068         1,30         2.925.860 Norsk Hydro ASA         16.893.830           235.312 Brenntag S.E.         17.959.012         1,03         74.256 Yara International ASA         3.214.197           335.844 Covestro AG 144A <sup>(a)</sup> 16.761.974         0,96         42.131.667           290.079 Deutsche Bank AG         3.082.960         0,18         42.131.667           13.689 Deutsche Boerse AG         1,917.829         0,11           635.897 Deutsche Post AG         33.734.336         1,93			313.947.923	17,98	Norueg		Akor DD ACA	10 600 000	
467.480     BASF S.E.     27.071.767     1,55     135.117 Nordic Semiconductor ASA     4.063.560       267.366     Bayerische Motoren Werke AG     22.710.068     1,30     2.925.860 Norsk Hydro ASA     16.893.830       235.312     Brenntag S.E.     17.959.012     1,03     74.256 Yara International ASA     3.214.197       335.844     Covestro AG 144A(a)     16.761.974     0,96     42.131.667       65.492     Daimler AG     5.429.942     0,31     42.131.667       290.079     Deutsche Bank AG     3.082.960     0,18       13.689     Deutsche Borse AG     1.917.829     0,11       635.897     Deutsche Post AG     33.734.336     1,93	Memania								0,6
267.366 Bayerische Motoren Werke AG 22.710.068 1,30 2.925.860 Norsk Hydro ASA 16.893.830 235.312 Brenntag S.E. 17.959.012 1,03 74.256 Yara International ASA 3.214.197 65.492 Daimler AG 5.429.942 0,31 290.079 Deutsche Bank AG 13.682,960 13.689 Deutsche Boerse AG 1.917.829 0,11 635.897 Deutsche Post AG 3.3734.336 1,93		BASE S.E.	27.071 767	1 55			•		0,4 0,2
235.312 Brenntag S.E. 17.959.012 1,03 74.256 Yara International ASA 3.214.197 335.844 Covestro AG 144A <sup>(a)</sup> 16.761.974 0,96 65.492 Daimler AG 5.429.942 0,31 42.131.667 290.079 Deutsche Bank AG 3.082.960 0,18 13.689 Deutsche Boerse AG 1.917.829 0,11 635.897 Deutsche Post AG 33.734.336 1,93									0,2
335.844 Covestro AG 144A <sup>(a)</sup> 16.761.974 0,96	235.312	Brenntag S.E.	17.959.012	1,03			•		0,3
290.079       Deutsche Bank AG       3.082.960       0,18         13.689       Deutsche Boerse AG       1.917.829       0,11         635.897       Deutsche Post AG       33.734.336       1,93						. 1.200			
13.689 Deutsche Boerse AG       1.917.829       0,11         635.897 Deutsche Post AG       33.734.336       1,93								42.131.667	2,4
635.897 Deutsche Post AG 33.734.336 1,93									
	737.129	Deutsche Telekom AG	11.608.307	0,67					

Tenencias		Descripción del valor	Valor de mercado en EUR	% del patrimonio	Tenenc		Descripe del valo			mercad	or de do en EUR	% del
	ordina	arias - (continuación)					,	continuación)				
Portugal	71 025	Cala Energia SCRS S A	0.635.640	0.55	Reino	Unido – (coi		i <b>ón)</b> ie Group Plc.—/	A D D (b)	18.137	7 520	1,04
		Galp Energia SGPS S.A. Sonae SGPS S.A.	9.635.649 647.229	0,55 0,04		693.432			ADK	8.552		0,49
00	00.001	onac oor o o.A.				000.402		0.	_			
			10.282.878	0,59						250.032	314	14,32
España						DE ACCION			4	.701.199	965	97,43
		Acerinox S.A. Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	531.676	0,03		EUR 1.508.1				./01.199	.005	97,40
01	17.520	S.A.	3.884.884	0,22				BILIARIOS ADI BOLSA DE VAL				
2.57	76.120	Banco de Sabadell S.A.	1.537.944	0,09	OFICIA		UNA	OLSA DE VAL	ORES			
2.44	47.630	Bankinter S.A.	10.652.086	0,61	(coste	EUR 1.508.1	36.181	)	1	.701.199	.865	97,43
59	94.962	Grifols S.A.	9.486.669	0,55	VALOR	DE MERCA	ADO DE	LAS INVERSI	ONES			
99	91.605	Repsol S.A.	9.631.459	0,55	EXCLU	YENDO DE	RIVADO	os				
			35.724.718	2,05	(coste	EUR 1.508.1	136.181	)	1	.701.199	.865	97,43
Suecia					Contra	tos de futur	os – (0	,01 %)				
	87.599	Getinge AB "B"	11.003.791	0,63				,	Valor de			
		Industrivarden AB	3.325.943	0,19					mercado de la	Plusv		
10	05.306	Industrivarden AB "C"	2.779.822	0,16	Número contrat		oción de	el valor	asignación en EUR	latente		% de patrimonio
36	69.181	Investor AB "A"	7.870.520	0,45							-	
1.03	33.453	Investor AB "B"	21.447.748	1,23		GBP Futuro	s sobre	el				
		Lundin Energy AB	15.593.790	0,89			100 Ind		1.911.229	6.0	076	0,00
		Sandvik AB Svenska Handelsbanken AB "A"	6.627.357	0,38		17/12/2	2021					
		Swedbank AB "A"	3.591.310 20.700.668	0,21 1,18	PLUSV	ALÍA LATEN	NTE SO	BRE CONTRA	ros			
		Telefonaktiebolaget LM Ericsson "B"	5.160.892	0,30	DE FU	ruros				6.0	076	0,00
		Volvo AB "B"	8.783.305	0,50					Valor de			
70	33.032	VOIVO AB B	106.885.146	6,12	Número	, do			mercado de la asignación en	Minusv latente		% de
			100.003.140	0,12	contrat		oción de	el valor	EUR			patrimonio
Suiza						EUR						
		ABB Ltd.	25.533.923	1,46			s sobre	el Large	E 101 10E	(115.0	)EQ)	(0.04)
		Adecco Group AG Comet Holding AG	1.125.881 708.553	0,07 0,04		Euro S		0 Index Larga	5.191.125	(115.2	.53)	(0,01)
		Glencore Plc.	5.021.482	0,29		17/12/2	2021					
		Kuehne & Nagel International AG	22.852.533	1,31			NTE S	OBRE CONTRA	ATOS	(115.2	253)	(0,01)
		Lonza Group AG	15.082.666	0,87	DE FU	ruros				(110.2		(0,01)
12	22.901	Nestlé S.A.	14.027.351	0,80	Contra	tos de divi	sas a r	olazo específic	os de una clas	se de ac	ciones -	- (0.12 %)
		Roche Holding AG	48.552.910	2,78							Plusvalía	(-,,-,
		STMicroelectronics NV	2.327.608	0,13							atente en	% de
		Swiss Prime Site AG Tecan Group AG	318.539 25.692.824	0,02 1,47	Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencin	niento	EUR	patrimonio
		UBS Group AG	25.693.995	1,47	CHF	1.333.200	EUR	1.273.136	23/12	2/2021	6.078	0,00
	0000	220 0.0up / .0			CHF	287.580	GBP	230.722	23/12	2/2021	5.146	0,00
			186.938.265	10,71	CHF	13.057		125.137	23/12		384	0,00
Reino Unid	ot				CHF	76.091		733.004	23/12		1.554	0,00
		Anglo American Plc.	24.133.540	1,38	CHF EUR	1.259 10.502.086		1.361 8.832.528	23/12		13 136.542	0,00 0,01
		Aviva Plc.	20.363.055	1,17	EUR	476.922		4.790.527	23/12		12.108	0,00
		British American Tobacco Plc.	29.384.593	1,68 0,07	EUR	2.779.729		28.060.951	23/12		44.174	0,00
		Burberry Group Plc. Diageo Plc.	1.244.532 9.176.683	0,07	EUR	14.391.293		22.180.668		2/2021	111.019	0,01
		Ferguson Plc.	6.840.321	0,33	EUR	55.396		62.703	23/12		345	0,00
		IG Group Holdings Plc.	1.080.196	0,06	PLN	983.602		209.227	23/12		845	0,00
		Imperial Brands Plc.	21.386.405	1,22	PLN	387.574		69.343	23/12		1.391	0,00
3	34.754	InterContinental Hotels Group Plc.	1.828.049	0,10	PLN	17.614		37.610	23/12		112	0,00
		Intertek Group Plc.	1.010.202	0,06	PLN PLN	102.662 1.699		220.304 409	23/12 23/12		450 4	0,00
		ITV Plc.	8.049.573	0,46	USD	94.587		70.211	23/12		653	0,00
		JD Sports Fashion Plc.	3.078.962 10.383.466	0,18	USD	4.293		38.081	23/12		74	0,00
		Legal & General Group Plc. M&G Plc.	825.726	0,59 0,05	USD	25.024		223.061	23/12		228	0,00
		Man Group Plc.	4.936.794	0,03	PI IIQV	ΔΙ [Δ Ι ΔΤΕΝ	NTF SO	BRE CONTRA	TOS DE DIVISAS	S		
		Melrose Industries Plc.	2.242.310	0,13				CON FINES DE			321.120	0,02
16	69.948	Next Plc.	15.755.354	0,90								
		Persimmon Plc.	9.084.144	0,52							Minusvalía latente en	
		Phoenix Group Holdings Plc.	1.665.423	0,10	Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de venci			% as patrimoni
25		Prudential Plc.	3.833.802	0,22								•
	41,061	Rio Tinto Plc.—ADR <sup>(b)</sup>	24.606.528	1,41	EUR EUR	7.448.241 12.374		7.804.649 58.110		2/2021 2/2021	(40.387) (37)	
	27.001		8.198.785	0,47	LUIN	12.5/4	LIN	30.110	Z3/ I.		(37)	(0,00
19	97.094	•			GBP		CHF	10 102	23/1	2/2021	(131)	(0.00
19 24	44.513	SSE Plc. Tate & Lyle Plc.	4.452.652 467.702	0,26 0,03	GBP GBP		CHF EUR	10.102 790.190		2/2021 2/2021	(131) (8.534)	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones -

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimi	later	svalía nte en EUR	% del patrimonio
NOK	420.592	EUR	41.612	23/12/2	2021	(803)	(0,00)
PLN	272.955	CHF	60.920	23/12/2	2021	(157)	(0,00)
SEK	25.994	CHF	2.666	23/12/2	2021	(24)	(0,00)
SEK	2.773.847	EUR	271.354	23/12/2	2021	(941)	(0,00)
SGD	406.869.434	EUR	264.334.047	23/12/2	2021 (2.384	4.886)	(0,14)
USD	66.618	CHF	61.682	23/12/2	2021	(688)	(0,00)
USD	244.410	EUR	215.892	23/12/2	2021 (1	1.280)	(0,00)
			BRE CONTRA	TOS DE DIVISAS COBERTURA		7.888)	(0,14)
	R DE MERCA EUR 1.508.1		LAS INVERSIO	ONES	1.698.9	73.920	97,30
OTRO	S ACTIVOS Y	PASIV	os		47.09	95.390	2,70
PATRI	MONIO				1.746.0	69.310	100,00
TOTAL	L DE INVERS	IONES		m	Valor de ercado en EUR		% del patrimonio
	nversiones ex	cluyend	o derivados (co		1.199.865		97,43
	,	ore cont	ratos de futuros		6.076		0.00
			ntratos de futuro		(115.253)		(0,01)
	alía latente sob		ratos de divisas		321.120		0.02
			ntratos de divisa	as a plazo	32 120		0,02
celeb	orados con fine	es de co	bertura	(2	.437.888)		(0,14)
Otros	activos y pasiv	/os		47	7.095.390		2,70
Patrim	nonio			1.74	6.069.310		100.00

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Credit Suisse International, Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., State Street Bank & Trust y UBS AG.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,01 %.

\* Una parte de estos valores estaba cedida en préstamo a 30 de noviembre de 2021.

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Productos farmacéuticos	7,06
Semiconductores	7,03
Bancos	6,85
Alimentación, bebidas y tabaco	5,77
Minería	5,54
Transportes	5,48
Fabricantes de automóviles	5,21
Equipos y componentes eléctricos	5,19
Productos químicos	4,70
Atención sanitaria – Productos	4,47
Otros	40,13
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	97,43
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	0,00
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(0,01)
Plusvalia latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	0,02
Minusvalia latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	(0,14)
Otros activos y pasivos	2,70
TOTAL	100,00

Consulte la Nota 6.

 <sup>(</sup>a) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.

<sup>(</sup>b) Los valores se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional)).

Tenencias		Descripción del valor	Valor de mercado en EUR	% del patrimonio	Tenencias		Descripción del valor	Valor de mercado en EUR	% del patrimonio
		rios admitidos a cotización en una arias – 97,73 %	bolsa de valor	res oficial	Acciones		arias – (continuación) inuación)		
Austria		•	22.250	0,79			Draegerwerk AG & Co. KGaA DWS Group GmbH & Co. KGaA	1.142	0,03
		Erste Group Bank AG Raiffeisen Bank International AG	32.258 3.862	0,79			144A <sup>(a)</sup>	13.413	0,33
	143	Nameisen Bank International AG				5.628	E.ON S.E.	61.683	1,51
			36.120	0,88		16	Gerresheimer AG	1.297	0,03
Bélgica						128	Hapag-Lloyd AG 144A <sup>(a)</sup>	28.672	0,70
0.g.o	36	Ackermans & van Haaren NV	5.260	0,13		246	HelloFresh S.E.	22.730	0,56
		D'ieteren S.A./NV	7.317	0,18		57	Henkel AG & Co. KGaA – Preferente	3.977	0,10
		Gimv NV	38.909	0,95			Hugo Boss AG	6.549	0,16
		Groupe Bruxelles Lambert S.A.	2.694	0,07		1.679	Infineon Technologies AG	68.293	1,67
		Van de Velde NV	27.634	0,68			Kloeckner & Co. S.E.	4.046	0,10
	571	X-Fab Silicon Foundries S.E. 144A <sup>(a)</sup>	5.436	0,13			Merck KGaA	72.718	1,78
			07.050	0.44			MLP S.E.	33.734	0,82
Finlandia			87.250	2,14			Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG	47.511	1,16
	1.358	Kesko OYJ "B"	37.644	0,92		180	Porsche Automobil Holding S.E.— Preferente	12 402	0,33
	3.966	Nokia OYJ	19.701	0,48		100	Rheinmetall AG	13.403 7.834	0,33 0,19
	3.953	Nordea Bank Abp	41.419	1,01			SAP S.E.	110.246	2,70
	1.302	Sampo OYJ "A"	55.856	1,37			Siemens AG	29.773	0,73
	1.596	Taaleri OYJ	16.598	0,41			Siemens Healthineers AG 144A <sup>(a)</sup>	58.474	1,43
			171.218	4,19			SUESS MicroTec S.E.	1.263	0,03
			171.210	4,19			Volkswagen AG—Preferente	61.147	1,50
Francia							Wacker Chemie AG	30.254	0,74
	530	Air Liquide S.A.	77.677	1,90		130	Wacker Offernic AG		0,74
	85	Arkema S.A.	9.898	0,24				1.157.877	28,34
	3.483	AXA S.A.	84.463	2,07	Italia				
		BioMerieux	1.274	0,03		1.160	Aquafil SpA	8.538	0,21
		Bouygues S.A.	927	0,02			Azimut Holding SpA	9.575	0,23
		Christian Dior S.E.	42.367	1,04			Banca Mediolanum SpA	5.314	0,13
		Compagnie de Saint-Gobain	60.931	1,49			Biesse SpA	8.204	0,20
		Dassault Systemes S.E.	52.595	1,29			Enel SpA	641	0,02
		Electricite de France S.A.	44.353	1,09			Ferrari NV	42.679	1,04
		Engle S.A.	58.673	1,44		528	Moncler SpA	34.225	0,84
		EssilorLuxottica S.A.	4.613	0,11		44	Prysmian SpA	1.472	0,04
		Hermes International	93.436	2,29			Reply SpA	16.568	0,41
		Ipsen S.A.	14.065	0,34		2.646	Rizzoli Corriere Della Sera		
		Jacquet Metals SACA	4.826	0,12			Mediagroup SpA	2.130	0,05
		Kering S.A.	86.423	2,11				129.346	3,17
		Legrand S.A.	65.547	1,60				120.040	
		L'Oreal S.A.  LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton	79.600	1,95	Luxembu	-			
	233	S.E.	160.537	3,93			Aroundtown S.A.	2.454	0,06
	174	Mersen S.A.	5.638	0,14			Eurofins Scientific S.E.	58.281	1,42
		Nexans S.A.	12.352	0,30		348	RTL Group S.A.	15.876	0,39
	169	Pernod Ricard S.A.	34.206	0,84				76.611	1,87
		Publicis Groupe S.A.	53.932	1,32	Defeas Ba				
		Renault S.A.	3.433	0,08	Países Ba	-	Aalberts NV	15.480	0.20
		Rothschild & Co.	34.095	0,83			ASM International NV	67.735	0,38 1,66
	256	Sanofi	21.622	0,53			ASML Holding NV	292.714	7,16
	112	Sartorius Stedim Biotech	59.987	1,47			Heineken Holding NV	2.237	0,05
	750	Schneider Electric S.E.	117.105	2,87			Koninklijke Ahold Delhaize NV	59.302	1,45
	1.929	Société Générale S.A.	53.183	1,30			OCI NV	20.198	0,49
	886	TotalEnergies S.E.	35.817	0,88			QIAGEN NV	785	0,43
	7	Virbac S.A.	2.908	0,07			Randstad NV	36.884	0,90
			1.376.483	33,69			Signify NV 144A <sup>(a)</sup>	22.796	0,56
			1.07 0.400	33,03			Stellantis NV	64.449	1,58
Alemania							Van Lanschot Kempen NV	4.130	0,10
		Allianz S.E.	11.712	0,29			Wolters Kluwer NV	54.982	1,35
		BASF S.E.	80.611	1,97					
		Bayerische Motoren Werke AG	36.439	0,89				641.692	15,70
	431	Bayerische Motoren Werke	20.000	0.70	Portugal				
		AG— Preferente	29.998	0,73	-	4.208	Galp Energia SGPS S.A.	34.598	0,85
		Brenntag S.E.	41.594	1,02		00		34.000	
		Covestro AG 144A <sup>(a)</sup>	42.923	1,05	España				_
		Daimler AG	87.636	2,14			Acerinox S.A.	25.922	0,63
		Deutsche Bank AG Deutsche Lufthansa AG	28.281	0,69		8.921	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	10.555	
		Deuische Lumnansa AG	1.066	0,03			S.A.	42.393	1,04
		Deutsche Post AG	80.371	1,97		24 744	Banco de Sabadell S.A.	18.931	0,46

	Descripción lel valor		Valor de mercado en EUR	% del patrimonio
Acciones ordinar	ias – (continuación)			
España - (continua	•	(-)		
	Global Dominion Access S.A.	144A <sup>(a)</sup>	7.399	0,18
	Grifols S.A. berdrola S.A.		35.749 60.426	0,88 1,48
	Repsol S.A.		26.672	0,65
2	10p001 0.11 ii	_	217.492	5,32
Suiza				
1.488	STMicroelectronics NV		64.691	1,58
TOTAL DE ACCION (coste EUR 3.920.7			3.993.378	97,73
Fondos de invers	ión – 1,47 %			
6 (	Goldman Sachs Euro Liquid			
F	Reserves Fund (Clase de acc le distribución X) <sup>(b)(c)</sup>	iones	59.918	1,47
TOTAL DE FONDO (coste EUR 59.954)			59.918	1,47
	ES MOBILIARIOS ADMITIDO UNA BOLSA DE VALORES	os		
OITOIAL				
(coste EUR 3.980.7	10)		4.053.296	99,20
(coste EUR 3.980.7 VALOR DE MERCA EXCLUYENDO DE	DO DE LAS INVERSIONES			
(coste EUR 3.980.7 VALOR DE MERCA EXCLUYENDO DEI (coste EUR 3.980.7	DO DE LAS INVERSIONES RIVADOS 10)		4.053.296 4.053.296	99,20
(coste EUR 3.980.7 VALOR DE MERCA EXCLUYENDO DE	DO DE LAS INVERSIONES RIVADOS 10)			
(coste EUR 3.980.7 VALOR DE MERCA EXCLUYENDO DEI (coste EUR 3.980.7	DO DE LAS INVERSIONES RIVADOS 10) ps – (0,02 %)	Valor de	4.053.296	
(coste EUR 3.980.7 VALOR DE MERCA EXCLUYENDO DEI (coste EUR 3.980.7 Contratos de futuro	DO DE LAS INVERSIONES RIVADOS 10) ps - (0,02 %)	Valor de rcado de la gnación en	4.053.296  Minusvalia latente en	
(coste EUR 3.980.7 VALOR DE MERCA EXCLUYENDO DEI (coste EUR 3.980.7 Contratos de futuro Número de	DO DE LAS INVERSIONES RIVADOS 10) ps - (0,02 %)	rcado de la	4.053.296 Minusvalía	99,20
(coste EUR 3.980.7  VALOR DE MERCA EXCLUYENDO DEI (coste EUR 3.980.7  Contratos de future  Número de contratos Descrip EUR 2 Futuros	DO DE LAS INVERSIONES RIVADOS 10)  ps = (0,02 %)  me asi ación del valor  s sobre el Euro Larga (50 Index	rcado de la gnación en	4.053.296  Minusvalia latente en	99,20 % del
(coste EUR 3.980.7  VALOR DE MERCA EXCLUYENDO DEI (coste EUR 3.980.7  Contratos de future  Número de contratos  EUR 2 Futuros STOXX 17/12/2	DO DE LAS INVERSIONES RIVADOS 10)  os – (0,02 %)  me asi oción del valor  s sobre el Euro Larga (50 Index (021)	rcado de la gnación en EUR 81.750	4.053.296  Minusvalía latente en EUR	99,20 % del patrimonio
(coste EUR 3.980.7  VALOR DE MERCA EXCLUYENDO DEI (coste EUR 3.980.7  Contratos de future  Número de contratos  EUR 2 Futuros STOXX 17/12/2	DO DE LAS INVERSIONES RIVADOS 10)  ps = (0,02 %)  me asi ación del valor  s sobre el Euro Larga (50 Index	rcado de la gnación en EUR 81.750	4.053.296  Minusvalía latente en EUR	99,20 % del patrimonio
(coste EUR 3.980.7  VALOR DE MERCA EXCLUYENDO DEI (coste EUR 3.980.7  Contratos de future  Número de contratos  EUR 2 Futuros STOXX 17/12/2  MINUSVALÍA LATE	DO DE LAS INVERSIONES RIVADOS 10)  DOS - (0,02 %)  me asi doción del valor  s sobre el Euro Larga (50 Index (2021)  NTE SOBRE CONTRATOS (1)  DO DE LAS	rcado de la gnación en EUR 81.750	4.053.296  Minusvalia latente en EUR  (1.049)	99,20 % del patrimonio (0,02)
(coste EUR 3.980.7  VALOR DE MERCA EXCLUYENDO DEI (coste EUR 3.980.7  Contratos de future  Número de contratos  EUR 2 Futuros STOXX 17/12/2  MINUSVALÍA LATE FUTUROS  VALOR DE MERCA INVERSIONES	DO DE LAS INVERSIONES RIVADOS 10)  DISTRICT OF THE PROPERTY OF	rcado de la gnación en EUR 81.750	4.053.296  Minusvalia latente en EUR  (1.049)	99,20 % del patrimonio (0,02)
(coste EUR 3.980.7  VALOR DE MERCA EXCLUYENDO DEI (coste EUR 3.980.7  Contratos de futur  Número de contratos Descrip  EUR 2 Futuros STOXX 17/12/2  MINUSVALÍA LATE FUTUROS  VALOR DE MERCA INVERSIONES (coste EUR 3.980.7	DO DE LAS INVERSIONES RIVADOS 10)  DISTRICT OF THE PROPERTY OF	rcado de la gnación en EUR 81.750	4.053.296  Minusvalia latente en EUR  (1.049)  (1.049)	99,20 % del patrimonio (0,02) (0,02)
(coste EUR 3.980.7  VALOR DE MERCA EXCLUYENDO DEI (coste EUR 3.980.7  Contratos de future  Número de contratos  EUR 2 Futuros STOXX 17/12/2  MINUSVALÍA LATE FUTUROS  VALOR DE MERCA INVERSIONES (coste EUR 3.980.7  OTROS ACTIVOS \( \)  PATRIMONIO	DO DE LAS INVERSIONES RIVADOS 10)  DISTRICT OF THE PROPERTY OF	rcado de la gnación en EUR 81.750	4.053.296  Minusvalia latente en EUR  (1.049)  (1.049)  4.052.247  33.685  4.085.932  Valor de mercado en	99,20  % del patrimonio (0,02)  (0,02)  99,18  0,82 100,00
(coste EUR 3.980.7  VALOR DE MERCA EXCLUYENDO DEI (coste EUR 3.980.7  Contratos de futuro  Número de contratos  EUR 2 Futuros STOXX 17/12/2  MINUSVALÍA LATE FUTUROS  VALOR DE MERCA INVERSIONES (coste EUR 3.980.7  OTROS ACTIVOS Y  PATRIMONIO	DO DE LAS INVERSIONES RIVADOS 10)  DOS - (0,02 %)  me asi ación del valor  S sobre el Euro Larga (50 Index (2021)  NTE SOBRE CONTRATOS I  DO DE LAS 10)  ( PASIVOS	rcado de la gnación en EUR 81.750	4.053.296  Minusvalia latente en EUR  (1.049)  4.052.247  33.685  4.085.932  Valor de	99,20  % del patrimonio (0,02)  (0,02)  99,18  0,82 100,00
(coste EUR 3.980.7  VALOR DE MERCA EXCLUYENDO DEI (coste EUR 3.980.7  Contratos de futuro  Número de contratos Descrip  EUR 2 Futuros STOXX 17/12/2  MINUSVALÍA LATE FUTUROS  VALOR DE MERCA INVERSIONES (coste EUR 3.980.7  OTROS ACTIVOS N  PATRIMONIO  TOTAL DE INVERS  Total inversiones ex	DO DE LAS INVERSIONES RIVADOS 10)  DISTRICT OF THE PROPERTY OF	rcado de la gnación en EUR 81.750	4.053.296  Minusvalia latente en EUR  (1.049)  4.052.247  33.685  4.085.932  Valor de mercado en EUR	99,20  % del patrimonio (0,02)  (0,02)  99,18  0,82  100,00  % del patrimonio
(coste EUR 3.980.7 VALOR DE MERCA EXCLUYENDO DEI (coste EUR 3.980.7 Contratos de futuro  Número de contratos  Descrip  EUR  2 Futuros STOXX 17/12/2  MINUSVALÍA LATE FUTUROS  VALOR DE MERCA INVERSIONES (coste EUR 3.980.7 OTROS ACTIVOS Y PATRIMONIO  TOTAL DE INVERS  Total inversiones ex 3.980.710)	DO DE LAS INVERSIONES RIVADOS 10)  DISTRICT OF THE PROPERTY OF	rcado de la gnación en EUR 81.750	4.053.296  Minusvalia latente en EUR  (1.049)  4.052.247  33.685  4.085.932  Valor de mercado en EUR  4.053.296	99,20  % del patrimonio (0,02)  (0,02)  99,18  0,82  100,00  % del patrimonio
(coste EUR 3.980.7 VALOR DE MERCA EXCLUYENDO DEI (coste EUR 3.980.7 Contratos de futuro  Número de contratos  Descrip  EUR  2 Futuros STOXX 17/12/2  MINUSVALÍA LATE FUTUROS  VALOR DE MERCA INVERSIONES (coste EUR 3.980.7 OTROS ACTIVOS Y PATRIMONIO  TOTAL DE INVERS  Total inversiones ex 3.980.710)	DO DE LAS INVERSIONES RIVADOS 10)  DOS - (0,02 %)  ME asi  DOS - (0,02 %)  ME ASI  SENDE EL EURO  LARGA  (50 Index (2021  NTE SOBRE CONTRATOS I  DO DE LAS (10)  ( PASIVOS  IONES  Cluyendo derivados (coste El obre contratos de futuros	rcado de la gnación en EUR 81.750	4.053.296  Minusvalia latente en EUR  (1.049)  4.052.247  33.685  4.085.932  Valor de mercado en EUR	99,20 % del patrimonio (0,02) (0,02) 99,18

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Semiconductores	12,23
Confección	10,05
Fabricantes de automóviles	8,29
Productos químicos	7,41
Electricidad	5,54
Bancos	5,51
Equipos y componentes eléctricos	5,37
Seguros	4,89
Software	3,99
Alimentación, bebidas y tabaco	3,82
Otros	30,63
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	97,73
Fondos de inversión	1,47
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(0,02)
Otros activos y pasivos	0,82
TOTAL	100,00

El Comisionista de futuros fue Barclays Capital, Inc.

<sup>La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,00 %.

(a) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.</sup> 

<sup>(</sup>b) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

 $<sup>^{\</sup>rm (c)}\,$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del (0,627) %.

### Goldman Sachs Funds—Global CORE® Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% de
Valores mobilia Acciones ordina	rios admitidos a cotización en u arias – 96,66 %	na bolsa de valor	es oficial	Acciones ordina Japón – (continu	arias – (continuación) ación)		
Argentina				468.700	Isuzu Motors Ltd.	6.328.793	0,1
7.713	MercadoLibre, Inc.	9.548.771	0,22	71.800	ITOCHU Corp.	2.071.491	0,0
Australia				259.800	Kao Corp.	13.325.098	0,3
	BHP Group Plc.	11.900.534	0,28	131.200	Konami Holdings Corp.	6.767.493	0,1
	Mineral Resources Ltd.	7.851.148	0,28	90.600	Kyocera Corp.	5.394.654	0,1
	Telstra Corp., Ltd.	18.885.478	0,18	1.508.200	Mitsui & Co., Ltd.	34.027.263	0,7
	Treasury Wine Estates Ltd.	22.374.271	0,52	537.400	Mitsui OSK Lines Ltd.	30.937.512	0,7
	Washington H Soul Pattinson &	22.074.271	0,02	243.500	Mizuho Financial Group, Inc.	3.013.835	0,0
31.073	Co., Ltd.	707.266	0,02	445.600	NEC Corp.	20.238.318	0,4
			<del></del>	362.400	NGK Insulators Ltd.	5.752.005	0,1
		61.718.697	1,44		Nippon Yusen KK	17.901.776	0,4
Bermudas					Nissan Motor Co., Ltd.	3.451.877	0,0
683.419	Arch Capital Group Ltd.	28.027.013	0,65		Nomura Holdings, Inc.	6.796.781	0,1
Canadá					ORIX Corp.	25.813.251	0,6
	Gildan Activewear, Inc.	2.540.315	0,06		Sekisui House Ltd.	2.018.065	0,0
	Magna International, Inc.	19.924.843			SoftBank Group Corp.	13.669.437	0,32
236.200	Magna International, Inc.	19.924.043	0,46		Sumitomo Corp.	32.182.925	0,7
		22.465.158	0,52	834.600	Sumitomo Mitsui Financial Group,	07 000 750	0.0
Dinamarca				440.400	Inc.	27.260.753	0,64
	AP Moller - Maersk A/S "A"	1.480.004	0,04		Suntory Beverage & Food Ltd.	4.181.114	0,10
	AP Moller - Maersk A/S "B"	30.587.437	0,71		Tokio Marine Holdings, Inc.	22.168.136	0,52
	Novo Nordisk A/S "B"	19.013.708	0,44		Tokyo Gas Co., Ltd.	2.052.959	0,05
174.712	Novo Nordiok7VC B		<del></del>		Tokyo Seimitsu Co., Ltd.	790.872	0,02
		51.081.149	1,19	95.000	Toyota Tsusho Corp.	4.149.872	0,10
Finlandia						303.012.218	7,08
	Nokia OYJ	2.061.740	0,05	Luxemburgo			
92.003	Nordea Bank Abp	1.096.896	0,02	276.535	Eurofins Scientific S.E.	36.242.022	0,8
		3.158.636	0,07	Países Bajos			
Francia				85.865	ASM International NV	39.627.745	0,93
	Compagnie de Saint-Gobain	25.687.065	0,60	82.836	ASML Holding NV	67.788.191	1,58
	Dassault Systemes S.E.	3.492.138	0,08	208.570	Koninklijke Ahold Delhaize NV	7.057.941	0,17
	Engie S.A.	14.920.583	0,35	51.336	OCI NV	1.411.251	0,03
	Kering S.A.	33.193.781	0,78		Royal Dutch Shell Plc. "A"	2.665.852	0,06
	Legrand S.A.	12.327.431	0,29	2.394.710	Stellantis NV	41.673.431	0,97
17.338	L'Oreal S.A.	7.891.221	0,18			160.224.411	3,74
5.644	Pernod Ricard S.A.	1.299.819	0,03				
224.939	Publicis Groupe S.A.	14.747.665	0,35	Noruega			
260.993	Rexel S.A.	4.834.689	0,11		Aker BP ASA	20.953.236	0,49
14.871	Sartorius Stedim Biotech	9.062.875	0,21		Equinor ASA	10.527.252	0,25
224.985	Schneider Electric S.E.	39.971.733	0,93		Golden Ocean Group Ltd.	9.562.355	0,22
		167.429.000	3,91	4.105.933	Norsk Hydro ASA	27.369.829	0,64
Alemania						68.412.672	1,60
	BASF S.E.	10.399.947	0,24	España			
	Bayerische Motoren Werke AG	18.834.770	0.44	422.350	Repsol S.A.	4.667.788	0,1
	Brenntag S.E.	16.198.059	0,38	Suecia			
	Covestro AG 144A <sup>(a)</sup>	12.914.244	0,30		Getinge AB "B"	1.041.710	0,02
	Deutsche Post AG	40.499.934	0,95		Investor AB "A"	8.963.675	0,2
2.913.148	E.ON S.E.	36.329.410	0,85		Investor AB "B"	40.242.414	0,94
463.130	Infineon Technologies AG	21.434.616	0,50	160.202	Lundin Energy AB	5.641.729	0,13
162.809	Merck KGaA	41.070.439	0,96		Sandvik AB	11.031.839	0,26
16.171	SAP S.E.	2.119.701	0,05		SSAB AB "B"	1.235.725	0,03
236.142	Siemens Healthineers AG 144A(a)	17.594.104	0,41		Swedbank AB "A"	1.552.206	0,04
181.778	Volkswagen AG—Preferente	33.726.712	0,79	206.110	Volvo AB "B"	4.518.751	0,10
		251.121.936	5,87			74.228.049	1,73
Irlanda				Suiza			
	Accenture Plc. "A"	2.991.069	0,07		ABB Ltd.	16.797.759	0,39
42.273	Perrigo Co., Plc.	1.564.524	0,04		Chubb Ltd.	32.837.698	0,7
		4.555.593	0,11	2.696.722	Glencore Plc.	13.011.100	0,30
		4.000.000	0,11	99.218	Kuehne & Nagel International AG	28.920.531	0,68
Japón				19.296	Roche Holding AG	7.523.544	0,18
	Amada Co., Ltd.	1.912.595	0,04	77.369	STMicroelectronics NV	3.827.294	0,09
	Casio Computer Co., Ltd.	4.159.359	0,10	21.218	Tecan Group AG	12.902.212	0,30
1.528.900	ENEOS Holdings, Inc.	5.719.072	0,13	1.325.232	UBS Group AG	22.815.402	0,53
	lida Group Holdings Co., Ltd.	926.912	0,02				

### Goldman Sachs Funds—Global CORE® Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ordina	arias – (continuación)			Acciones ordina	arias – (continuación)		
	Anglo American Plc.	14.802.397	0,35		Johnson & Johnson	29.558.853	0,69
	British American Tobacco Plc.	12.418.678	0,29		KeyCorp	16.652.085	0,39
					Landstar System, Inc.	1.745.114	0,04
		27.221.075	0,64	8.551	Lennox International, Inc.	2.758.040	0,06
Estados Unidos				300.183	LKQ Corp.	17.026.380	0,40
425.318	AbbVie, Inc.	49.498.509	1,16	13.899	ManpowerGroup, Inc.	1.260.500	0,03
97.810	Air Products and Chemicals, Inc.	28.416.739	0,66		Marriott Vacations Worldwide Corp.		0,06
45.042	Airbnb, Inc. "A"	8.044.051	0,19		Marsh & McLennan Cos., Inc.	39.039.344	0,91
	Akamai Technologies, Inc.	2.706.766	0,06		Meta Platforms, Inc. "A"	91.165.723	2,13
	Align Technology, Inc.	21.515.623	0,50		Mettler-Toledo International, Inc.	39.447.116	0,92
	Ally Financial, Inc.	32.789.898	0,77		Microsoft Corp.	124.901.952	2,92
	Alphabet, Inc. "A"	4.820.285	0,11		Molina Healthcare, Inc.	5.173.640 31.103.835	0,12 0,73
	Alphabet, Inc. "C"	153.397.877	3,58		MongoDB, Inc. Monster Beverage Corp.	15.545.750	0,73
	Amazon.com, Inc.	69.714.384	1,63		NetApp, Inc.	6.043.590	0,30
14.551	AMC Entertainment Holdings, Inc. "A"	518.161	0,01		News Corp. "A"	15.704.525	0,17
94 077	American Electric Power Co., Inc.	7.759.471	0,18		Norfolk Southern Corp.	18.996.749	0,44
	American Homes 4 Rent "A"	13.062.226	0,18		NRG Energy, Inc.	2.180.207	0,05
	Amgen, Inc.	13.714.756	0,32		NVIDIA Corp.	55.389.900	1,29
	Anthem, Inc.	20.525.556	0,48		Okta, Inc.	11.030.815	0,26
	Apple, Inc.	138.125.216	3,23		Omnicom Group, Inc.	29.867.415	0,70
	Archer-Daniels-Midland Co.	33.419.944	0,78		ON Semiconductor Corp.	11.433.527	0,27
	AutoNation, Inc.	11.573.045	0,27	29.570	O'Reilly Automotive, Inc.	19.090.688	0,45
	Axalta Coating Systems Ltd.	6.031.833	0,14		Otis Worldwide Corp.	10.498.464	0,25
103.714	Biogen, Inc.	24.732.678	0,58	73.675	Palo Alto Networks, Inc.	40.930.146	0,96
20.985	Boyd Gaming Corp.	1.254.064	0,03	87.135	Parker-Hannifin Corp.	26.806.211	0,63
7.096	Broadcom, Inc.	4.002.073	0,09	213.783	PayPal Holdings, Inc.	40.274.579	0,94
38.162	Bruker Corp.	3.246.060	0,08	193.272	Philip Morris International, Inc.	16.629.123	0,39
19.569	Builders FirstSource, Inc.	1.381.180	0,03	15.762	Pioneer Natural Resources Co.	2.836.530	0,07
66.258	Camden Property Trust	11.173.087	0,26		Pool Corp.	5.516.659	0,13
242.780	Capital One Financial Corp.	35.188.533	0,82	32.548	Prologis, Inc.	4.979.844	0,12
198.041	Caterpillar, Inc.	38.711.074	0,90	11.081	•		0,02
	Cerner Corp.	11.197.715	0,26		S&P Global, Inc.	40.520.800	0,95
	CF Industries Holdings, Inc.	3.319.644	0,08		Sempra Energy	2.041.966	0,05
	Cigna Corp.	25.508.350	0,60		ServiceNow, Inc.	41.979.349	0,98
	Citizens Financial Group, Inc.	24.877.458	0,58		Stanley Black & Decker, Inc.	6.613.807	0,15
	CMS Energy Corp.	2.474.937	0,06		Synchrony Financial	41.285.059	0,96
448.277	Cognizant Technology Solutions Corp. "A"	35.611.125	0,83	54.978	Tesla, Inc. Texas Instruments, Inc.	64.104.348 2.791.209	1,50 0,07
434 380	CSX Corp.	15.442.209	0,36		Travelers Cos., Inc.	1.784.817	0,07
	Darling Ingredients, Inc.	1.823.590	0,04		Ulta Beauty, Inc.	7.844.255	0,18
	Dick's Sporting Goods, Inc.	34.037.204	0,79		Universal Health Services, Inc. "B"	9.588.861	0,22
	DocuSign, Inc.	35.622.449	0,83		Vail Resorts, Inc.	16.635.806	0,39
	Dow, Inc.	33.929.572	0,79		VeriSign, Inc.	47.413.466	1,11
	DXC Technology Co.	2.646.791	0,06		Vertex Pharmaceuticals. Inc.	9.372.692	0,22
	Dynatrace, Inc.	2.024.115	0,05	285.885	VMware, Inc. "A"	34.206.140	0,80
200.976	eBay, Inc.	14.034.154	0,33	218.389	Voya Financial, Inc.	13.400.349	0,31
35.344	EPAM Systems, Inc.	22.481.612	0,53	109.168	Walgreens Boots Alliance, Inc.	5.011.903	0,12
431.350	Equity LifeStyle Properties, Inc.	36.431.821	0,85	324.953	Walmart, Inc.	46.065.337	1,08
28.109	Estee Lauder Cos., Inc. "A"	9.468.236	0,22	545.092	Western Digital Corp.	31.795.216	0,74
	First Industrial Realty Trust, Inc.	21.529.675	0,50		Western Union Co.	17.844.470	0,42
	Ford Motor Co.	48.156.995	1,12		Wyndham Hotels & Resorts, Inc.	6.988.106	0,16
	Fortinet, Inc.	40.431.547	0,94		Zendesk, Inc.	1.426.061	0,03
	Freeport-McMoRan, Inc.	36.998.703	0,86	26.549	Zoetis, Inc.	5.924.144	0,14
	Gartner, Inc.	35.001.239	0,82			2.726.777.624	63,69
	General Motors Co.	19.788.481	0,46	-			
	Gilead Sciences, Inc.	40.220.984	0,94		ONES ORDINARIAS		
	Globe Life, Inc.	5.120.574	0,12	(coste USD 3.626	.253.868)	4.138.527.352	96,66
	HCA Healthcare, Inc.	43.738.514	1,02 0,44	Fondos de inve	rsión – 0,50 %		
	Hologic, Inc.	18.745.287		Irlanda	•		
	HubSpot, Inc. Hyatt Hotels Corp. "A"	37.098.871 1.294.417	0,87 0,03		Goldman Sachs US\$ Treasury		
	Incyte Corp.	3.529.522	0,03	21.440.376	Liquid Reserves Fund (Clase de		
	Intel Corp.	3.610.632	0,08		acciones de distribución X) <sup>(b)(c)</sup>	21.440.578	0,50
	International Business Machines Corp.	3.023.338	0,07		OS DE INVERSIÓN		
43 767	Interpublic Group of Cos., Inc.	1.452.627	0,03	(coste USD 21.44	0.578)	21.440.578	0,50
	Intuit, Inc.	52.050.810	1,22	TOTAL DE VAI O	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS		
	Invitation Homes, Inc.	11.249.323	0,26		N UNA BOLSA DE VALORES		
	IQVIA Holdings, Inc.	37.073.080	0,87	OFICIAL			
	Jefferies Financial Group, Inc.	28.625.619	0,67	(coste USD 3.647	.694.446)	4.159.967.930	97,16

		OO DERIVAD 3.647.694.440			4.15	9.967.930	97,16	Divisa	nuación) Compra	Divies	Venta	Fecha de venci	miento	Plusvalía latente USD	% de
Contrate	os c	le futuros –	0.06 %					EUR	1.390.757		1.988.653		2/2021	26.128	0,0
			•		Compromiso			EUR	1.688.016		1.419.665		2/2021	24.904	0,00
					Valor	Plusvalía		EUR	49.197		172.239		2/2021	1.217	0,00
Número o					de mercado	latente	% del	EUR	76.656		769.988		2/2021	2.200	0,00
contratos	<u> </u>	Descripción (	del valor		USD	USD	patrimonio								
		AUD						EUR	27.363		44.192		2/2021	948	0,00
	14	Futuros sobr		Larga	1.812.595	6.708	0,00	EUR	446.787		4.510.276		2/2021	8.097	0,00
		200 16/ 12/2	021					EUR	123.246		189.686		2/2021	1.279	0,00
		CAD						EUR JPY	29.584.042 7.992.785		33.499.993 62.258		2/2021	191.485	0,00
	13	Futuros sobr	e el	Larga	2.586.053	127.417	0,00	SGD	64.006		64.884		2/2021 2/2021	113 446	0,00
		S&P TSX 60	Index					SGD	110.881		103.040		2/2021	587	0,00
		16/12/2021						SGD	134.718		73.558		2/2021	460	0,00
		EUR						SGD	3.918		8.924		2/2021	33	0,00
2	237	Futuros sobr	e el Euro	Larga	11.022.785	53.875	0,00	SGD	6.113		39.896		2/2021	73	0,00
		STOXX 50 Ir		3			.,	SGD	2.184		2.290		2/2021	36	0,00
		17/12/2021						SGD	35.628		233.695		2/2021	178	0,00
		GBP						USD	4.742		6.570		2/2021	35	0,00
	42	Futuros sobr 100 Index 17		Larga	3.971.178	13.683	0,00	PLUS	/ALÍA LATE	NTE S	OBRE CONTRA	ATOS DE DIVISA E COBERTURA		277.534	0,00
		USD							ZO OLLLD	1,7,000	OOK TINES D	L GODERTORA		211.004	
2	206	Futuros sobr	e el	Larga	47.696.725	2.703.259	0,07							Plusvalía	
		E-Mini S&P 5	500 Index					Divisa	Compra	Divies	Venta	Fecha de venci	miento	latente USD	% de patrimonio
		17/12/2021						AUD	56.765		52.011		2/2021	(74)	(0,00)
PLUSVA	LÍA	LATENTE SO	BRE CON	ITRATO	S DE	2.904.942	0,07	AUD	43.994		29.558		2/2021	(782)	(0,00)
<b>FUTURO</b>	S						ŕ	AUD	179.931		115.081		2/2021	(2.157)	(0,00)
								AUD	69.563		37.445		2/2021	(2.137)	(0,00)
					Compromiso			AUD	112.495		9.282.135		2/2021	(1.879)	(0,00)
N/					Valor	Plusvalía	0/ -1-1	AUD	16.522		106.891		2/2021	(30)	(0,00)
Número o contratos		Descripción (	del valor		de mercado USD	latente USD	% del patrimonio	AUD	4.556		4.495		2/2021	(32)	(0,00)
	_	HKD					patrimonio	AUD	1.215.896		881.295		2/2021	(10.230)	(0,00)
	0	Futuros sobr	۰ ما	Lorgo	1 204 541	(20 520)	(0.00)	CAD	26.542		18.481		2/2021	(258)	(0,00)
	0	Hang Seng I		Larga	1.204.541	(28.529)	(0,00)	EUR	1.190.248		1.247.215		2/2021	(7.358)	(0,00)
		30/12/2021	IIIUUX					EUR	2.779.806		358.160.491		2/2021	(16.434)	(0,00)
		JPY						GBP	7.072		8.329		2/2021	(33)	(0,00)
	32	Futuros sobr	e el	Larga	5.388.277	(435.382)	(0,01)	SEK	104.353		10.222		2/2021	(56)	(0,00)
		TOPIX Index		Ü		,	, ,	SGD	94.931		64.623		2/2021	(1.011)	(0,00)
		09/12/2021						SGD	341.625		221.945		2/2021	(2.279)	(0,00)
MINUSV	ΔΙ ίΔ	LATENTE S	OBRE CO	NTRAT	OS DE	(463.911)	(0,01)	SGD	220.675		18.469.782		2/2021	(2.301)	(0,00)
FUTURO		· LAILINI L	OBINE OU		00 52	(400.011)	(0,01)	SGD	2.359.808		1.735.766		2/2021	(5.546)	(0,00)
	_							USD	432.101		383.691		2/2021	(4.861)	(0,00)
Contrate	os c	le divisas a	plazo - 0	,00 %				USD	13.288		18.152		2/2021	(21)	(0,00)
						Plusvalía								(= .)	(0,00)
Divisa	C	nes Divisa	Vanta	Faa	ha de vencimien	latente	% del				SOBRE CONTR ON FINES DE	RATOS DE DIVIS COBERTURA	AS A	(55.554)	(0,00)
		ipra Divisa 134 EUR	Venta 612.000	rec	02/12/20		patrimonio (0,00)					OOBLINION		(00.004)	(0,00)
				NTRAT	OS DE DIVISAS	(/	(0,00)		R DE MERC SIONES	ADO D	E LAS				
CONTRA			OBILE GO		OO DE DIVIOA	(6.230)	(0,00)	(coste	USD 3.647	694.44	6)		4.16	32.624.711	97,22
Contrato	s de	e divisas a p	lazo espec	cíficos o	le una clase de	acciones - 0.0	00 %	OTRO	S ACTIVOS	Y PAS	IVOS		11	8.871.120	2,78
						Plusvalía	/-	PATRI	MONIO				4.28	1.495.831	100,00
	_					latente	% del	-						V-1	
Divisa	Со	mpra Divisa	Ven	ta F	echa de vencimi	ento USD	patrimonio							Valor de mercado	% de
AUD		1.814 ILS	4.08	32	23/12/2	2021 1	0,00	TOTAL	DE INVER	SIONE	S			USD	
AUD	- :	2.835 NOK	18.24	18	23/12/2	2021 14	0,00	T-4-1:		1	ale aleas alea				
AUD		1.012 NZD	1.04		23/12/2	2021 9	0,00		iversiones e e USD 3.647		ido derivados		4 15	9.967.930	97,16
CHF		3.050 AUD	4.53		23/12/2	2021 81	0,00				ntratos de futur	ns		2.904.942	0,07
CHF		5.283 CAD	7.20		23/12/2		0,00				contratos de futu			(463.911)	(0,01
CHF	48	3.396 EUR	46.21	16	23/12/2	2021 251	0,00				contratos de div			(6.230)	(0,01
CHF	(	6.413 GBP	5.14		23/12/2		0,00				ntratos de divis			(0.230)	(0,00
CHF		187 ILS	62		23/12/2		0,00		ados con fin			ao a piazu		277.534	0,00
CHF	10	0.510 JPY	1.291.92		23/12/2		0,00				contratos de div	sas a plazo			0,00
CHF		291 NOK	2.79		23/12/2		0,00		ados con fin			a p.azo		(55.554)	(0,00
CHF		104 NZD	16		23/12/2		0,00		activos y pas				11	8.871.120	2,78
CHF		1.696 SEK	16.34		23/12/2		0,00	Patrim						1.495.831	100,00
CHF		468 SGD	68		23/12/2		0,00	rauili	IOIIIO				<b>4.</b> ∠0	1.433.037	100,00
CHF	112	2.347 USD	121.41	13	23/12/2	1.331	0,00								

### Goldman Sachs Funds—Global CORE® Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Credit Suisse International, Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., State Street Bank & Trust y UBS AG.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,07 %.

- (a) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (b) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- (c) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Internet	10,55
Software	9,01
Ordenadores	7,08
Fabricantes de automóviles	5,61
Semiconductores	4,90
Transportes	4,58
Servicios financieros diversos	4,40
Productos farmacéuticos	4,21
Atención sanitaria – Servicios	3,56
Seguros	3,34
Otros	39,42
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	96,66
Fondos de inversión	0,50
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	0,07
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(0,01)
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	(0,00)
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	0,00
Minusvalia latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	(0,00)
Otros activos y pasivos	2,78
TOTAL	100,00

## Goldman Sachs Funds—Global Small Cap CORE® Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones or	iliarios admitidos a cotizad linarias – 98,99 %	ción en una bolsa de valore	s oficial	Francia – (cor	•		
Australia				93.6	23 Coface S.A.	1.275.152	0,18
	46 APN Industria REIT	78.288	0,01		662 Covivio	1.893.722	0,26
	884 Ardent Leisure Group Ltd.		0,12		70 Derichebourg S.A.	424.933	0,06
	63 Centuria Industrial REIT	1.145.105	0,16		552 Ipsen S.A.	252.107	0,04
186.4	02 Charter Hall Social Infrast		0.07		01 IPSOS	1.256.233	0,18
02.0	REIT	500.094	0,07		76 Jacquet Metals SACA	269.362	0,04
	34 Emeco Holdings Ltd.	56.474	0,01		88 Manitou BF S.A.	363.733	0,05
	39 Iluka Resources Ltd.	1.139.584	0,16 0,03		26 Mersen S.A.	170.544	0,02
	96 Myer Holdings Ltd. 316 PWR Holdings Ltd.	235.931 61.462	0,03		74 Nexans S.A.	355.993	0,05
	39 Sandfire Resources Ltd.	304.768	0,04		81 Quadient S.A. 82 Rexel S.A.	252.480 4.082.402	0,04
70.0	os candine resources Eta.	304.700	0,04		70 Rothschild & Co.	1.464.230	0,57 0,20
		4.381.942	0,61		44 Trigano S.A.	61.492	0,20
Bélgica					180 Virbac S.A.	936.098	0,01
-	684 Bekaert S.A.	1.782.339	0,25	1.5	ou viibac S.A.	930.090	
	666 Econocom Group S.A.	245.378	0,03			16.204.771	2,27
	84 EVS Broadcast Equipmen		0,10	Alemania			
	521 Gimv NV	638.072	0,09		17 Allgeier S.E.	86.523	0,01
1.9	113 Intervest Offices & Wareh	ouses NV 59.642	0,01		62 Amadeus Fire AG	1.489.006	0,21
	21 Ion Beam Applications	426.479	0,06		05 DIC Asset AG	512.842	0,07
	92 Melexis NV	165.675	0,02		01 DWS Group GmbH & Co. KGaA		-,
302.8	343 X-Fab Silicon Foundries S	S.E. 144A <sup>(a)</sup> 3.280.497	0,46		144A <sup>(a)</sup>	253.753	0,03
		7.320.657	1.00	28.1	86 Elmos Semiconductor S.E.	1.425.576	0,20
		7.320.037	1,02		18 Gerresheimer AG	3.810.461	0,53
Bermudas					73 Hamborner REIT AG	836.623	0,12
36.1	58 Argo Group International I				79 Hugo Boss AG	69.733	0,01
	Ltd.	1.985.074	0,28		76 Kloeckner & Co. S.E.	1.422.348	0,20
Canadá					57 METRO AG	123.240	0,02
130.6	319 Artis Real Estate Investme	ent Trust 1.167.127	0,16		556 Rheinmetall AG	49.561	0,01
	99 Canadian Western Bank	2.359.588	0,33	175.4	21 SUESS MicroTec S.E.	4.271.502	0,60
104.1	00 CI Financial Corp.	2.325.018	0,33			14.351.168	2,01
70.6	600 Copper Mountain Mining (	Corp. 201.248	0,03	Hong Kong			
125.8	00 Dundee Precious Metals,	Inc. 806.846	0,11		00 ASM Pacific Technology Ltd.	456.151	0,06
7.3	41 Essa Pharma, Inc.	95.286	0,01		00 Fortune Real Estate Investment Trust		0,06
36.5	89 Hardwoods Distribution, Ir	nc. 1.195.994	0,17		00 VSTECS Holdings Ltd.	367.640	0,05
44.0	25 IMAX Corp.	730.815	0,10		<b>3</b>		
18.0	000 Interfor Corp.	444.309	0,06			1.228.127	0,17
631.3	149 International Petroleum Co	orp. 3.141.444	0,44	Irlanda			
71.3	00 Karora Resources, Inc.	238.421	0,03	26.1	90 Alkermes Plc.	589.537	0,08
7.2	00 Linamar Corp.	420.966	0,06	283.3	34 Bank of Ireland Group Plc.	1.545.224	0,22
4.7	'00 Minto Apartment Real Est			90.9	44 Perrigo Co., Plc.	3.365.837	0,47
	Investment Trust 144A <sup>(a)</sup>	81.232	0,01			5.500.598	0,77
	00 New Gold, Inc.	213.368	0,03				
	000 Superior Plus Corp.	1.159.826	0,16	Italia			
	200 Tamarack Valley Energy L		0,43		80 ACEA SpA	343.035	0,05
	65 Topaz Energy Corp.	1.004.023 5.900.510	0,14 0,83		'53 Aquafil SpA	634.399 672.424	0,09 0,09
	162 Uni-Select, Inc.		-		33 Banca Farmafactoring SpA 144A <sup>(a)</sup>		0,09
	Western Forest Products,		0,06		32 Banca IFIS SpA 68 Biesse SpA	86.833 618.919	0,01
119.8	Zymeworks, Inc.	2.391.466	0,33		92 OVS SpA 144A <sup>(a)</sup>	2.186.373	0,09
		27.335.936	3,82		08 Reply SpA	837.238	0,12
Dinamarca		,		7.0			
	16 Chemometec A/S	3.223.996	0,45			5.379.221	0,75
	37 DFDS A/S	288.449	0,04	Japón			
	65 Huscompagniet A/S	60.443	0,01		00 Advanced Media, Inc.	335.923	0,05
	506 Solar A/S "B"	4.211.997	0,59	13.0	00 Aisan Industry Co., Ltd.	87.594	0,01
	· · · · · · -			14.3	00 Arisawa Manufacturing Co., Ltd.	117.145	0,02
		7.784.885	1,09		00 Aval Data Corp.	90.230	0,01
Finlandia					00 Avex, Inc.	162.270	0,02
	25 F-Secure OYJ	77.284	0,01		00 CAC Holdings Corp.	241.583	0,03
	64 TietoEVRY OYJ	680.542	0,10		00 Central Glass Co., Ltd.	646.831	0,09
	19 Tokmanni Group Corp.	1.277.902	0,18		00 Citizen Watch Co., Ltd.	1.124.096	0,16
	15 Uponor OYJ	223.404	0,03		00 Daido Steel Co., Ltd.	48.482	0,01
	•				00 Daishinku Corp.	93.065	0,01
		2.259.132	0,32		00 Digital Garage, Inc.	318.354	0,04
Francia					00 DTS Corp.	461.147	0,06
22.2	91 Arkema S.A.	2.953.618	0,41		600 Eagle Industry Co., Ltd.	274.485	0,04
2.1	207 Aubay	192.672	0,03	23.0	00 Eco's Co., Ltd.	356.761	0,05

## Goldman Sachs Funds—Global Small Cap CORE® Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	arias – (continuación)				arias – (continuación)		
Japón – (continu	•			Japón – (continu	•		
	Eizo Corp.	830.026	0,12		Roland DG Corp.	1.478.974	0,21
	Elematec Corp.	203.547	0,03		Round One Corp.	992.595	0,14
	Enplas Corp.	53.550	0,01		S Foods, Inc.	96.070	0,01
	Ferrotec Holdings Corp.	2.952.589	0,41		Samty Residential Investment Corp.	82.403	0,01
	France Bed Holdings Co., Ltd.	191.990	0,03		Sankyo Tateyama, Inc.	456.814 410.053	0,06 0,06
	Fujibo Holdings, Inc. Furuno Electric Co., Ltd.	46.797 277.436	0,01 0,04		Sato Holdings Corp. Sawada Holdings Co., Ltd.	64.322	0,00
	Furuya Metal Co., Ltd.	1.205.840	0,04		Shindengen Electric Manufacturing	04.322	0,01
	Futaba Corp.	847.396	0,17	37.300	Co., Ltd.	1.123.663	0,16
	Gakujo Co., Ltd.	318.624	0,04	12.900	Shin-Etsu Polymer Co., Ltd.	108.885	0,02
	Global One Real Estate Investment	010.024	0,04		Sintokogio Ltd.	868.705	0,12
	Corp.	960.086	0,13	18.700	SKY Perfect JSAT Holdings, Inc.	67.234	0,01
14.500	Goldcrest Co., Ltd.	191.881	0,03	144.400	Sodick Co., Ltd.	982.050	0,14
75.800	Gunma Bank Ltd.	221.477	0,03	49.500	Sparx Group Co., Ltd.	136.752	0,02
14.600	Hakuto Co., Ltd.	288.121	0,04		SRA Holdings	1.616.387	0,23
9.200	Hanwa Co., Ltd.	249.300	0,03		Star Asia Investment Corp.	1.365.396	0,19
85.200	Hoosiers Holdings	476.110	0,07		Star Micronics Co., Ltd.	197.064	0,03
29.100	Ichigo, Inc.	336.240	0,05		Starts Corp., Inc.	771.555	0,11
	Ichiyoshi Securities Co., Ltd.	150.047	0,02		Sumitomo Densetsu Co., Ltd.	398.919	0,06
	Inabata & Co., Ltd.	716.076	0,10		Sumitomo Seika Chemicals Co., Ltd.	448.786	0,06
	Inui Global Logistics Co., Ltd.	2.075.673	0,29		Sumitomo Warehouse Co., Ltd.	489.650 2.079.380	0,07
	I-PEX, Inc.	251.335	0,03		Sun Frontier Fudousan Co., Ltd. Taihei Dengyo Kaisha Ltd.	314.879	0,29 0,04
	Itfor, Inc.	288.133	0,04		Takara Leben Real Estate Investment	314.079	0,04
	J Front Retailing Co., Ltd.	48.444	0,01	304	Corp.	527.556	0,07
	Japan Investment Adviser Co., Ltd.	104.169	0,01	42.100	Takashimaya Co., Ltd.	369.146	0,05
	JBCC Holdings, Inc.	984.156	0,14		Tokyo Kiraboshi Financial Group, Inc.	77.720	0,01
	JP-Holdings, Inc. JVCKenwood Corp.	170.935 1.206.623	0,02 0,17		Tokyo Seimitsu Co., Ltd.	6.237.202	0,87
	Kaga Electronics Co., Ltd.	1.179.806	0,17	2.100	Tomoe Engineering Co., Ltd.	42.559	0,01
	Kanematsu Corp.	1.113.869	0,16	57.200	Tosei Corp.	489.136	0,07
	Kitagawa Corp.	259.777	0,10	21.700	Towa Corp.	618.358	0,09
	Komori Corp.	1.060.160	0,15	14.000	Toyo Construction Co., Ltd.	64.978	0,01
	Krosaki Harima Corp.	533.564	0,07		TSI Holdings Co., Ltd.	90.618	0,01
	Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co., Ltd.	99.256	0,01		TV Asahi Holdings Corp.	580.326	0,08
	Lintec Corp.	513.184	0,07		Ulvac, Inc.	144.194	0,02
	Macnica Fuji Electronics Holdings,		-,-		Ushio, Inc.	415.635	0,06
	Inc.	380.662	0,05		V Technology Co., Ltd.	128.457	0,02
6.300	Makino Milling Machine Co., Ltd.	192.128	0,03		Valqua Ltd.	84.477	0,01
31.300	Marvelous, Inc.	199.160	0,03		VT Holdings Co., Ltd.	108.260	0,01 0,22
25.800	Matsuda Sangyo Co., Ltd.	617.485	0,09		Yamaichi Electronics Co., Ltd. Yellow Hat Ltd.	1.584.823 681.474	0,22
12.600	Meisei Industrial Co., Ltd.	72.862	0,01		ZIGExN Co., Ltd.	839.412	0,10
15.500	Mimasu Semiconductor Industry			300.300		000.412	0,12
7.000	Co., Ltd.	321.948	0,04			69.040.241	9,66
	Mitsubishi Research Institute, Inc.	240.206	0,03	Luxemburgo			
	Mitsubishi Shokuhin Co., Ltd.	881.592	0,12	_	Sword Group	205.726	0,03
	Mitsui Matsushima Holdings Co., Ltd.	360.806	0,05		Gword Group	203.720	0,00
	Mizuno Corp. Nachi-Fujikoshi Corp.	552.124 269.758	0,08 0,04	Países Bajos			
	Nippon Chemical Industrial Co., Ltd.	1.006.723	0,04	35.951	BE Semiconductor Industries NV	3.454.176	0,48
	Nippon Piston Ring Co., Ltd.	222.609	0,14	48.570	Brunel International NV	575.865	0,08
	NIPPON REIT Investment Corp.	1.578.373	0,03	3.206	Flow Traders 144A <sup>(a)</sup>	113.597	0,02
	Nippon Seisen Co., Ltd.	575.823	0,08	5.624	Merus NV	144.256	0,02
	Nippon Shokubai Co., Ltd.	85.118	0,01	14.599	NSI NV	574.757	0,08
	Nippon Steel Trading Corp.	69.290	0,01	106.505	OCI NV	2.927.873	0,41
	Nippon Systemware Co., Ltd.	1.006.985	0,14	38.486	Ordina NV	150.861	0,02
	Nippon Thompson Co., Ltd.	216.907	0,03	17.165	Randstad NV	1.089.841	0,15
	Nisso Corp.	44.505	0,01	28.029	Signify NV 144A <sup>(a)</sup>	1.300.589	0,18
	Nitto Kogyo Corp.	214.804	0,03	53.824	uniQure NV	1.532.907	0,22
	Noritake Co., Ltd.	135.426	0,02	127.460	Van Lanschot Kempen NV	2.994.879	0,42
	NS United Kaiun Kaisha Ltd.	1.947.041	0,27		· -	44.050.004	0.00
	Ohara, Inc.	930.801	0,13			14.859.601	2,08
	OKUMA Corp.	268.780	0,04	Noruega			
	Onoken Co., Ltd.	364.460	0,05		Atea ASA	1.892.484	0,27
935	Ooedo Onsen Reit Investment Corp.	621.837	0,09		B2Holding ASA	137.849	0,02
58.800	Optex Group Co., Ltd.	774.233	0,11		Hunter Group ASA	51.526	0,01
42.100	Paramount Bed Holdings Co., Ltd.	720.453	0,10		Kid ASA 144A <sup>(a)</sup>	2.960.241	0,41
	Qol Holdings Co., Ltd.	713.037	0,10		Odfjell Drilling Ltd.	368.603	0,05
	Quick Co., Ltd.	351.398	0,05				-,
	Riken Corp.	658.277	0,09				
2.400	Rion Co., Ltd.	45.580	0,01				

Tenencias	:	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del
Accione:		arias – (continuación) nuación)				inarias – (continuación) (continuación)		
	6.948	Pareto Bank ASA	45.771	0,01	274.2	43 SThree Plc.	1.927.132	0,27
	557.973	Wallenius Wilhelmsen ASA	2.595.194	0,36	2.9	69 Stolt-Nielsen Ltd.	40.364	0,01
		_	0.054.660	1 12	52.9	03 Trinity Mirror Plc.	181.637	0,03
			8.051.668	1,13	182.8	81 Vivo Energy Plc. 144A <sup>(a)</sup>	322.014	0,05
Portugal	145.091	Sonae SGPS S.A.	156.425	0,02			11.870.646	1,66
Puerto Ri	ico			<u> </u>	Estados Unido			
		First BanCorp	6.546.075	0,92		54 A10 Networks, Inc.	186.243	
		Thot Bandorp	0.040.070			16 AECOM	6.453.248	0,90
Singapur						86 Alcoa Corp.	2.764.943	0,39
+ 8	882.397	BW Energy Ltd.	2.053.039	0,29	+ 33.6	79 AMC Entertainment Holdings, Inc. "A"	1.199.309	0,17
España					7.2	88 AMERCO	5.202.029	
;	396.708	Acerinox S.A.	4.498.597	0,63	17.7	43 American Eagle Outfitters, Inc.	463.625	
:	219.454	Bankinter S.A.	1.086.720	0,15	216.2	07 American Equity Investment Life		
	108.972	Cia de Distribucion Integral Logista				Holding Co.	7.147.803	1,00
	146.00-	Holdings S.A.	2.043.419	0,29		84 American Homes 4 Rent "A"	7.596.239	1,06
	146.037	Global Dominion Access S.A. 144A <sup>(a)</sup>	733.633	0,10		49 AMN Healthcare Services, Inc.	240.020	0,03
	23 961	Indra Sistemas S.A.	280.819	0,10		37 Anaplan, Inc.	302.828 394.595	0,04 0,06
		Laboratorios Farmaceuticos Rovi	200.019	0,04		23 AnaptysBio, Inc. 56 AngioDynamics, Inc.	1.095.260	0,06
	0.201	S.A.	236.604	0,03		10 ANI Pharmaceuticals, Inc.	390.139	
	62.317	Mediaset Espana Comunicacion				42 Annaly Capital Management, Inc.	130.220	0,02
		S.A.	299.371	0,04		47 Appian Corp.	323.621	0,05
	10.282	Solarpack Corp. Tecnologica S.A.	308.279	0,05	18.3	83 Argan, Inc.	725.945	
		<del>-</del>	9.487.442	1,33	56.6	00 Argonaut Gold, Inc.	159.568	0,02
			0.101112	.,00	64.2	92 Atkore, Inc.	6.955.109	0,97
Suecia	45.000	A : AD #D#	000.077	0.00		32 AutoNation, Inc.	6.195.054	0,87
		Arjo AB "B"	203.877	0,03		97 Avis Budget Group, Inc.	553.924	0,08
		Beijer Alma AB	186.825 355.263	0,03 0,05		75 Axalta Coating Systems Ltd.	3.937.254	0,55
		Biotage AB Bonava AB	164.611	0,03		35 Bancorp, Inc. 95 BCB Bancorp, Inc.	146.758 210.851	0,02 0,03
		Ferronordic AB	4.112.035	0,57		91 BioCryst Pharmaceuticals, Inc.	282.608	
		Mekonomen AB	358.536	0,05		28 Bloom Energy Corp. "A"	246.234	0,03
		New Wave Group AB "B"	2.022.835	0,28		99 Boyd Gaming Corp.	3.549.684	0,50
	17.174	Nordic Waterproofing Holding AB	422.888	0,06		25 Brixmor Property Group, Inc.	140.691	0,02
		_	7.826.870	1,09	48.5	82 BRP Group, Inc. "A"	1.756.725	0,25
			7.020.070	1,09		04 Bruker Corp.	3.777.004	0,53
Suiza						53 Buckle, Inc.	6.315.592	
		Bachem Holding AG "B"	2.407.222	0,34		20 Build-A-Bear Workshop, Inc.	1.160.280	0,16
		Bobst Group S.A.	161.606	0,02		94 Builders FirstSource, Inc. 33 C3.ai, Inc. "A"	1.065.335 151.617	0,15 0,02
		Comet Holding AG Huber & Suhner AG	205.772 490.468	0,03 0,07		65 Cambridge Bancorp	210.390	0,02
		LEM Holding S.A.	537.118	0,07		75 Camden Property Trust	7.584.134	1,06
		Metall Zug AG "B"	335.939	0,05		70 Cars.com, Inc.	96.305	0,01
		Tecan Group AG	6.120.919	0,85		40 Cato Corp. "A"	450.016	
+		u-blox Holding AG	302.880	0,04	27.8	93 CF Industries Holdings, Inc.	1.755.585	0,25
	7.733	Zehnder Group AG	762.325	0,11		02 ChampionX Corp.	206.141	0,03
		_	11.324.249	1 50	78.2	86 ChannelAdvisor Corp.	1.985.333	0,28
			11.324.249	1,58		96 Choice Hotels International, Inc.	202.308	0,03
Reino Un						28 Cinemark Holdings, Inc.	4.657.399	
		Cairn Energy Plc.	151.357	0,02		42 Clover Health Investments Corp. 92 Coca-Cola Consolidated, Inc.	415.365 1.771.438	
		Clarkson Plc.	1.382.310	0,19		65 Cogent Communications Holdings,	1.771.430	0,20
		CMC Markets Plc. 144A <sup>(a)</sup>	167.886	0,02	00.0	Inc.	4.410.037	0,62
		Euromoney Institutional Investor Plc. Halfords Group Plc.	59.928 525.967	0,01 0,07	60.5	75 Cohu, Inc.	2.066.819	
		IG Group Holdings Plc.	101.994	0,01	145.1	53 Community Health Systems, Inc.	1.795.543	0,25
:		Man Group Plc.	682.672	0,10	15.7	60 Computer Programs and Systems,		
		Michael Kors Holdings Ltd.	504.968	0,07	25.5	Inc.	467.284	- 1 -
	50.083	Morgan Crucible Co. Plc.	241.205	0,03		43 Conduent, Inc.	188.711	0,03
		NewRiver REIT Plc.	176.592	0,02		62 Covetrus, Inc. 87 CTS Corp.	2.412.697 2.573.887	0,34 0,36
		nVent Electric Plc.	2.262.256	0,32		76 CVB Financial Corp.	2.573.867	
2		Paragon Banking Group Plc.	1.438.957	0,20		91 Daily Journal Corp.	110.693	
		Regional REIT Ltd. 144A <sup>(a)</sup>	116.993	0,02		89 Darling Ingredients, Inc.	1.043.234	0,15
		Safestore Holdings Plc. Senior Plc.	862.089 95.651	0,12 0,01		54 DHI Group, Inc.	122.253	
		Spectris Plc.	95.651 86.003	0,01		00 Diamondback Energy, Inc.	888.246	
:		Speedy Hire Plc.	324.511	0,01		06 Dick's Sporting Goods, Inc.	5.114.322	
		Standard Life Investment Property	32	0,00		74 Dime Community Bancshares, Inc.	338.481	0,05
		Income Trust Ltd.	218.160	0,03		44 DMC Global, Inc.	465.406	
					60.7	32 Dolby Laboratories, Inc. "A"	5.987.887	0,84

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	arias – (continuación)				arias – (continuación)		
Estados Unidos	•			Estados Unidos	•		
	Domo, Inc. "B"	2.435.375	0,34		Manhattan Associates, Inc.	5.521.839	0,77
	Dropbox, Inc. "A"	1.994.988	0,28		ManpowerGroup, Inc.	4.429.844	0,62
	DXC Technology Co.	5.168.570	0,72		Marcus Corp.	1.422.903	0,20
	Dynatrace, Inc.	1.531.225	0,21		Marriott Vacations Worldwide Corp.	6.120.403	0,86
	Dynavax Technologies Corp.	559.030	0,08		Marten Transport Ltd.	5.630.007	0,79
	Editas Medicine, Inc.	88.535	0,01		MasTec, Inc.	7.503.360	1,05
	eGain Corp.	49.544	0,01		Matador Resources Co.	3.178.709	0,44
	Encore Wire Corp.	432.213	0,06		McGrath RentCorp	107.822	0,02
	! Energizer Holdings, Inc.	195.273	0,03		Medpace Holdings, Inc.	5.214.966	0,73
	Ennis, Inc.	2.071.326	0,29		Merchants Bancorp	934.541	0,13
	Envista Holdings Corp.	3.676.882	0,51		MFA Financial, Inc.	3.594.696	0,50
	Equity LifeStyle Properties, Inc.	7.709.847	1,08		Mimecast Ltd.	434.709	0,06
	Evercore, Inc. "A"	6.913.153	0,97		Moelis & Co. "A"	4.856.624	0,68
	Fair Isaac Corp.	6.227.580	0,87		Molina Healthcare, Inc.	7.748.998	1,08
28.238	First Business Financial Services,				Mosaic Co.	1.242.772	0,17
	Inc.	799.418	0,11		MRC Global, Inc.	1.621.137	0,23
	First Industrial Realty Trust, Inc.	7.583.173	1,06		Murphy USA, Inc.	1.165.916	0,16
	FirstCash, Inc.	470.768	0,07		Myriad Genetics, Inc.	125.444	0,02
	FNB Corp.	3.700.209	0,52		NanoString Technologies, Inc.	1.830.173	0,26
	Funko, Inc. "A"	727.555	0,10		National Bankshares, Inc.	36.948	0,01
	GameStop Corp. "A"	669.409	0,09		National Storage Affiliates Trust	6.672.727	0,93
	Genworth Financial, Inc. "A"	1.616.674	0,23		Natus Medical, Inc.	316.791	0,04
	Global Blood Therapeutics, Inc.	62.377	0,01		Neogen Corp.	80.491	0,01
	Globe Life, Inc.	878.510	0,12		NetApp, Inc.	82.697	0,01
	Goosehead Insurance, Inc. "A"	3.232.232	0,45		NetScout Systems, Inc.	2.511.724	0,35
	Groupon, Inc.	681.791	0,10	5.087	New York Times Co. "A"	239.801	0,03
	H&E Equipment Services, Inc.	1.177.539	0,16		News Corp. "A"	4.330.194	0,61
	Halozyme Therapeutics, Inc.	967.599	0,14		NexPoint Residential Trust, Inc.	7.644.044	1,07
	Harley-Davidson, Inc.	3.319.427	0,46	40.900	Nexstar Media Group, Inc. "A"	6.245.839	0,87
	Hayward Holdings, Inc.	269.205	0,04		NextGen Healthcare, Inc.	70.449	0,01
37.328	Heidrick & Struggles International,				NRG Energy, Inc.	4.255.108	0,60
	Inc.	1.579.721	0,22	2.373	Oil-Dri Corporation of America	80.492	0,01
	Heritage-Crystal Clean, Inc.	150.582	0,02	19.979	Old Republic International Corp.	487.488	0,07
	Heska Corp.	1.586.556	0,22	108.508	ON Semiconductor Corp.	6.907.619	0,97
	Highwoods Properties, Inc.	879.934	0,12	71.529	Oppenheimer Holdings, Inc. "A"	3.577.881	0,50
	Home Bancorp, Inc.	138.597	0,02	11.727	Organogenesis Holdings, Inc.	117.035	0,02
	HomeStreet, Inc.	651.716	0,09		Origin Bancorp, Inc.	1.164.794	0,16
	Hurco Cos., Inc.	279.402	0,04	144.265	Ovintiv, Inc.	5.079.571	0,71
	Hyatt Hotels Corp. "A"	1.137.694	0,16	72.110	PacWest Bancorp	3.255.045	0,46
	is I3 Verticals, Inc. "A"	334.556	0,05		Patterson Cos., Inc.	6.014.111	0,84
	Infinera Corp.	345.973	0,05	38.899	Perficient, Inc.	5.370.007	0,75
	Information Services Group, Inc.	362.111	0,05	83.782	Phibro Animal Health Corp. "A"	1.703.288	0,24
	InfuSystem Holdings, Inc.	84.301	0,01	23.991	Piedmont Lithium, Inc.	1.454.334	0,20
	Ingles Markets, Inc. "A"	3.419.872	0,48		Pieris Pharmaceuticals, Inc.	280.631	0,04
	Innospec, Inc.	1.092.895	0,15	95.262	Precision BioSciences, Inc.	847.832	0,12
	Installed Building Products, Inc.	342.120	0,05	26.920	Prestige Consumer Healthcare, Inc.	1.486.522	0,21
	International Bancshares Corp.	833.041	0,12	6.620	Primoris Services Corp.	153.584	0,02
	Iovance Biotherapeutics, Inc.	573.461	0,08	10.429	ProPetro Holding Corp.	84.996	0,01
	Iridium Communications, Inc.	2.567.319	0,36		PulteGroup, Inc.	503.890	0,07
	Jefferies Financial Group, Inc.	2.820.968	0,39	23.708	Pzena Investment Management,		
	Joint Corp.	2.870.987	0,40		Inc. "A"	233.050	0,03
	Jounce Therapeutics, Inc.	79.469	0,01		Quad Via Graphics, Inc.	58.931	0,01
	! KB Home	3.085.374	0,43		QuinStreet, Inc.	123.636	0,02
	Kennametal, Inc.	94.264	0,01		Red Rock Resorts, Inc. "A"	5.879.899	0,82
35.472	! Knight-Swift Transportation Holdings,	0.000.570	0.00		Regional Management Corp.	740.683	0,10
04.440	Inc.	2.038.576	0,29		Reinsurance Group of America, Inc.	4.466.131	0,62
	Kohl's Corp.	1.770.205	0,25		Reliance Worldwide Corp., Ltd.	419.596	0,06
	Korn Ferry	6.831.975	0,96		Ruth's Hospitality Group, Inc.	294.277	0,04
	Kronos Bio, Inc.	167.883	0,02		Ryder System, Inc.	611.897	0,09
	Ladder Capital Corp.	1.427.968	0,20		Sage Therapeutics, Inc.	343.112	0,05
	Lamar Advertising Co. "A"	182.529	0,03		Sanderson Farms, Inc.	4.595.606	0,64
	Landstar System, Inc.	1.363.938	0,19		Sarepta Therapeutics, Inc.	265.067	0,04
	Latham Group, Inc.	146.096	0,02		SeaWorld Entertainment, Inc.	4.997.487	0,70
	LeMaitre Vascular, Inc.	96.618	0,01	13.070	SEI Investments Co.	791.258	0,11
	Lennox International, Inc.	6.539.821	0,92	101.017	Selecta Biosciences, Inc.	298.000	0,04
	Levi Strauss & Co. "A"	810.650	0,11	66.589	Sharps Compliance Corp.	506.742	0,07
	LGI Homes, Inc.	954.850	0,13	38.556	Shenandoah Telecommunications		
	Liberty TripAdvisor Holdings, Inc. "A"	171.834	0,02		Co.	990.118	0,14
53.485	Louisiana-Pacific Corp.	3.567.984	0,50	27.116	Shutterstock, Inc.	3.138.677	0,44
993	M/I Homes, Inc.	57.078	0,01	2.658	SiteOne Landscape Supply, Inc.	653.735	0,09
	Macatawa Bank Corp.	88.091	0,01	00.000	Skechers USA, Inc. "A"	1.783.782	0,25

Tenencias	Descripción del valor		Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	arias - (continuación)			
	- (continuación)		570 445	2.00
	SM Energy Co. SmileDirectClub, Inc.		570.445 338.876	0,08 0,05
	Snap-on, Inc.		204.637	0,03
	Solid Biosciences, Inc.		104.663	0,01
	SPS Commerce, Inc.		203.345	0,03
3.527	St Joe Co.		174.728	0,02
	Stewart Information Services	Corp.	7.227.029	1,01
	Super Micro Computer, Inc.		56.935	0,01
	Syneos Health, Inc.		2.485.217	0,35
	Tenet Healthcare Corp. Terex Corp.		1.343.148 269.940	0,19 0,04
	Texas Roadhouse, Inc.		6.229.320	0,04
	Thryv Holdings, Inc.		844.504	0,12
	Tilly's, Inc. "A"		1.753.030	0,25
	Titan Machinery, Inc.		2.086.349	0,29
33.488	Towne Bank Via Portsmouth	VA	1.028.751	0,14
	Travel & Leisure Co.		4.928.300	0,69
	Tri Pointe Homes, Inc.		1.529.344	0,21
	TrueCar, Inc.		294.313	0,04
	TrustCo Bank Corp. NY		114.650	0,02
	Twist Bioscience Corp.	no	803.742 1.025.257	0,11
	<ul> <li>Ultragenyx Pharmaceutical, I United Bankshares, Inc.</li> </ul>	nc.	82.584	0,14 0,01
	Universal Health Services. In	c "B"	379.354	0,01
	Universal Logistics Holdings,		50.221	0,01
	Upland Software, Inc.		549.481	0,08
	Utah Medical Products, Inc.		126.984	0,02
102.555	Vanda Pharmaceuticals, Inc.		1.714.720	0,24
54.955	Varex Imaging Corp.		1.588.199	0,22
	Vectrus, Inc.		433.007	0,06
	Viatris, Inc.		851.030	0,12
	Victory Capital Holdings, Inc.	"A"	104.640	0,01
	Vir Biotechnology, Inc. Virtus Investment Partners, I	20	509.206 4.803.500	0,07 0,67
	Vishay Intertechnology, Inc.	IC.	7.169.265	1,00
	Voya Financial, Inc.		6.701.801	0,94
	Warrior Met Coal, Inc.		330.252	0,05
291.856	Western Union Co.		4.684.289	0,66
21.812	Westlake Chemical Corp.		2.092.643	0,29
	Weyco Group, Inc.		57.837	0,01
	Workiva, Inc.		350.955	0,05
	Wyndham Hotels & Resorts,	Inc.	3.478.758	0,49
	Zedge, Inc. "B"		190.858	0,03
	Zendesk, Inc.		1.790.583 174.452	0,25
20.560	Zix Corp.	_		0,02
·			472.248.167	66,09
TOTAL DE ACCI (coste USD 683.	ONES ORDINARIAS		707.401.660	98,99
-	RES MOBILIARIOS ADMITID	0S A		
	UNA BOLSA DE VALORES		707.401.660	98,99
	CADO DE LAS INVERSIONES	3		
(coste USD 683.			707.401.660	98,99
Contratos de fu	ıturos – (0,00 %)	Valor do		
		Valor de mercado		
Número de D	escripción a	de la signación	Minusvalía latente	% del
	el valor	USD	en USD	patrimonio
E	UR			
E	uturos sobre el Larga Euro STOXX 50 ndex 17/12/2021	93.019	(910)	(0,00)

		)	ntinuación	turos – (coi	os de fut	Contra
		Valor de mercado				
% de patrimonio	Minusvalía latente en USD	de la asignación USD		escripción I valor		Número contrato
			1	SD	US	
(0,00	(5.232)	444.940	Larga I	ituros sobre Mini-Russell 00 Index 7/12/2021	el 20	
(0,00)	(6.142)	TOS DE	RE CONTRA	ENTE SOBF		MINUS\ FUTUR
			zo – 0,00 %	/isas a plaz	os de div	Contra
% de patrimonio	Plusvalía latente en USD	Fecha de vencimiento	Venta	Divisa	Compra	Divisa
0,00	1.028	02/12/2021	113.895	USD	101.000	EUR
		OS DE	E CONTRAT	NTE SOBRE		
0,00	1.028			· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	A PLAZO	DIVISAS
% de patrimonio	Minusvalía latente en USD	Fecha de vencimiento	Venta	Divisa	Compra	Divisa
(0,00)	(5.631)	02/12/2021	744.000	AUD 1.	1.243.421	USD
		TOS	RE CONTRA	ENTE SOBF		
(0,00)	(5.631)				SAS A PL	
98,99	707.390.915		S INVERSIO	ADO DE LA 31.022)	DE MERC SD 683.13	
1,01	7.201.662		;	Y PASIVOS	ACTIVOS	OTROS
100,00	714.592.577				OINC	PATRIM
	Valor de					
% de patrimonio	mercado en USD			SIONES	E INVER	TOTAL
			erivados	xcluyendo de	ersiones e	Total inv
98,99	707.401.660			,	JSD 683.1	,
(0,00)	(6.142) 1.028			sobre contra		
0,00	(5.631)	•		obre contrato sobre contra		
1,01	7.201.662	p.uu			tivos y pas	
100,00	714.592.577				nio	Patrimo

El Comisionista de futuros fue Credit Suisse Securities (USA) LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Bank of America N.A. y JP Morgan Chase Bank N.A.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,00 %.

- Una parte de estos valores estaba cedida en préstamo a 30 de noviembre de 2021.
   Consulte la Nota 6.
- (a) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Fondo de inversión inmobiliaria	8,87
Venta al por menor	6,18
Servicios financieros diversos	5,56
Seguros	5,15
Servicios comerciales	5,05
Electrónica	4,83
Bancos	3,83
Atención sanitaria – Productos	3,74
Semiconductores	3,54
Entretenimiento	3,44
Otros	48,80
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	98,99
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(0,00)
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	0,00
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	(0,00)
Otros activos y pasivos	1,01
TOTAL	100,00

Tenencias		Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
		os admitidos a cotización en u ias – 99,03 %	na bolsa de valo	res oficial	Acciones ordina Estados Unidos -	arias – (continuación) - (continuación)		
Bermudas						DR Horton, Inc.	6.439.202	0,32
227.	.207 A	Arch Capital Group Ltd.	9.317.759	0,47		Dynatrace, Inc.	1.982.927	0,10
Internals		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·				eBay, Inc.	6.464.512	0,32
Irlanda	274 4	Accepture Die "A"	26 696 424	4.24		EOG Resources, Inc.	2.400.103	0,12
		Accenture Plc. "A"  Medtronic Plc.	26.686.124 801.477	1,34 0,04		EPAM Systems, Inc.	9.995.997	0,50
		Perrigo Co., Plc.	1.689.950	0,04		Equitable Holdings, Inc. Equity LifeStyle Properties, Inc.	1.014.534 14.315.294	0,05 0,72
70.	.002 1	errigo co., r ic.	1.003.330			First Industrial Realty Trust, Inc.	15.203.989	0,72
			29.177.551	1,46		Ford Motor Co.	18.446.075	0,70
Países Bajos	;					Fortinet, Inc.	18.165.277	0,91
-		NXP Semiconductors NV	1.161.406	0,06		Freeport-McMoRan, Inc.	17.720.056	0,89
					50.570	Gartner, Inc.	16.285.563	0,82
Suiza		2	17 700 000	0.00	180.714	General Motors Co.	10.687.426	0,54
97.	.260 C	Chubb Ltd.	17.702.293	0,89	277.537	Gilead Sciences, Inc.	19.619.091	0,98
Reino Unido					84.429	Globe Life, Inc.	7.382.472	0,37
363.	.148 L	iberty Global Plc. "C"	9.884.889	0,50		HCA Healthcare, Inc.	17.340.463	0,87
46.	743 L	inde Plc.	14.965.706	0,75		Hess Corp.	1.660.245	0,08
			24.850.595	1,25		Hilton Worldwide Holdings, Inc.	11.273.139	0,57
			24.030.080	1,23		Home Depot, Inc.	1.881.598	0,09
Estados Unid						HubSpot, Inc.	15.652.302	0,79
		AbbVie, Inc.	25.215.473	1,27		Hyatt Hotels Corp. "A" Incyte Corp.	242.458 828.228	0,01 0,04
		Air Products and Chemicals, Inc.	17.900.715	0,90		Incyte Corp. Intel Corp.	828.228 18.628.497	0,04
		Airbnb, Inc. "A"	10.456.445	0,52		Interactive Brokers Group, Inc. "A"	970.657	0,93
		Alcoa Corp.	1.986.653	0,10		International Business Machines	310.031	0,03
		Align Technology, Inc.	14.349.485	0,72	40.024	Corp.	5.421.453	0,27
		Ally Financial, Inc.	4.996.884	0,25	5.758	International Flavors & Fragrances,		
		Alphabet, Inc. "A"	40.914.138	2,05		Inc.	839.171	0,04
		Alphabet, Inc. "C" Amazon.com, Inc.	60.518.037 58.725.664	3,04 2,95	36.921	Intuit, Inc.	24.983.333	1,25
		AMERCO	6.942.938	0,35		Invitation Homes, Inc.	10.694.633	0,54
		American Electric Power Co., Inc.	16.980.735	0,85		IQVIA Holdings, Inc.	17.429.149	0,87
		American Homes 4 Rent "A"	15.379.906	0,77		Johnson & Johnson	27.167.228	1,36
		Amgen, Inc.	11.189.523	0,56		JP Morgan Chase & Co.	5.068.278	0,25
		Annaly Capital Management, Inc.	5.716.062	0,29		KeyCorp Knight-Swift Transportation	15.464.862	0,78
		Anthem, Inc.	18.465.485	0,93	32.122	Holdings, Inc.	1.846.051	0,09
51.	.708 A	APA Corp.	1.349.579	0,07	32.079	Lennox International, Inc.	10.346.761	0,52
670.	.433 A	Apple, Inc.	108.724.120	5,45		LKQ Corp.	10.532.394	0,53
50.	.047 A	Applied Materials, Inc.	7.601.138	0,38		Marathon Oil Corp.	3.825.890	0,19
257.	.444 A	Archer-Daniels-Midland Co.	16.203.525	0,81	5.235	Marriott Vacations Worldwide Corp.	804.305	0,04
23.	.944 A	Arista Networks, Inc.	2.995.394	0,15	115.668	Marsh & McLennan Cos., Inc.	19.230.962	0,96
		AutoNation, Inc.	3.558.638	0,18	35.165	MasTec, Inc.	3.363.532	0,17
		Berkshire Hathaway, Inc. "B"	6.778.921	0,34		McKesson Corp.	3.823.620	0,19
		Biogen, Inc.	8.082.941	0,41		Meta Platforms, Inc. "A"	55.712.237	2,80
		Booking Holdings, Inc.	2.379.242	0,12		MetLife, Inc.	4.016.641	0,20
		Boston Scientific Corp.	7.868.161	0,39		Mettler-Toledo International, Inc.	17.088.128	0,86
		Boyd Gaming Corp.	1.589.676	0,08		Microsoft Corp.	107.822.400 2.974.840	5,41
		Bristol-Myers Squibb Co.	6.000.633 25.237.989	0,30 1,27		Moderna, Inc. Molina Healthcare, Inc.		0,15 0,33
		Broadcom, Inc. Bruker Corp.	1.074.138	0.05		Mondelez International. Inc. "A"	6.514.954 7.500.628	0,33
		Camden Property Trust	8.236.732	0,05		MongoDB, Inc.	3.093.436	0,36
		Capital One Financial Corp.	17.294.386	0,41		Monster Beverage Corp.	8.623.478	0,10
		Caterpillar, Inc.	19.811.275	0,99		NetApp, Inc.	6.072.967	0,30
		Cerner Corp.	13.242.018	0,66		News Corp. "A"	2.453.243	0,12
		CF Industries Holdings, Inc.	6.025.687	0,30		NextEra Energy, Inc.	24.295.433	1,22
		Charles Schwab Corp.	2.511.159	0,13		Norfolk Southern Corp.	18.055.903	0,91
		Charter Communications, Inc. "A"	14.203.264	0,71		NRG Energy, Inc.	7.623.204	0,38
58.	.870 C	Cigna Corp.	11.406.063	0,57	123.964	NVIDIA Corp.	41.265.136	2,07
41.	.642 C	Citigroup, Inc.	2.676.748	0,13		Occidental Petroleum Corp.	1.324.097	0,07
267.	.713 C	Citizens Financial Group, Inc.	12.769.910	0,64		Okta, Inc.	5.390.745	0,27
		CMS Energy Corp.	4.513.292	0,23		Omnicom Group, Inc.	15.825.480	0,79
213.		Cognizant Technology Solutions				O'Reilly Automotive, Inc.	17.239.724	0,87
		Corp. "A"	16.969.893	0,85		Otis Worldwide Corp.	9.135.904	0,46
		CSX Corp.	18.791.197	0,94		PacWest Bancorp	1.057.134	0,05
		Danaher Corp.	8.324.128	0,42		Palo Alto Networks, Inc.	15.643.177	0,79
		Darling Ingredients, Inc.	1.498.418	0,08		Parker-Hannifin Corp.	9.944.155	0,50
		Dentsply Sirona, Inc.	1.668.182	0,08		PayPal Holdings, Inc. PepsiCo, Inc.	23.999.944	1,20 0,25
		Diamondback Energy, Inc.	558.937	0,03		Philip Morris International, Inc.	4.896.555 12.620.519	0,25
		Dick's Sporting Goods, Inc. DocuSign, Inc.	11.272.179	0,57		Pioneer Natural Resources Co.	8.511.388	0,63
		•	15.820.970	0,79		PulteGroup, Inc.	3.654.326	0,43
299.	.+∪∪ L	Dow, Inc.	16.727.478	0,84	70.013	. a.tooroup, mo.	0.004.020	0,10

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	inarias – (continuación)		
	s – (continuación)	4 0 4 7 5 7 7	0.00
	97 Raymond James Financial, Inc.	4.317.577	0,22
	39 Regions Financial Corp.	2.377.638 905.868	0,12
	Reinsurance Group of America, Inc. Republic Services, Inc.	3.306.099	0,05 0,17
	89 S&P Global, Inc.	21.007.462	1,05
	64 Sempra Energy	2.332.762	0,12
	22 ServiceNow, Inc.	21.859.045	1,10
	16 SiteOne Landscape Supply, Inc.	840.165	0,04
	41 Stanley Black & Decker, Inc.	11.082.113	0,56
341.5	92 Synchrony Financial	15.781.550	0,79
61.1	00 T Rowe Price Group, Inc.	12.574.991	0,63
15.2	21 Teleflex, Inc.	4.690.503	0,24
42.2	73 Tesla, Inc.	49.290.318	2,47
122.8	24 Texas Instruments, Inc.	23.895.409	1,20
	34 Thermo Fisher Scientific, Inc.	3.185.094	0,16
106.8	30 Travelers Cos., Inc.	15.991.386	0,80
	94 Ulta Beauty, Inc.	4.673.390	0,23
	26 Union Pacific Corp.	19.010.665	0,95
	68 United Rentals, Inc.	1.184.627	0,06
	58 UnitedHealth Group, Inc.	30.532.899	1,53
	13 VeriSign, Inc.	15.306.933	0,77
	29 Vertex Pharmaceuticals, Inc.	6.376.582	0,32
	93 Viatris, Inc.	1.982.747	0,10
	28 Visa, Inc. "A" 36 VMware, Inc. "A"	16.038.288	0,80 0,78
	01 Voya Financial, Inc.	15.528.895 570.709	0,78
	57 Vulcan Materials Co.	226.772	0,03
	96 Walmart, Inc.	17.705.257	0,89
	28 Western Digital Corp.	13.773.346	0,69
	40 Weyerhaeuser Co.	1.883.352	0,09
	13 Wyndham Hotels & Resorts, Inc.	1.807.930	0,09
	54 Zoetis, Inc.	525.272	0,03
		4 004 067 204	
OTAL DE AC	CIONES ORDINARIAS	1.891.867.301	94,90
coste USD 1.6		1.974.076.905	99,03
A COTIZACIÓ! OFICIAL	ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS I EN UNA BOLSA DE VALORES		
coste USD 1.6	-	1.974.076.905	99,03
COSTE USD 1.6		1.974.076.905	99,03
Contratos de	futuros – (0,00 %)		
	Valor mercado	r de O de Minusvalía	
lúmero de	la asignad		% de
ontratos De	escripción del valor en L	JSD en USD	patrimonio
19 Fu	SD turos sobre el Mini S&P 500 Index		
	/12/2021 Larga 4.399.2	213 (39.390)	(0,00)
MINUSVALÍA I DE FUTUROS	ATENTE SOBRE CONTRATOS	(39.390)	(0,00)
Contratos de	divisas a plazo específicos de una		ies – 0,03 %
Divisa C	Fech ompra Divisa Venta vencimio		% de
EUR 96.9	59.987 USD 109.788.610 23/12/2	021 633.261	0,03
	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE AZO CELEBRADOS CON FINES DE	633.261	0,03

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase o	de acciones -
(continuación)	

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% de
DIVIOU	Оопри	Diviou	Vonta	Venennento		patimome
USD	1.362.077	EUR	1.202.694	23/12/2021	(7.598)	(0,00)
			E CONTRATO			
COBERT		LLLDIVAL	,00 0011 1111	.0 02	(7.598)	(0,00)
VALOR D	DE MERCADO	O DE LAS	8			
(coste U	SD 1.689.090	0.320)		1.9	974.663.178	99,06
OTROS A	ACTIVOS Y F	PASIVOS			18.777.448	0,94
PATRIMO	ONIO			1.9	993.440.626	100,00
					Valor de	0/ -1-
TOTAL D	E INVERSIO	NES			mercado en USD	% del
Total inve	rsiones exclu	ıyendo de	rivados			
(coste US	SD 1.689.090	.320)		1.9	974.076.905	99,03
Minusvalí	a latente sob	re contrat	os de futuros		(39.390)	(0,00)
			s de divisas a p	olazo		
	os con fines d				633.261	0,03
			os de divisas a	plazo		
	os con fines d		ra		(7.598)	(0,00)
Otros acti	ivos y pasivo	S			18.777.448	0,94
Patrimon	nio			1.	993.440.626	100,00
Patrimon	iio			1.	993.440.626	

El Comisionista de futuros fue Bank of America N.A.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Credit Suisse International, State Street Bank & Trust y UBS AG.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,03 %.

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Internet	13,63
Software	11,04
Ordenadores	10,31
Semiconductores	5,91
Atención sanitaria – Servicios	4,53
Seguros	4,16
Fabricantes de automóviles	3,94
Productos farmacéuticos	3,90
Servicios financieros diversos	3,74
Fondo de inversión inmobiliaria	3,58
Otros	34,29
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	99,03
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(0,00)
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	0,03
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	(0,00)
Otros activos y pasivos	0,94
TOTAL	100,00

Tenencias		Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones	ordina	ios admitidos a cotización en una rias – 98,27 %	a bolsa de valo	res oficial	Estados Unidos -	•		
Bermudas					41.296	American Equity Investment Life	1.365.246	0,72
	22.218	Argo Group International Holdings Ltd.	1.219.768	0,64	2 845	Holding Co. American National Bankshares, Inc.	103.444	0,72
	13 628	Triton International Ltd.	771.209	0,40		Ameris Bancorp	82.869	0,04
	10.020	Then memational Etc.				AMERISAFE, Inc.	401.243	0,21
			1.990.977	1,04	30.632	Amicus Therapeutics, Inc.	335.727	0,18
Canadá						AMN Healthcare Services, Inc.	725.917	0,38
	38.775	IMAX Corp.	643.665	0,34		Amneal Pharmaceuticals, Inc.	218.378	0,11
		Novagold Resources, Inc.	471.468	0,24		Amphastar Pharmaceuticals, Inc. AnaptysBio, Inc.	1.032.307 360.584	0,54 0,19
	39.689	Uranium Energy Corp.	166.694	0,09		AngioDynamics, Inc.	404.073	0,13
			1.281.827	0,67		ANI Pharmaceuticals, Inc.	471.359	0,25
Francia					19.407	Antares Pharma, Inc.	62.685	0,03
Francia	12 703	Constellium S.E.	218.746	0,11	37.537	Antero Resources Corp.	673.038	0,35
	12.703	Constellatin C.E.	210.740	0,11		Appian Corp.	424.358	0,22
Alemania						Apple Hospitality REIT, Inc.	396.620	0,21
	37.225	Affimed NV	256.852	0,13		Applied Molecular Transport, Inc. Apria, Inc.	27.251 27.729	0,01 0,01
Irlanda						Archest Corp.	76.611	0,01
		Alkermes Plc.	396.086	0,21		Arcus Biosciences, Inc.	97.742	0,05
		Cimpress Plc.	155.194	0,08		Ardelyx, Inc.	10.628	0,01
	617	Prothena Corp., Plc.	30.350	0,02	9.929	Arena Pharmaceuticals, Inc.	540.932	0,28
			581.630	0,31	7.760	Argan, Inc.	306.442	0,16
la and all						Arrowhead Pharmaceuticals, Inc.	252.404	0,13
Israel	1 000	IFrom I tel	61 124	0.02		Arvinas, Inc.	268.752	0,14
		JFrog Ltd.	61.134	0,03		Asana, Inc. Asbury Automotive Group, Inc.	129.698 27.237	0,07 0,01
	11.854	Sapiens International Corp., NV	428.167	0,23		ASGN, Inc.	164.549	0,01
			489.301	0,26		Assetmark FinancialHoldings, Inc.	99.507	0,05
Luxembur	700					Associated Capital Group, Inc. "A"	48.741	0,03
Luxellibul	-	Orion Engineered Carbons S.A.	28.098	0,01	498	Astec Industries, Inc.	31.743	0,02
	1.001	Chon Engineered Carbons C.A.	20.030	0,01		Atkore, Inc.	1.545.784	0,81
Mónaco						Atlantic Union Bankshares Corp.	742.137	0,39
	115.880	Safe Bulkers, Inc.	431.074	0,23		Atlas Air Worldwide Holdings, Inc.	192.484	0,10
Puerto Ric	co				4.971 11 175	Avanos Medical, Inc. Aveanna Healthcare Holdings, Inc.	151.963 76.772	0,08 0,04
	91.886	First BanCorp	1.233.110	0,65		Avid Bioservices, Inc.	176.594	0,09
	11.045	OFG Bancorp	265.522	0,14		Avid Technology, Inc.	143.532	0,08
			1.498.632	0,79		Avidity Biosciences, Inc.	29.438	0,02
Singapur				<u> </u>		Avis Budget Group, Inc.	890.016	0,47
ogupu.	9.285	Kulicke & Soffa Industries, Inc.	544.658	0,29		Axcelis Technologies, Inc.	753.946	0,40
<del></del>						B&G Foods, Inc.	23.945 618.586	0,01 0,32
Reino Uni		LiveNeve Dle	267 100	0.14	8.778	Barrett Business Services, Inc.	634.649	0,32
		LivaNova Plc.	267.109	0,14		Beam Therapeutics, Inc.	84.178	0,04
	2.699	Tronox Holdings Plc. "A"	61.159	0,03		Beazer Homes USA, Inc.	117.095	0,06
			328.268	0,17	1.994	Bed Bath & Beyond, Inc.	40.259	0,02
Estados U	Inidos					Belden, Inc.	323.573	0,17
	1.610	1-800-Flowers.com, Inc. "A"	50.280	0,03		Berkeley Lights, Inc.	49.210	0,03
		1st Source Corp.	361.935	0,19		Berkshire Hills Bancorp, Inc. BigCommerceHoldings, Inc.	69.150 39.270	0,04
		3D Systems Corp.	222.810	0,12		Biglari Holdings, Inc. "B"	39.270 22.147	0,02 0,01
		A10 Networks, Inc.	228.169	0,12		BioCryst Pharmaceuticals, Inc.	230.045	0,12
		AAR Corp.	58.692	0,03		Bloom Energy Corp. "A"	353.962	0,19
		Aaron's Co., Inc.	30.607	0,02		Bloomin' Brands, Inc.	531.561	0,28
		Academy Sports & Outdoors, Inc.	482.057	0,25		Boise Cascade Co.	409.057	0,21
		Accolade, Inc. ACI Worldwide, Inc.	18.407 242.278	0,01 0,13		Boot Barn Holdings, Inc.	469.983	0,25
		Acushnet Holdings Corp.	828.178	0,13		Box, Inc. "A" Bridgebio Pharma, Inc.	790.904	0,41
		AdvanSix, Inc.	223.684	0,43		Bridgewater Bancshares, Inc.	185.952 33.726	0,10 0,02
		Aeglea BioTherapeutics, Inc.	20.350	0,01		Brightcove, Inc.	31.723	0,02
		Albany International Corp. "A"	45.865	0,02		Brightsphere Investment Group, Inc.	146.721	0,02
		Allakos, Inc.	13.515	0,01		BrightView Holdings, Inc.	33.870	0,02
	8.543	Allogene Therapeutics, Inc.	154.116	0,08	569	Brink's Co.	34.646	0,02
	2.415	Allovir, Inc.	42.021	0,02	25.139	Brookdale Senior Living, Inc.	156.113	0,08
		A-Mark Precious Metals, Inc.	271.747	0,14		BRP Group, Inc. "A"	810.997	0,43
		Ambarella, Inc.	717.798	0,38		Buckle, Inc.	1.298.454	0,68
+	34.370	AMC Entertainment Holdings, Inc.	4 000 040	0.04		Business First Bancshares, Inc.	105.050	0,06
	11 260	"A"  American Assets Trust Inc.	1.223.916	0,64		Byline Bancorp, Inc.	420.862	0,22
	11.200	American Assets Trust, Inc.	390.159	0,20		Cambium Networks Corp.	108.631	0,06
	31 977	American Eagle Outfitters, Inc.	835.559	0,44	2 275	Cambridge Bancorp	255.760	0,13

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	arias – (continuación)				rias – (continuación)		
Estados Unidos	Camden National Corp.	80.995	0,04	Estados Unidos –	Dynex Capital, Inc.	791.734	0,42
	4 Capital Bancorp, Inc.	42.261	0,04		E2open ParentHoldings, Inc.	377.461	0,42
	9 Capital City Bank Group, Inc.	36.177	0,02		Eagle Bulk Shipping, Inc.	258.371	0,20
	2 Cardiff Oncology, Inc.	112.530	0,06		Eagle Pharmaceuticals, Inc.	443.126	0,23
	7 CareDx, Inc.	219.053	0,11		Earthstone Energy, Inc. "A"	139.605	0,07
	7 Cargurus, Inc.	232.266	0,12		EastGroup Properties, Inc.	145.713	0,08
	Cars.com, Inc.	538.929	0,28	20.307	Editas Medicine, Inc.	664.648	0,35
35	4 Casella Waste Systems, Inc. "A"	30.713	0,02		eGain Corp.	137.975	0,07
35.77	9 Castlight Health, Inc. "B"	55.279	0,03		Eiger BioPharmaceuticals, Inc.	119.254	0,06
33.04	3 Cato Corp. "A"	543.888	0,29		Emergent BioSolutions, Inc.	92.166	0,05
	2 CBIZ, Inc.	131.082	0,07		Encore Wire Corp.	747.348	0,39
	2 Celsius Holdings, Inc.	112.586	0,06		Energizer Holdings, Inc.	226.557	0,12
35.36	6 Centennial Resource Development, Inc. "A"	214 040	0.11		Energy Fuels, Inc.	64.155 17.410	0,03
13 35	9 Central Pacific Financial Corp.	214.848 358.689	0,11 0,19		EnerSys Ennis, Inc.	570.757	0,01 0,30
	B Century Aluminum Co.	49.024	0,03		Eventbrite, Inc. "A"	169.146	0,09
	Century Communities, Inc.	120.649	0,06		Everi Holdings, Inc.	133.162	0,03
	5 Cerence, Inc.	294.988	0,15		Evoqua Water Technologies Corp.	226.853	0,12
	5 ChampionX Corp.	327.184	0,17		EW Scripps Co. "A"	571.570	0,30
	9 ChannelAdvisor Corp.	919.021	0,48		ExlService Holdings, Inc.	273.403	0,14
	6 Chefs' Warehouse, Inc.	27.331	0,01	3.138	Exponent, Inc.	365.891	0,19
2.67	4 ChemoCentryx, Inc.	99.152	0,05	23.609	Extreme Networks, Inc.	318.722	0,17
19.29	9 Chico's FAS, Inc.	102.864	0,05	14.335	FB Financial Corp.	614.255	0,32
54.89	9 Cinemark Holdings, Inc.	860.816	0,45	1.031	Financial Institutions, Inc.	31.404	0,02
81	5 CIRCOR International, Inc.	23.570	0,01		First Bancorp, Inc.	103.115	0,05
	9 Clearfield, Inc.	193.163	0,10		First Bank Via Hamilton NJ	92.310	0,05
	1 Coca-Cola Consolidated, Inc.	481.817	0,25		First Commonwealth Financial Corp.	411.187	0,22
	6 Codexis, Inc.	212.927	0,11		First Financial Bancorp	266.781	0,14
16.17	6 Cogent Communications Holdings,	1 220 567	0.64		First Internet Bancorp FirstCash, Inc.	524.621 497.683	0,27 0,26
32 15	Inc. Cohu, Inc.	1.228.567 1.096.958	0,64 0,57		Focus Financial Partners, Inc. "A"	202.962	0,20
	6 Collegium Pharmaceutical, Inc.	165.466	0,09		Forestar Group, Inc.	103.791	0,05
	2 Columbia Banking System, Inc.	511.504	0,27		FormFactor, Inc.	491.956	0,26
	2 Community Bank System, Inc.	123.323	0,06		Forrester Research, Inc.	414.446	0,22
	1 Community Health Systems, Inc.	493.575	0,26		Franklin Covey Co.	70.140	0,04
	2 Community Trust Bancorp, Inc.	91.078	0,05	3.763	Franklin Electric Co., Inc.	341.003	0,18
	9 CommVault Systems, Inc.	489.755	0,26	2.223	Frequency Therapeutics, Inc.	11.982	0,01
10.53	2 Computer Programs and Systems,			304	Fulgent Genetics, Inc.	29.944	0,02
	Inc.	312.274	0,16		Fulton Financial Corp.	118.966	0,06
	2 Conduent, Inc.	210.439	0,11		Funko, Inc. "A"	317.729	0,17
6.69	1 Convey Health Solutions Holdings,	40 457	0.00		FutureFuel Corp.	31.820	0,02
2.44	Inc.  6 Corporate Office Properties Trust	43.157 62.373	0,02 0,03		Genco Shipping & Trading Ltd.	167.834	0,09
	6 Cortexyme, Inc.	17.498	0,03		Genworth Financial, Inc. "A" G-III Apparel Group Ltd.	687.041	0,36 0,04
	6 Covetrus, Inc.	596.639	0,31		Global Blood Therapeutics, Inc.	85.278 277.191	0,04
	B CRA International, Inc.	63.086	0,03		Globalstar, Inc.	34.879	0,13
	4 Crawford & Co. "A"	46.032	0,02		GMS, Inc.	74.237	0,04
1.04	Crocs, Inc.	174.699	0,09		Goosehead Insurance, Inc. "A"	1.088.105	0,57
4.64	Cross Country Healthcare, Inc.	124.352	0,07		GoPro, Inc. "A"	308.997	0,16
4.70	5 CryoLife, Inc.	79.985	0,04	37.070	GrafTech International Ltd.	442.616	0,23
33.54	6 CTS Corp.	1.171.762	0,61	5.487	Great Ajax Corp.	70.727	0,04
45.35	6 CVB Financial Corp.	866.753	0,45	20.432	Groupon, Inc.	439.901	0,23
35	4 Daily Journal Corp.	134.658	0,07	2.864	Guaranty Bancshares, Inc.	106.970	0,06
	5 Daktronics, Inc.	98.363	0,05		H&E Equipment Services, Inc.	489.520	0,26
	5 Dave & Buster's Entertainment, Inc.	118.526	0,06		Hackett Group, Inc.	60.748	0,03
	5 Deciphera Pharmaceuticals, Inc.	18.175	0,01		Halozyme Therapeutics, Inc.	1.196.687	0,63
	7 Denali Therapeutics, Inc.	806.536	0,42		Hancock Whitney Corp.	56.531	0,03
	9 Design Therapeutics, Inc.	93.091	0,05		Hanger, Inc.	394.184	0,21
	B Designer Brands, Inc. "A" DiamondRock Hospitality Co.	64.349	0,03		Hanmi Financial Corp.	537.800	0,28
		92.175	0,05		HarborOne Bancorp, Inc.	126.371	0,07
	6 DigitalOcean Holdings, Inc. D Dillard's, Inc. "A"	540.378 210.120	0,28 0,11		Harmonic, Inc. Harvard Bioscience, Inc.	162.948 10.972	0,09 0,01
	Dime Community Bancshares, Inc.	291.723	0,15		Health Catalyst, Inc.	141.233	0,07
	7 Dine Brands Global, Inc.	68.579	0,15		Heartland Express, Inc.	191.416	0,07
	Diodes, Inc.	215.159	0,04		Hecla Mining Co.	203.517	0,10
	7 DMC Global, Inc.	175.294	0,09		Heidrick & Struggles International,	_50.0	5,.1
	Domo, Inc. "B"	781.531	0,41		Inc.	855.583	0,45
	4 Donegal Group, Inc. "A"	108.819	0,06	3.898	Herc Holdings, Inc.	701.757	0,37
	7 Douglas Dynamics, Inc.	103.790	0,05	6.375	Heritage Financial Corp.	147.773	0,08
	B Dycom Industries, Inc.	137.717	0,07		Heritage-Crystal Clean, Inc.	296.715	0,16
20.86	7 Dynavax Technologies Corp.	338.880	0,18	4.235	Heska Corp.	696.276	0,36

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	Tenencias		Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ordina	rias – (continuación)			Acciones ord	dinar	ias – (continuación)		
Estados Unidos -		100 750	0.40			(continuación)	4 470 740	0.00
	Hingham Institution For Savings	199.756 406.393	0,10			Matador Resources Co.  Matthews International Corp. "A"	1.176.718 490.693	0,62 0,26
	Home Bancorp, Inc. Home BancShares, Inc.	197.190	0,21 0,10			Maxar Technologies, Inc.	152.739	0,28
	HomeStreet, Inc.	521.751	0,27			MaxCyte, Inc.	61.288	0,03
	HomeTrust Bancshares, Inc.	32.159	0,02			MaxLinear, Inc.	429.136	0,22
	Homology Medicines, Inc.	37.201	0,02			McGrath RentCorp	990.336	0,52
	Hope Bancorp, Inc. Horizon Bancorp, Inc.	321.899 149.749	0,17 0,08			Medpace Holdings, Inc. Merchants Bancorp	1.486.015 752.707	0,78 0,39
	Houlihan Lokey, Inc.	168.420	0,09			Meridian Bioscience, Inc.	50.051	0,03
	Hydrofarm Holdings Group, Inc.	67.208	0,04	8.	.405	Merit Medical Systems, Inc.	540.357	0,28
	I3 Verticals, Inc. "A"	17.061	0,01			Mesa Laboratories, Inc.	247.586	0,13
	Ichor Holdings Ltd. Ideaya Biosciences, Inc.	49.064 88.635	0,03 0,05			MFA Financial, Inc. MicroStrategy, Inc. "A"	765.808 270.408	0,40 0,14
	ImmunoGen, Inc.	79.040	0,03			Mid Penn Bancorp, Inc.	79.481	0,14
	Industrial Logistics Properties Trust	723.135	0,38			MidWestOne Financial Group, Inc.	83.902	0,04
	Infinera Corp.	516.003	0,27		504	Miller Industries, Inc.	16.975	0,01
	InfuSystem Holdings, Inc.	350.399	0,18			Mimecast Ltd.	1.367.471	0,72
	Ingles Markets, Inc. "A" Inhibrx, Inc.	1.277.151 210.482	0,67 0,11			Minerals Technologies, Inc. Moelis & Co. "A"	822.188 1.174.754	0,43 0,62
	Innospec, Inc.	746.291	0,39			Momentive Global, Inc.	37.393	0,02
	Innoviva, Inc.	103.566	0,05			Monarch Casino & Resort, Inc.	744.997	0,39
7.866	Insmed, Inc.	212.697	0,11	6.	.459	Movado Group, Inc.	289.686	0,15
	Inspire Medical Systems, Inc.	464.379	0,24			MRC Global, Inc.	638.235	0,33
	Installed Building Products, Inc. Integer Holdings Corp.	447.056 140.018	0,23 0,07			Mueller Industries, Inc. Murphy Oil Corp.	606.173 106.418	0,32 0,06
	Intellia Therapeutics, Inc.	579.726	0,30			Murphy USA, Inc.	1.151.610	0,60
	International Bancshares Corp.	971.610	0,51			Myriad Genetics, Inc.	379.694	0,20
	International Game Technology Plc.	198.095	0,10		449	Nabors Industries Ltd.	37.348	0,02
	Intra-Cellular Therapies, Inc.	31.045	0,02			NanoString Technologies, Inc.	1.002.804	0,53
	Intrepid Potash, Inc.	34.452	0,02			Nathan's Famous, Inc.	86.274	0,05
	Invacare Corp. Investors Title Co.	101.234 102.933	0,05 0,05	2.	.910	National Energy Services Reunited Corp.	28.596	0,01
	Iridium Communications, Inc.	1.107.731	0,58		309	National HealthCare Corp.	20.215	0,01
619	iRobot Corp.	47.799	0,03			National Storage Affiliates Trust	1.496.106	0,78
	JELD-WEN Holding, Inc.	59.623	0,03			National Western Life Group, Inc. "A"	153.340	0,08
	John Wiley & Sons, Inc. "A"  Joint Corp.	196.933 1.040.873	0,10 0,55			Natus Medical, Inc. Neogen Corp.	799.918 937.573	0,42 0,49
	Jounce Therapeutics, Inc.	252.799	0,13			NetScout Systems, Inc.	1.230.559	0,65
	Kaman Corp.	382.406	0,20			NexPoint Residential Trust, Inc.	1.381.652	0,72
	KB Home	900.990	0,47			NextGen Healthcare, Inc.	361.249	0,19
	Kennametal, Inc.	1.146.858	0,60			Nikola Corp.	78.525	0,04 0,04
	Kforce, Inc. Kinsale Capital Group, Inc.	137.119 1.003.912	0,07 0,53			Nkarta, Inc. Northrim BanCorp, Inc.	74.893 62.192	0,04
	Korn Ferry	1.294.952	0,68			Northwest Natural Holding Co.	178.965	0,09
	Kosmos Energy Ltd.	202.471	0,11	31.	.604	NOW, Inc.	272.110	0,14
	Kronos Bio, Inc.	71.093	0,04			Oceaneering International, Inc.	40.314	0,02
	Kymera Therapeutics, Inc.	107.164	0,06			Oil States International, Inc. Oil-Dri Corporation of America	88.649 146.297	0,05 0,08
	Ladder Capital Corp. Lands' End, Inc.	751.071 89.794	0,39 0,05			Old National Bancorp	109.034	0,06
	Latham Group, Inc.	383.934	0,20			Olema Pharmaceuticals, Inc.	54.987	0,03
3.445	Lattice Semiconductor Corp.	271.156	0,14	11.	.491	OPKO Health, Inc.	47.113	0,02
	LeMaitre Vascular, Inc.	541.006	0,28			Oportun Financial Corp.	28.646	0,02
	LendingClub Corp.	192.925	0,10			Oppenheimer Holdings, Inc. "A" Organogenesis Holdings, Inc.	1.094.338 293.242	0,57 0,15
	LGI Homes, Inc. Liberty TripAdvisor Holdings, Inc. "A"	1.047.397 30.470	0,55 0,02			Origin Bancorp, Inc.	778.379	0,15
	Lions Gate Entertainment Corp. "B"	52.183	0,03			Outfront Media, Inc.	943.162	0,49
7.861	Liquidity Services, Inc.	187.249	0,10			Overstock.com, Inc.	160.490	0,08
	Livent Corp.	232.102	0,12			Ovintiv, Inc.	1.619.801	0,85
	LiveRamp Holdings, Inc.	140.176	0,07			Oxford Industries, Inc. Pain Therapeutics, Inc.	262.402 78.225	0,14 0,04
	M/I Homes, Inc. Macatawa Bank Corp.	669.125 192.745	0,35 0,10			Paramount Group, Inc.	118.567	0,04
	Macerich Co.	177.725	0,09			Patrick Industries, Inc.	252.151	0,13
	MacroGenics, Inc.	36.837	0,02			Patterson Cos., Inc.	1.233.702	0,65
	Macy's, Inc.	557.874	0,29			PC Connection, Inc.	206.694	0,11
	Madrigal Pharmaceuticals, Inc.	37.319	0,02			PDC Energy, Inc.	380.423	0,20
	Magnite, Inc. Magnolia Oil & Gas Corp. "A"	278.015 371.159	0,15 0,19			Peoples Financial Services Corp. Perficient, Inc.	108.836 1.305.815	0,06 0,68
	ManTech International Corp. "A"	240.778	0,13			Personalis, Inc.	39.197	0,02
	Marathon Digital Holdings, Inc.	252.088	0,13			Phibro Animal Health Corp. "A"	859.491	0,45
	Marcus Corp.	453.698	0,24	1.	.037	Phillips Edison & Co, Inc.	32.873	0,02
69.660	Marten Transport Ltd.	1.122.919	0,59					

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ordina	rias – (continuación)			Acciones ordina	rias – (continuación)		
Estados Unidos -	•			Estados Unidos –			
42.540	Piedmont Office Realty Trust, Inc. "A"	749.555	0,39		Tanger Factory Outlet Centers, Inc.	39.679	0,02
13.033	Ping Identity Holding Corp.	312.922	0,39		TechTarget, Inc. Tenable Holdings, Inc.	452.339 725.164	0,24 0,38
	Precision BioSciences, Inc.	508.840	0,27		Tenet Healthcare Corp.	1.074.032	0,56
10.210	Prestige Consumer Healthcare, Inc.	563.796	0,30		Terex Corp.	775.748	0,41
	Primoris Services Corp.	753.165	0,39	15.916	Texas Roadhouse, Inc.	1.327.076	0,70
	Progyny, Inc.	128.473	0,07		Thermon Group Holdings, Inc.	231.361	0,12
	ProPetro Holding Corp.	183.416 107.509	0,10		Thryv Holdings, Inc.	733.123	0,38
	Protagonist Therapeutics, Inc. Pulse Evolution Group, Inc.	88.051	0,06 0,05		Tilly's, Inc. "A"	307.322	0,16
	Puma Biotechnology, Inc.	27.031	0,01		Titan International, Inc. Titan Machinery, Inc.	174.181 894.017	0,09 0,47
	Pzena Investment Management, Inc.		-,- :		Towne Bank Via Portsmouth VA	1.153.198	0,60
	"A"	114.382	0,06		Traeger, Inc.	30.297	0,02
	QCR Holdings, Inc.	70.791	0,04		Travere Therapeutics, Inc.	364.608	0,19
	Qualys, Inc.	597.950	0,31	37.319	Tri Pointe Homes, Inc.	963.577	0,51
	Quanex Building Products Corp.  QuinStreet, Inc.	489.369 331.586	0,26 0,17		TriNet Group, Inc.	23.741	0,01
	R1 RCM, Inc.	44.750	0,17		TrueCar, Inc.	30.169	0,02
	Rackspace Technology, Inc.	91.086	0,05		TrustCo Bank Corp. NY	98.860	0,05
	Range Resources Corp.	813.803	0,43		Trustmark Corp. Turning Point Therapeutics, Inc.	1.024.251 127.460	0,54 0,07
25.989	Red Rock Resorts, Inc. "A"	1.217.845	0,64		Twist Bioscience Corp.	842.542	0,44
	Regional Management Corp.	450.833	0,24		Ultra Clean Holdings, Inc.	181.624	0,10
	Retail Opportunity Investments Corp.	368.999	0,19		UMH Properties, Inc.	53.683	0,03
	Retractable Technologies, Inc.	75.590	0,04	26.627	United Bankshares, Inc.	961.501	0,50
	Revolve Group, Inc. REX American Resources Corp.	224.459 59.113	0,12 0,03		United Community Banks, Inc.	191.424	0,10
	Rigel Pharmaceuticals, Inc.	62.123	0,03		United States Lime & Minerals, Inc.	44.363	0,02
	Riot Blockchain, Inc.	120.531	0,06		Universal Logistics Holdings, Inc.	30.824	0,02
22.344	RLJ Lodging Trust	283.545	0,15		Univest Financial Corp. Upland Software, Inc.	47.586 332.443	0,02 0,17
40.845	RPT Realty	527.717	0,28		Urban Outfitters, Inc.	223.774	0,12
	Rubius Therapeutics, Inc.	93.179	0,05		Urstadt Biddle Properties, Inc. "A"	47.771	0,03
	Rush Enterprises, Inc. "A"	131.265	0,07		US Ecology, Inc.	449.267	0,24
	Ruth's Hospitality Group, Inc. Saia, Inc.	636.048 463.646	0,33 0,24	17.488	US Silica Holdings, Inc.	171.732	0,09
	Sanderson Farms, Inc.	1.213.597	0,64		Utah Medical Products, Inc.	292.152	0,15
	SeaWorld Entertainment, Inc.	1.212.328	0,64		Vanda Pharmaceuticals, Inc.	762.850	0,40
	Select Medical Holdings Corp.	586.457	0,31		Varex Imaging Corp.	708.368	0,37
71.351	Selecta Biosciences, Inc.	210.485	0,11		Varonis Systems, Inc. Vectrus, Inc.	636.628 466.071	0,33 0,24
	Shake Shack, Inc. "A"	85.384	0,04		Veeco Instruments, Inc.	367.569	0,19
	Sharps Compliance Corp.	468.647	0,25		Veracyte, Inc.	147.303	0,08
24.901	Shenandoah Telecommunications Co.	639.458	0,34		Vericel Corp.	115.618	0,06
9.398	Shutterstock, Inc.	1.087.819	0,57	2.117	Verve Therapeutics, Inc.	73.608	0,04
	Sierra Bancorp	86.954	0,05		Vir Biotechnology, Inc.	322.790	0,17
1.075	Signet Jewelers Ltd.	106.339	0,06		Virtus Investment Partners, Inc.	1.297.116	0,68
1.094	Silvergate Capital Corp. "A"	244.378	0,13	60.120	, 0,,	1.245.686 262.103	0,65
	Simulations Plus, Inc.	35.403	0,02		Vishay Precision Group, Inc. Vista Outdoor, Inc.	117.874	0,14 0,06
	SITE Centers Corp.	460.238	0,24		Visita Cutdoor, Inc. Visteon Corp.	34.187	0,02
	SiTime Corp. SM Energy Co.	159.509 544.563	0,08 0,29		W&T Offshore, Inc.	342.388	0,18
	Solid Biosciences, Inc.	49.349	0,29		Warrior Met Coal, Inc.	600.326	0,31
	Sonos, Inc.	49.480	0,03		WD-40 Co.	50.414	0,03
	Sorrento Therapeutics, Inc.	19.521	0,01		Werner Enterprises, Inc.	1.152.542	0,60
9.540	South Plains Financial, Inc.	242.030	0,13		Whitestone REIT	49.526	0,03
	South State Corp.	148.891	0,08		Workiva, Inc.	904.960	0,47
	Southern First Bancshares, Inc.	119.679	0,06		XBiotech, Inc. Xencor, Inc.	61.737 30.745	0,03 0,02
	Spirit of Texas Bancshares, Inc.	112.490	0,06		Yelp, Inc.	132.334	0,02
	SPS Commerce, Inc. STAG Industrial, Inc.	786.191 801.635	0,41 0,42		Y-mAbs Therapeutics, Inc.	10.920	0,01
	Stem, Inc.	44.892	0,02		Zentalis Pharmaceuticals LLC	139.586	0,07
	Sterling Construction Co., Inc.	416.265	0,22		Zix Corp.	38.581	0,02
	Steven Madden Ltd.	1.071.054	0,56	32.430	Zuora, Inc. "A"	647.627	0,34
	Stewart Information Services Corp.	1.318.848	0,69			179.821.951	94,26
	Stitch Fix, Inc. "A"	227.870	0,12	TOTAL DE ACCIO	NEC ODDINADIAC		
	Summit Materials, Inc. "A"	774.048	0,41	(coste USD 176.47	NES ORDINARIAS 72.114)	187.472.014	98,27
	SunCoke Energy, Inc. Sunnova Energy International, Inc.	294.203 270.461	0,15 0,14	(555.5 552 176.47			
	Super Micro Computer, Inc.	748.727	0,14				
	Surgery Partners, Inc.	204.987	0,39				
	Surmodics, Inc.	592.228	0,31				
	Sutro Biopharma, Inc.	213.026	0,11				

Tenencias		Descripción del valor			Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	invers	sión – 0,24 %				
Irlanda	00 000	0-14 0	110¢ T			
4	66.960	Goldman Sachs Liquid Reserves				
		acciones de dis			466.960	0,24
TOTAL DE	FONDO	S DE INVERSIÓ	N			
(coste USD	466.96	0)			466.960	0,24
		ES MOBILIARIO I UNA BOLSA D				
(coste USD	176.93	9.074)			187.938.974	98,51
VALOR DE	MERCA	ADO DE LAS IN	VERSION	IES		
EXCLUYEN					187.938.974	00 54
(coste USD	176.93	9.074)			107.930.974	98,51
Contratos	de futi	uros – (0,09 %)				
				Valor de		
				mercado de la	Minuovalio	
Número de				asignación	Minusvalía latente	% del
contratos	Descri	pción del valor		en USD	en USD	patrimonio
21	Mini-R	s sobre el lussell 2000 17/12/2021	Larga	2.335.935	(181.007)	(0,09)
MINUSVAL FUTUROS	ÍA LATE	ENTE SOBRE CO	ONTRATO	OS DE	(181.007)	(0,09)
VALOR DE (coste USD		ADO DE LAS IN 9.074)	VERSION	IES	187.757.967	98,42
OTROS AC	TIVOS	Y PASIVOS			3.020.112	1,58
PATRIMON	10				190.778.079	100,00
-						
					Valor de mercado en	% del
TOTAL DE	INVERS	SIONES			USD	patrimonio
Total inversi		cluyendo deriva	dos (coste	USD	187.938.974	98,51
Minusvalía I	atente s	sobre contratos d	e futuros		(181.007)	(0,09)
Otros activo	s y pas	ivos			3.020.112	1,58
Patrimonio					190.778.079	100,00

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Bancos	9,73
Biotecnología	6,56
Fondo de inversión inmobiliaria	6,14
Servicios comerciales	5,69
Venta al por menor	5,33
Internet	5,03
Atención sanitaria – Productos	4,89
Software	4,87
Seguros	4,36
Productos farmacéuticos	3,74
Otros	41,93
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	98,27
Fondos de inversión	0,24
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(0,09)
Otros activos y pasivos	1,58
TOTAL	100,00

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,00 %.

Una parte de estos valores estaba cedida en préstamo a 30 de noviembre de 2021. Consulte la Nota 6.

<sup>(</sup>a) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

 $<sup>^{\</sup>rm (b)}\,$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 era del 0,028 %.

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - 89,43	arios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial %					
Australia	NOIO II-Idia aa Pta IAd (c)	HOD	40 500 0/	00/00/0004	4 040 400	0.40
	NCIG Holdings Pty Ltd. <sup>(c)</sup>	USD	12,500 %	26/08/2031 12/05/2031	1.616.400	0,40
310.000	Newcastle Coal Infrastructure Group Pty Ltd.	USD	4,700 %	12/05/2031	1.923.061	0,08
Bermudas					1.020.001	
950.000	China Oil & Gas Group Ltd.	USD	5,500 %	25/01/2023	957.125	0,24
1.630.000	China Oil & Gas Group Ltd.	USD	4,700 %	30/06/2026	1.635.179	0,41
1.630.000	Li & Fung Ltd.	USD	5,250 %	Perp.	1.131.905	0,28
					3.724.209	0,93
Islas Vírgenes E	Británicas CAS Capital No 1 Ltd. <sup>(d)</sup>	USD	4,000 %	Perp.	5.901.111	1,47
	Celestial Miles Ltd. <sup>(d)</sup>	USD	5,750 %	Perp.	2.888.865	0,72
	Champion Path Holdings Ltd.	USD	4,850 %	27/01/2028	413.642	0,10
	Easy Tactic Ltd.	USD	5,875 %	13/02/2023	615.250	0,15
200.000	Easy Tactic Ltd.	USD	8,125 %	27/02/2023	115.000	0,03
	Easy Tactic Ltd.	USD	8,625 %	27/02/2024	417.150	0,10
	Easy Tactic Ltd.	USD	8,625 %	05/03/2024	1.478.050	0,37
	Easy Tactic Ltd.	USD	8,125 %	11/07/2024	988.800	0,25
	ENN Clean Energy International Investment Ltd.	USD	3,375 %	12/05/2026	1.688.661	0,42
	Fortune Star BVI Ltd.	USD	6,850 %	02/07/2024	2.896.800	0,72
	Fortune Star BVI Ltd.	USD	5,950 %	19/10/2025	3.394.350	0,84
	Fortune Star BVI Ltd.	USD	5,000 %	18/05/2026	589.000	0,15
	Fortune Star BVI Ltd.	EUR	3,950 %	02/10/2026	4.866.274	1,21
	Greenland Global Investment Ltd.	USD	5,600 %	13/11/2022	178.000	0,04
	Greenland Global Investment Ltd.	USD	6,125 %	22/04/2023	788.012	0,20
	Greenland Global Investment Ltd.	USD	6,750 %	26/09/2023	1.351.500 344.400	0,34
	Greenland Global Investment Ltd. Greenland Global Investment Ltd.	USD	6,750 % 5,875 %	03/03/2024 03/07/2024	738.700	0,09 0,18
	Hejun Shunze Investment Co., Ltd.	USD	10,400 %	09/03/2023	46.000	0,18
	Huarong Finance 2017 Co., Ltd. <sup>(d)</sup>	USD	4,000 %	09/03/2023 Perp.	2.277.000	0,57
	Huarong Finance 2017 Co., Ltd. <sup>(d)</sup>	USD	4,500 %	Perp.	199.125	0,05
	Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	USD	3,250 %	13/11/2024	195.500	0,05
1.250.000	Huarong Finance 2019 Co., Ltd.(d)	USD	4,250 %	Perp.	1.134.375	0,28
800.000	Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	5,500 %	16/01/2025	830.000	0,21
350.000	Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	5,000 %	19/11/2025	358.750	0,09
	Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	4,625 %	03/06/2026	284.200	0,07
	Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	4,875 %	22/11/2026	2.533.575	0,63
	Kunzhi Ltd.	USD	6,250 %	17/10/2020	109.500	0,03
	Kunzhi Ltd.	USD	0,000 %	21/05/2021	30.000	0,01
	New Metro Global Ltd. New Metro Global Ltd.	USD	4,800 % 4,625 %	15/12/2024	540.000 1.143.800	0,13 0,28
	New Metro Global Ltd.  New Metro Global Ltd.	USD	4,500 %	15/10/2025 02/05/2026	634.600	0,28
	NWD Finance BVI Ltd. <sup>(d)</sup>	USD	5,250 %	Perp.	2.087.742	0,52
	RKPF Overseas 2019 A Ltd.	USD	6.700 %	30/09/2024	404.800	0,10
	RKPF Overseas 2019 A Ltd.	USD	5,900 %	05/03/2025	993.600	0,25
490.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd.	USD	5,200 %	12/01/2026	432.425	0,11
480.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd.	USD	5,125 %	26/07/2026	420.600	0,10
1.570.000	Sino-Ocean Land Treasure III Ltd. (d)	USD	4,900 %	Perp.	1.238.341	0,31
	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	USD	6,750 %	24/04/2033	3.300.905	0,82
	Studio City Finance Ltd.	USD	6,000 %	15/07/2025	1.254.317	0,31
	Studio City Finance Ltd.	USD	6,500 %	15/01/2028	640.250	0,16
	Studio City Finance Ltd.	USD	5,000 %	15/01/2029	361.196	0,09
	Tianqi Finco Co., Ltd.	USD	3,750 %	28/11/2022	3.128.058	0,78
350.000	Wealth Driven Ltd.	USD	5,500 %	17/08/2023	350.000	0,09
Inter-Only (					54.582.224	13,59
Islas Caimán	Agile Group Holdings Ltd.	USD	5,750 %	02/01/2025	786.900	0,20
	Agile Group Holdings Ltd. Agile Group Holdings Ltd.	USD	5,500 %	21/04/2025	170.800	0,20
	Agile Group Holdings Ltd.  Agile Group Holdings Ltd. <sup>(d)</sup>	USD	6,875 %	Perp.	630.000	0,04
	Agile Group Holdings Ltd. <sup>(d)</sup>	USD	7,750 %	Perp.	459.000	0,10
	Agile Group Holdings Ltd. <sup>(d)</sup>	USD	8,375 %	Perp.	441.000	0,11
930.000		USD	9,750 %	31/03/2024	934.650	0,23
	Central China Real Estate Ltd.	USD	7,250 %	13/08/2024	2.821.500	0,70
300.000	CFLD Cayman Investment Ltd.	USD	6.920 %	16/06/2022	98.250	U.U.Z
	CFLD Cayman Investment Ltd. CFLD Cayman Investment Ltd.	USD USD	6,920 % 8,050 %	16/06/2022 13/01/2025	98.250 64.746	0,02 0,02

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
Islas Caimán	- (continuación)					
1.400.000	China Aoyuan Group Ltd.	USD	5,980 %	18/08/2025	343.000	0,09
	China Aoyuan Group Ltd.	USD	6,200 %	24/03/2026	159.250	0,04
	China Aoyuan Group Ltd.	USD	5,880 %	01/03/2027	766.850	0,19
	China Evergrande Group China Evergrande Group	USD USD	8,250 % 11,500 %	23/03/2022 22/01/2023	107.351 542.025	0,03 0,14
	China Evergrande Group	USD	10,000 %	11/04/2023	1.376.900	0,14
	China Evergrande Group	USD	7,500 %	28/06/2023	1.217.650	0,30
	China Evergrande Group	USD	12,000 %	22/01/2024	286.650	0,07
	China Evergrande Group	USD	10,500 %	11/04/2024	85.750	0,02
	China Evergrande Group	USD	8,750 %	28/06/2025	424.375	0,11
	China SCE Group Holdings Ltd.	USD	7,000 %	02/05/2025	2.309.449	0,58
	China SCE Group Holdings Ltd. CIFI Holdings Group Co., Ltd.	USD USD	6,000 % 6,550 %	04/02/2026 28/03/2024	1.567.800 203.700	0,39 0,05
	CIFI Holdings Group Co., Ltd.	USD	6,450 %	07/11/2024	1.717.700	0,43
	CIFI Holdings Group Co., Ltd.	USD	6,000 %	16/07/2025	344.700	0,09
	CIFI Holdings Group Co., Ltd.	USD	4,450 %	17/08/2026	898.425	0,22
830.000	CIFI Holdings Group Co., Ltd.	USD	4,375 %	12/04/2027	749.075	0,19
	CIFI Holdings Group Co., Ltd. <sup>(d)</sup>	USD	5,375 %	Perp.	404.200	0,10
	Country Garden Holdings Co., Ltd.	USD	8,000 %	27/01/2024	388.830	0,10
	Country Garden Holdings Co., Ltd.	USD	5,625 %	15/12/2026 14/11/2024	642.600	0,16
	eHi Car Services Ltd. eHi Car Services Ltd.	USD USD	7,750 % 7,000 %	21/09/2026	2.945.150 1.082.950	0,73 0,27
	Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	USD	12,250 %	18/10/2022	62.500	0,02
	Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	USD	10,875 %	09/01/2023	360.000	0,09
	Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	USD	11,875 %	01/06/2023	195.000	0,05
650.000	Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	USD	9,250 %	28/07/2023	165.750	0,04
	Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	USD	9,875 %	19/10/2023	114.400	0,03
	Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	USD	10,875 %	02/03/2024	235.000	0,06
	Golden Eagle Retail Group Ltd.	USD	4,625 %	21/05/2023	1.255.930	0,31
	Haidilao International Holding Ltd.	USD	2,150 %	14/01/2026	1.896.275	0,47
	Health & Happiness H&H International Holdings Ltd. iQIYI, Inc.	USD USD	5,625 % 2,000 %	24/10/2024 01/04/2025	1.220.058 2.573.497	0,30 0,64
	iQIYI, Inc.	USD	4,000 %	15/12/2026	967.741	0,24
	Jiayuan International Group Ltd.	USD	12,500 %	08/04/2023	230.100	0,06
	Kaisa Group Holdings Ltd.	USD	8,500 %	30/06/2022	213.500	0,05
	Kaisa Group Holdings Ltd.	USD	11,500 %	30/01/2023	146.200	0,04
	Kaisa Group Holdings Ltd.	USD	9,750 %	28/09/2023	139.400	0,03
	Kaisa Group Holdings Ltd.	USD	11,950 %	12/11/2023	67.500	0,02
	Kaisa Group Holdings Ltd. Kaisa Group Holdings Ltd.	USD USD	9,375 % 9,950 %	30/06/2024 23/07/2025	1.704.375 505.400	0,42 0,13
	Kaisa Group Holdings Ltd. Kaisa Group Holdings Ltd.	USD	11,650 %	01/06/2026	808.041	0,13
	Kaisa Group Holdings Ltd. <sup>(d)</sup>	USD	10,875 %	Perp.	322.400	0,08
	King Talent Management Ltd.(d)	USD	5,600 %	Perp.	934.375	0,23
	KWG Group Holdings Ltd.	USD	7,875 %	01/09/2023	1.506.719	0,38
	KWG Group Holdings Ltd.	USD	5,875 %	10/11/2024	179.400	0,04
	KWG Group Holdings Ltd.	USD	5,950 %	10/08/2025	148.500	0,04
	KWG Group Holdings Ltd. KWG Group Holdings Ltd.	USD USD	6,300 % 6,000 %	13/02/2026 14/08/2026	579.150 661.500	0,14 0,16
	KWG Group Holdings Ltd.	USD	7,400 %	13/01/2027	454.450	0,10
	Logan Group Co., Ltd.	USD	6,900 %	09/06/2024	387.450	0,10
	Logan Group Co., Ltd.	USD	4,250 %	17/09/2024	245.659	0,06
	Logan Group Co., Ltd.	USD	5,750 %	14/01/2025	328.708	0,08
	Logan Group Co., Ltd.	USD	4,250 %	12/07/2025	729.800	0,18
	Logan Group Co., Ltd.	USD	5,250 %	19/10/2025	243.000	0,06
	Melco Resorts Finance Ltd.	USD	4,875 %	06/06/2025	576.385	0,14
	Melco Resorts Finance Ltd. Melco Resorts Finance Ltd.	USD USD	5,250 % 5,625 %	26/04/2026 17/07/2027	1.622.502 6.608.287	0,40 1,65
	Melco Resorts Finance Ltd.	USD	5,750 %	21/07/2028	890.300	0,22
	Melco Resorts Finance Ltd.	USD	5,375 %	04/12/2029	1.337.589	0,33
	Melco Resorts Finance Ltd. 144A <sup>(e)</sup>	USD	5,250 %	26/04/2026	388.206	0,10
	MGM China Holdings Ltd.	USD	5,250 %	18/06/2025	2.360.791	0,59
	MGM China Holdings Ltd.	USD	5,875 %	15/05/2026	5.997.139	1,49
	MGM China Holdings Ltd.	USD	4,750 %	01/02/2027	1.977.943	0,49
	MGM China Holdings Ltd. 144A <sup>(e)</sup>	USD	5,875 %	15/05/2026	554.357	0,14
	Modern Land China Co., Ltd. Modern Land China Co., Ltd.	USD USD	11,500 % 9,800 %	13/11/2022 11/04/2023	58.000 191.400	0,01 0,05
	Modern Land China Co., Ltd.	USD	11,950 %	04/03/2024	812.000	0,03
	Mongolian Mining Corp.	USD	0,000 %	Perp.	538.650	0,13
	NagaCorp Ltd.	USD	7,950 %	06/07/2024	5.199.554	1,29
	New Oriental Education & Technology Group, Inc.	USD	2,125 %	02/07/2025	1.764.850	0,44
340.000	Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	USD	6,250 %	10/08/2024	287.300	0,07

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
		DIVISA	ripo de interes.	recha de vencimiento.	030	patrinonio
Bonos - (con	tinuacion) – (continuación)					
	Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	USD	5,950 %	30/04/2025	929.600	0,23
	Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	USD	4,900 %	13/05/2026	1.122.000	0,28
	Redsun Properties Group Ltd.	USD	9,700 %	16/04/2023	655.400	0,16
1.660.000	Redsun Properties Group Ltd.	USD	7,300 %	21/05/2024	846.600	0,21
	Redsun Properties Group Ltd.	USD	7,300 %	13/01/2025	1.137.400	0,28
	Ronshine China Holdings Ltd.	USD	8,950 %	22/01/2023	91.000	0,02
	Ronshine China Holdings Ltd. Ronshine China Holdings Ltd.	USD	8,100 %	09/06/2023	364.000	0,09
	Ronshine China Holdings Ltd.	USD USD	7,350 % 6,750 %	15/12/2023 05/08/2024	109.200 289.250	0,03 0,07
	Seazen Group Ltd.	USD	6,150 %	15/04/2023	601.873	0,07
	Shimao Group Holdings Ltd.	USD	3,450 %	11/01/2031	469.200	0,12
	Sunac China Holdings Ltd.	USD	5,950 %	26/04/2024	2.639.000	0,66
730.000	Sunac China Holdings Ltd.	USD	6,650 %	03/08/2024	507.350	0,13
	Sunac China Holdings Ltd.	USD	6,800 %	20/10/2024	1.925.150	0,48
	Sunac China Holdings Ltd.	USD	6,500 %	10/01/2025	558.596	0,14
	Sunac China Holdings Ltd.	USD	7,000 %	09/07/2025	1.400.700	0,35
	Sunac China Holdings Ltd.	USD	6,500 %	26/01/2026	869.400	0,22
	Times China Holdings Ltd.	USD	6,750 %	08/07/2025	1.514.200	0,38
	Times China Holdings Ltd. VLL International, Inc.	USD USD	6,200 % 5,750 %	22/03/2026 28/11/2024	502.500 438.600	0,13 0,11
	VLL International, Inc.	USD	7,250 %	20/07/2027	1.280.329	0,11
	Wynn Macau Ltd.	USD	5,500 %	15/01/2026	1.607.400	0,40
	Wynn Macau Ltd.	USD	5,500 %	01/10/2027	3.310.375	0,82
	Wynn Macau Ltd.	USD	5,625 %	26/08/2028	1.485.990	0,37
1.040.000	Yuzhou Group Holdings Co., Ltd.	USD	6,000 %	25/10/2023	338.000	0,08
200.000	Yuzhou Group Holdings Co., Ltd.	USD	8,500 %	26/02/2024	66.000	0,02
	Yuzhou Group Holdings Co., Ltd.	USD	7,700 %	20/02/2025	563.200	0,14
	Yuzhou Group Holdings Co., Ltd.	USD	7,850 %	12/08/2026	61.000	0,02
	Yuzhou Group Holdings Co., Ltd. (d)	USD	5,375 %	Perp.	1.094.950	0,27
	Zhenro Properties Group Ltd.	USD	7,875 %	14/04/2024	3.076.650	0,77
	Zhenro Properties Group Ltd. Zhenro Properties Group Ltd.	USD USD	7,100 % 6,700 %	10/09/2024 04/08/2026	127.000 608.850	0,03 0,15
	Zhenro Properties Group Ltd. <sup>(d)</sup>	USD	10,250 %	Perp.	473.100	0,13
	Zilolilo i Topoliloo Group Zidi.		10,200 70	. о.р.	106.853.170	26,60
China						
2.380.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	USD	4,875 %	21/09/2025	2.617.393	0,65
Hong Kong						
	Bank of East Asia Ltd.(d)	USD	5,825 %	Perp.	4.744.300	1,18
	Far East Horizon Ltd. (d)	USD	4,350 %	Perp.	683.400	0,17
	Wanda Group Overseas Ltd.	USD	8,875 %	21/03/2023	2.447.950	0,61
	Yango Justice International Ltd.	USD	9,250 %	15/04/2023	393.300	0,10
	Yanlord Land HK Co., Ltd.	USD	6,750 %	23/04/2023	310.000	0,08
1.370.000	Yanlord Land HK Co., Ltd.	USD	6,800 %	27/02/2024	1.366.575	0,34
					9.945.525	2,48
India	A				4.050.000	
	Adani Electricity Mumbai Ltd.	USD	3,949 %	12/02/2030	1.053.680	0,26
	Adani Electricity Mumbai Ltd.	USD	3,867 %	22/07/2031	1.248.931	0,31
	Adani Green Energy Ltd.	USD	4,375 %	08/09/2024	5.524.312	1,37
3.370.000	Adani Green Energy UP Ltd. Via Prayatna Developers Pvt Ltd. Via Parampujya Solar Energy Pvt Ltd.	USD	6,250 %	10/12/2024	3.638.800	0,91
1 380 000	Delhi International Airport Ltd.	USD	6,125 %	31/10/2026	1.406.744	0,35
	Future Retail Ltd.	USD	5,600 %	22/01/2025	1.072.522	0,27
	GMR Hyderabad International Airport Ltd.	USD	4,750 %	02/02/2026	1.508.192	0,38
	GMR Hyderabad International Airport Ltd.	USD	4,250 %	27/10/2027	937.037	0,23
	HPCL-Mittal Energy Ltd.	USD	5,450 %	22/10/2026	1.617.812	0,40
	JSW Hydro Energy Ltd.	USD	4,125 %	18/05/2031	5.490.633	1,37
	JSW Steel Ltd.	USD	3,950 %	05/04/2027	927.438	0,23
	Muthoot Finance Ltd.	USD	4,400 %	02/09/2023	1.242.875	0,31
2.740.000	ReNew Power Pvt Ltd.	USD	5,875 %	05/03/2027	2.835.900	0,71
1.570.000	ReNew Power Synthetic	USD	6,670 %	12/03/2024	1.622.607	0,40
	Shriram Transport Finance Co., Ltd.	USD	5,950 %	24/10/2022	203.000	0,05
	Shriram Transport Finance Co., Ltd.	USD	5,100 %	16/07/2023	660.563	0,16
	Shriram Transport Finance Co., Ltd.	USD	4,400 %	13/03/2024	1.005.000	0,25
	Tata Motors Ltd.	USD	5,875 %	20/05/2025	426.500	0,11
3.900.000	Yes Bank Ifsc Banking Unit Branch	USD	3,750 %	06/02/2023	3.850.129	0,96
					36.272.675	9,03

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del
Bonos – (conf		DIVISA	ripo de lilleres	recha de vencimiento.	030	patrinonic
Indonesia	unuacion)					
	ABM Investama Tbk PT	USD	7,125 %	01/08/2022	1.099.986	0,27
1.890.000	ABM Investama Tbk PT	USD	9,500 %	05/08/2026	1.800.225	0,45
970.000	Alam Sutera Realty Tbk PT	USD	8,000 %	02/05/2024	822.029	0,20
	Alam Sutera Realty Tbk PT	USD	8,250 %	02/11/2025	1.229.690	0,31
	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	USD	3,750 %	30/03/2026	559.625	0,14
	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT <sup>(d)</sup>	USD	4,300 %	Perp.	680.850	0,17
	Bukit Makmur Mandiri Utama PT	USD	7,750 % 4.950 %	10/02/2026 14/09/2026	1.141.375 613.875	0,28
	Cikarang Listrindo Tbk PT Delta Merlin Dunia Tekstil PT – Serie A <sup>(c)</sup>	USD USD	4,950 % 2,500 %	26/06/2028	67.813	0,15 0,02
	Delta Merlin Dunia Tekstil PT – Serie B	USD	0,000 %	26/06/2032	19.732	0,02
	Pakuwon Jati Tbk PT	USD	4,875 %	29/04/2028	1.505.127	0,38
	Saka Energi Indonesia PT	USD	4,450 %	05/05/2024	1.328.588	0,33
	Sri Rejeki Isman Tbk PT	USD	7,250 %	16/01/2025	442.800	0,11
		-			11.311.715	2,82
Japón						
	Rakuten Group, Inc. <sup>(d)</sup>	USD	5,125 %	Perp.	2.080.600	0,52
	SoftBank Group Corp.	USD	4,000 %	06/07/2026	846.075	0,21
	SoftBank Group Corp.	USD	5,125 %	19/09/2027	976.325	0,24
	SoftBank Group Corp.(d)	USD	6,000 %	Perp.	960.400	0,24
230.000	SoftBank Group Corp. <sup>(d)</sup>	USD .	6,875 %	Perp.	225.688	0,06
					5.089.088	1,27
Jersey 1.750.000	West China Cement Ltd.	USD	4,950 %	08/07/2026	1.631.875	0,41
 Luxemburgo						
-	Puma International Financing S.A.	USD	5,000 %	24/01/2026	6.484.225	1,61
Mauricio						
	Azure Power Energy Ltd.	USD	3,575 %	19/08/2026	3.688.350	0,92
	Azure Power Solar Energy Pvt Ltd.	USD	5,650 %	24/12/2024	210.169	0,05
	CA Magnum Holdings	USD	5,375 %	31/10/2026	1.222.725	0,30
	Clean Renewable Power Mauritius Pte Ltd.	USD	4,250 %	25/03/2027	3.887.450	0,97
	Greenko Mauritius Ltd. Greenko Solar Mauritius Ltd.	USD USD	6,250 % 5,550 %	21/02/2023 29/01/2025	204.500 8.537.125	0,05 2,13
	Greenko Solar Mauritius Ltd.	USD	5,950 %	29/07/2026	3.390.563	0,84
	India Airport Infrastructure	USD	6,250 %	25/10/2025	5.181.802	1,29
	India Green Power Holdings	USD	4,000 %	22/02/2027	2.693.400	0,67
	Network i2i Ltd. <sup>(d)</sup>	USD	5,650 %	Perp.	6.967.669	1,73
5.190.000	UPL Corp., Ltd. <sup>(d)</sup>	USD	5,250 %	Perp.	5.241.057	1,31
		-			41.224.810	10,26
Países Bajos						
3.083.050	Greenko Dutch BV	USD	3,850 %	29/03/2026	3.113.880	0,77
200.000	Jababeka International BV	USD	6,500 %	05/10/2023	189.500	0,05
	Mong Duong Finance Holdings BV	USD	5,125 %	07/05/2029	7.146.402	1,78
2.200.000	Royal Capital BV <sup>(d)</sup>	USD	5,000 %	Perp.	2.332.446	0,58
					12.782.228	3,18
Pakistán						
	Bonos internacionales del Estado de Pakistán	USD	6,000 %	08/04/2026	683.100	0,17
	Bonos internacionales del Estado de Pakistán	USD	6,875 %	05/12/2027	836.117	0,21
	Bonos internacionales del Estado de Pakistán	USD	7,375 %	08/04/2031	544.600	0,13
540.000	Pakistan Water & Power Development Authority	USD .	7,500 %	04/06/2031	522.450	0,13
Filiale					2.586.267	0,64
3 840 000	Globe Telecom, Inc. (d)	USD	4,200 %	Perp.	3.919.987	0,97
	cross recom, me.	030	7,200 /0	reip.	0.010.001	0,97
Singapur 600.000	ABJA Investment Co. Pte Ltd.	USD	5,950 %	31/07/2024	647.250	0,16
8.660.000	ABJA Investment Co., Pte Ltd.	USD	5,450 %	24/01/2028	9.341.975	2,33
	Continuum Energy Levanter Pte Ltd.	USD	4,500 %	09/02/2027	1.488.155	0,37
	Global Prime Capital Pte Ltd.	USD	5,950 %	23/01/2025	1.676.900	0,42
3.460.000	Indika Energy Capital IV Pte Ltd.	USD	8,250 %	22/10/2025	3.581.100	0,89
	Innovate Capital Pte Ltd. – Serie MCB	USD	6,000 %	11/12/2024	3.633	0,00
12.219				00/00/0004		
	JGC Ventures Pte Ltd.	USD	10,750 %	30/08/2021	225.500	0,06
820.000	JGC Ventures Pte Ltd. Jollibee Worldwide Pte Ltd. <sup>(d)</sup>	USD USD	10,750 % 3,900 %	30/08/2021 Perp.	225.500 404.674	
820.000 400.000						0,06 0,10 0,81

Tenencias	Descripción del valor	Dist	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de
	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interes	Fecha de vencimiento(e)	080	patrimoni
Bonos – (con Singapur – (co	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					
•	•	USD	6 275 0/	20/01/2027	276 947	0.00
	Medco Bell Pte Ltd. Medco Oak Tree Pte Ltd.	USD	6,375 % 7,375 %	30/01/2027 14/05/2026	376.847 2.672.400	0,09 0,67
	Medco Platinum Road Pte Ltd.	USD	6,750 %	30/01/2025	894.546	0,22
	Modernland Overseas Pte Ltd.	USD	6,950 %	13/04/2024	588.131	0,15
3.870.000	Parkway Pantai Ltd. <sup>(d)</sup>	USD	4,250 %	Perp.	3.879.859	0,97
1.500.000	SSMS Plantation Holdings Pte Ltd.	USD	7,750 %	23/01/2023	1.086.521	0,27
	Theta Capital Pte Ltd.	USD	6,750 %	31/10/2026	1.048.600	0,26
	Tiger Holdco Pte Ltd. 144A <sup>(e)</sup>	USD	13,000 %	10/06/2023	729.180	0,18
	TML Holdings Pte Ltd.	USD	5,500 %	03/06/2024	688.875	0,17
4.960.000	TML Holdings Pte Ltd.	USD	4,350 %	09/06/2026	5.022.000	1,25 9,50
Supranacional	98				38.148.082	9,50
•	Mongolian Mining Corp. Via Energy Resources LLC	USD	9,250 %	15/04/2024	600.279	0,15
Tailandia						
	Bangkok Bank PCL <sup>(d)</sup>	USD	3,733 %	25/09/2034	1.771.226	0,44
	Kasikornbank PCL <sup>(d)</sup>	USD	3,343 %	02/10/2031	947.102	0,24
	Krung Thai Bank PCL <sup>(d)</sup>	USD	4,400 %	Perp.	540.000	0,13
1.930.000	Minor International PCL <sup>(d)</sup>	USD	2,700 %	Perp.	1.923.312	0,48
					5.181.640	1,29
Reino Unido	Vedanta Resources Ltd.	USD	7,125 %	31/05/2023	2.237.878	0,56
	Vedanta Resources Ltd.  Vedanta Resources Ltd.	USD	6,125 %	09/08/2024	10.729.172	2,67
12.100.000	Todania (1000a.1000 Eta.		0,120 70	00,00,2021	12.967.050	3,23
Estados Unido	s				12.007.000	0,20
	Austin BidCo, Inc.	USD	7,125 %	15/12/2028	1.371.825	0,34
TOTAL DE BOI					359.217.328	90.42
(coste USD 392	2.713.979)					89,43
Tenencias	Descripción del valor				Valor de mercado en USD	% de patrimonio
Irlanda	versión – 5,68 %					
	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase	de acciones de distrib	oución X) <sup>(f)(g)</sup>		22.798.777	5,68
TOTAL DE FON (coste USD 22.	IDOS DE INVERSIÓN 798.777)				22.798.777	5,68
TOTAL DE VAL	ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA 5.512.756)	BOLSA DE VALORE	S OFICIAL		382.016.105	95,11
<u>`</u>	,				Valor de	,
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	mercado en USD	% del patrimonio
	iarios negociados en otro mercado regulado					
Bonos - 1,84	%					
Bonos – 1,84 Islas Vírgenes	% Británicas	LICO	5 000 %	45/04/0020	4 770 000	0.45
Bonos – 1,84 Islas Vírgenes 1.970.000	%	USD	5,000 %	15/01/2029	1.778.890	0,45
Bonos - 1,84 Islas Vírgenes 1.970.000 Islas Caimán	<b>% Británicas</b> Studio City Finance Ltd. 144A <sup>(e)</sup>	USD	<u> </u>			
Bonos - 1,84 Islas Vírgenes 1.970.000 Islas Caimán 1.810.000	% Británicas Studio City Finance Ltd. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	2,802 %	01/02/2026	1.613.278	0,45 0,40 0,32
Bonos - 1,84 Islas Vírgenes 1.970.000 Islas Caimán 1.810.000 1.480.000	% Británicas Studio City Finance Ltd. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD USD	2,802 % 0,500 %	01/02/2026 01/02/2027	1.613.278 1.302.337	0,40 0,32
Bonos - 1,84 Islas Vírgenes 1.970.000 Islas Caimán 1.810.000 1.480.000	% Británicas Studio City Finance Ltd. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	2,802 %	01/02/2026	1.613.278 1.302.337 2.675.707	0,40 0,32 0,67
Bonos - 1,84 Islas Vírgenes 1.970.000 Islas Caimán 1.810.000 1.480.000 3.390.000	% Británicas Studio City Finance Ltd. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> Vnet Group, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD USD	2,802 % 0,500 %	01/02/2026 01/02/2027	1.613.278 1.302.337 2.675.707 5.591.322	0,40 0,32 0,67 1,39
Bonos – 1,84 Islas Virgenes 1.970.000 Islas Caimán 1.810.000 1.480.000 3.390.000 TOTAL DE BOI (coste USD 7.8	% Británicas Studio City Finance Ltd. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> Vnet Group, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD USD USD	2,802 % 0,500 %	01/02/2026 01/02/2027	1.613.278 1.302.337 2.675.707	
Bonos – 1,84 Islas Virgenes 1.970.000 Islas Caimán 1.810.000 1.480.000 3.390.000 TOTAL DE BOI (coste USD 7.8	% Británicas Studio City Finance Ltd. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> Vnet Group, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NOS 51.870)  ORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO	USD USD USD	2,802 % 0,500 %	01/02/2026 01/02/2027	1.613.278 1.302.337 2.675.707 5.591.322	0,40 0,32 0,67 1,39
Bonos – 1,84 Islas Vírgenes	% Británicas Studio City Finance Ltd. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> Vnet Group, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NOS 51.870)  ORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO 51.870)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADO	USD USD USD	2,802 % 0,500 %	01/02/2026 01/02/2027	1.613.278 1.302.337 2.675.707 5.591.322 <b>7.370.212</b>	0,44 0,32 0,61 1,38

Número de	,			Compromiso Valor de mercado en	Plusvalía latente	% del
contratos	Descripción del valor  EUR			USD	USD	patrimonio
(		blica Federal de Alemania a 5 años 08/12/2021	Corta	(2.778.085)	3.687	0,00
	USD	. =				
1	14 Futuros sobre pagarés del Tesor 104 Futuros sobre pagarés del Tesor		Larga Larga	1.834.875 22.778.438	28.766 79.009	0,01 0,02
	121 Futuros sobre pagarés del Tesor		Larga	14.725.133	154.086	0,04
	4 Futuros sobre pagarés del Tesor	o de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022	Larga _	587.937	11.484	0,00
DI LIGVAL ÍA	LATENTE SOBRE CONTRATOS D	E ELITUROS		39.926.383	273.345	0,07
PLUSVALIA	CLATENTE SOBRE CONTRATOS D	E FUTUROS			277.032	0,07
Número de				Compromiso Valor de mercado en	Plusvalía latente	% del
contratos	Descripción del valor			USD	USD	patrimonio
	USD (3) Futuros sobre bonos del Tesoro	de EE 1111 a largo plazo 22/03/2022	Corta	(485.906)	(11.625)	(0,01)
	A LATENTE SOBRE CONTRATOS I		Corta	(403.900)		
	de divisas a plazo – (0,01 %)	DEFUTUROS			(11.625)	(0,01)
Contratos	uc divisus a plazo – (0,01 70)				Plusvalía	
Divisa	Compra Divisa	Venta	Fec	ha de vencimiento	latente USD	% del patrimonio
HKD	281.146 USD	36.086		10/02/2022	(20)	(0,00)
USD	5.032.247 EUR	4.452.449		10/02/2022	(45.510)	(0,01)
MINUSVALÍ	A LATENTE SOBRE CONTRATOS I	DE DIVISAS A PLAZO			(45.530)	(0,01)
		e una clase de acciones – 0,10 %				
			Fec	ha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
Contratos	de divisas a plazo específicos d	e una clase de acciones – 0,10 %	Fec	ha de vencimiento 21/01/2022	Plusvalía latente	
Contratos	de divisas a plazo específicos d Compra Divisa	e una clase de acciones – 0,10 % Venta	Fec		Plusvalía latente USD	patrimonio
Contratos  Divisa  USD  USD  USD	de divisas a plazo específicos d  Compra Divisa 6.814 GBP 6.202 AUD 70.562 SGD	venta  5.013 8.405 95.159	Fec	21/01/2022 31/01/2022 07/02/2022	Plusvalia latente USD 111 179 804	0,00 0,00 0,00
Contratos  Divisa  USD  USD  USD  USD  EUR	de divisas a plazo específicos d  Compra Divisa 6.814 GBP 6.202 AUD 70.562 SGD 37.355.285 USD	ve una clase de acciones – 0,10 %  Venta  5.013  8.405  95.159  42.183.795		21/01/2022 31/01/2022	Plusvalia latente USD 111 179	0,00 0,00
Contratos  Divisa  USD  USD  USD  USD  EUR	de divisas a plazo específicos d  Compra Divisa 6.814 GBP 6.202 AUD 70.562 SGD 37.355.285 USD	venta  5.013 8.405 95.159		21/01/2022 31/01/2022 07/02/2022	Plusvalia latente USD 111 179 804	0,00 0,00 0,00
Contratos  Divisa  USD  USD  USD  USD  EUR	de divisas a plazo específicos d  Compra Divisa 6.814 GBP 6.202 AUD 70.562 SGD 37.355.285 USD	ve una clase de acciones – 0,10 %  Venta  5.013  8.405  95.159  42.183.795		21/01/2022 31/01/2022 07/02/2022	Plusvalia latente USD 111 179 804 417.713 418.807	0,00 0,00 0,00 0,00 0,11 <b>0,11</b>
Divisa USD USD USD EUR	de divisas a plazo específicos d  Compra Divisa 6.814 GBP 6.202 AUD 70.562 SGD 37.355.285 USD	ve una clase de acciones – 0,10 %  Venta  5.013  8.405  95.159  42.183.795	BERTURA	21/01/2022 31/01/2022 07/02/2022	Plusvalia latente USD 111 179 804 417.713 418.807	patrimonio 0,00 0,00 0,00 0,00
Divisa USD USD USD USD EUR PLUSVALÍA	de divisas a plazo específicos d  Compra Divisa 6.814 GBP 6.202 AUD 70.562 SGD 37.355.285 USD A LATENTE SOBRE CONTRATOS D	Venta  5.013  8.405  95.159  42.183.795  E DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE CO	BERTURA	21/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 10/02/2022	Plusvalia latente USD 111 179 804 417.713 418.807 Plusvalia latente	patrimonio 0,00 0,00 0,00 0,01 0,11
Contratos  Divisa  USD  USD  USD  EUR  PLUSVALÍA  Divisa  GBP  AUD	Compra   Divisa	venta  5.013 8.405 95.159 42.183.795  E DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE CO  Venta  153.906 187.408	BERTURA	21/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 tha de vencimiento 21/01/2022 31/01/2022	Plusvalia latente USD  111 179 804 417.713 418.807  Plusvalia latente USD  (4.249) (5.962)	patrimonio  0,00  0,00  0,00  0,11  0,11  % del patrimonio  (0,00) (0,00)
Contratos  Divisa  USD  USD  USD  EUR  PLUSVALÍA  Divisa  GBP  AUD  SGD	Compra   Divisa	Venta  5.013 8.405 95.159 42.183.795  E DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COI  Venta  153.906 187.408 2.102.826	BERTURA Fec	21/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 ha de vencimiento 21/01/2022	Plusvalia latente USD  111 179 804 417.713 418.807  Plusvalia latente USD (4.249) (5.962) (20.504)	patrimonio  0,00  0,00  0,01  0,11  0,11  % del patrimonio  (0,00) (0,00) (0,01)
Contratos  Divisa  USD  USD  USD  EUR  PLUSVALÍA  Divisa  GBP  AUD  SGD  MINUSVALÍ	Compra   Divisa	venta  5.013 8.405 95.159 42.183.795  E DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE CO  Venta  153.906 187.408	BERTURA Fec	21/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 tha de vencimiento 21/01/2022 31/01/2022	Plusvalia latente USD  111 179 804 417.713 418.807  Plusvalia latente USD  (4.249) (5.962)	patrimonio  0,00  0,00  0,00  0,11  0,11  % del patrimonio  (0,00) (0,00)
Divisa USD USD USD EUR PLUSVALÍA  Divisa GBP AUD SGD MINUSVALÍ	Compra   Divisa	Venta  5.013 8.405 95.159 42.183.795  E DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COI  Venta  153.906 187.408 2.102.826	BERTURA Fec	21/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 tha de vencimiento 21/01/2022 31/01/2022	Plusvalia latente USD  111 179 804 417.713 418.807  Plusvalia latente USD (4.249) (5.962) (20.504)	patrimonio  0,00  0,00  0,01  0,11  0,11  % del patrimonio  (0,00) (0,00) (0,01)
Contratos  Divisa  USD  USD  USD  EUR  PLUSVALÍA  Divisa  GBP  AUD  SGD  MINUSVALÍ  VALOR DE  (coste USD	Compra	Venta  5.013 8.405 95.159 42.183.795  E DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COI  Venta  153.906 187.408 2.102.826	BERTURA Fec	21/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 tha de vencimiento 21/01/2022 31/01/2022	Plusvalia latente USD  111 179 804 417.713 418.807  Plusvalia latente USD (4.249) (5.962) (20.504) (30.715)	patrimonio 0,00 0,00 0,00 0,11 0,11 % del patrimonio (0,00) (0,00) (0,01)
Divisa USD USD USD EUR PLUSVALÍA Divisa GBP AUD SGD MINUSVALÍ (coste USD OTROS AC	Compra   Divisa	Venta  5.013 8.405 95.159 42.183.795  E DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COI  Venta  153.906 187.408 2.102.826	BERTURA Fec	21/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 tha de vencimiento 21/01/2022 31/01/2022	Plusvalia latente USD  111 179 804 417.713 418.807  Plusvalia latente USD (4.249) (5.962) (20.504) (30.715)	patrimonio  0,00  0,00  0,01  0,11  0,11  % del patrimonio  (0,00) (0,01)  (0,01)  97,10
Divisa USD USD USD EUR PLUSVALÍA Divisa GBP AUD SGD MINUSVALÍ (coste USD OTROS AC	Compra   Divisa	Venta  5.013 8.405 95.159 42.183.795  E DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COI  Venta  153.906 187.408 2.102.826	BERTURA Fec	21/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 tha de vencimiento 21/01/2022 31/01/2022	Plusvalia latente USD 111 179 804 417.713 418.807 Plusvalia latente USD (4.249) (5.962) (20.504) (30.715) 389.994.286 11.660.453 401.654.739 Valor de	patrimonio 0,00 0,00 0,00 0,11 0,11 % del patrimonio (0,00) (0,01) (0,01) 97,10 2,90
Contratos  Divisa  USD  USD  USD  EUR  PLUSVALÍA  Divisa  GBP  AUD  SGD  MINUSVALÍ  VALOR DE  (coste USD  OTROS AC'  PATRIMONI	Compra Divisa 6.814 GBP 6.202 AUD 70.562 SGD 37.355.285 USD A LATENTE SOBRE CONTRATOS D  Compra Divisa 111.927 USD 253.192 USD 2.840.591 USD IA LATENTE SOBRE CONTRATOS I MERCADO DE LAS INVERSIONES 423.364.626) TIVOS Y PASIVOS	Venta  5.013 8.405 95.159 42.183.795  E DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COI  Venta  153.906 187.408 2.102.826	BERTURA Fec	21/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 tha de vencimiento 21/01/2022 31/01/2022	Plusvalia latente USD  111 179 804 417.713 418.807  Plusvalia latente USD  (4.249) (5.962) (20.504) (30.715)  389.994.286 11.660.453 401.654.739	patrimonio  0,00 0,00 0,00 0,11  0,11  % del patrimonio  (0,00) (0,01) (0,01) 97,10 2,90
Contratos  Divisa  USD  USD  EUR  PLUSVALÍA  Divisa  GBP  AUD  SGD  MINUSVALÍ  VALOR DE  (coste USD  OTROS AC  PATRIMONI  TOTAL DE I	Compra Divisa 6.814 GBP 6.202 AUD 70.562 SGD 37.355.285 USD A LATENTE SOBRE CONTRATOS D  Compra Divisa 111.927 USD 253.192 USD 2.840.591 USD  A LATENTE SOBRE CONTRATOS I  MERCADO DE LAS INVERSIONES 423.364.626) TIVOS Y PASIVOS	Venta  5.013 8.405 95.159 42.183.795  E DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COI  Venta  153.906 187.408 2.102.826	BERTURA Fec	21/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 tha de vencimiento 21/01/2022 31/01/2022	Plusvalia latente USD  111 179 804 417.713 418.807  Plusvalia latente USD (4.249) (5.962) (20.504) (30.715)  389.994.286 11.660.453 401.654.739  Valor de mercado en	patrimonio  0,00  0,00  0,00  0,11  0,11  % del patrimonio  (0,00) (0,01) (0,01)  97,10  2,90  100,00
Contratos  Divisa  USD  USD  USD  EUR  PLUSVALÍA  Divisa  GBP  AUD  SGD  MINUSVALÍ  Coste USD  OTROS AC  PATRIMONI  TOTAL DE I  Total inversi  (coste USI  Plusvalía lat	Compra	Venta  5.013 8.405 95.159 42.183.795  E DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COI  Venta  153.906 187.408 2.102.826	BERTURA Fec	21/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 tha de vencimiento 21/01/2022 31/01/2022	Plusvalia latente USD  111 179 804 417.713 418.807  Plusvalia latente USD (4.249) (5.962) (20.504) (30.715)  389.994.286 11.660.453 401.654.739  Valor de mercado en USD  389.386.317 277.032	patrimonic  0,00 0,00 0,00 0,11 0,11 % de patrimonic (0,00) (0,01) 97,10 2,90 100,00 % de patrimonic
Contratos  Divisa  USD  USD  USD  EUR  PLUSVALÍA  Divisa  GBP  AUD  MINUSVALÍ  VALOR DE  (coste USD  OTROS AC  PATRIMONI  TOTAL DE I  Total inversia  (coste USD  Plusvalía lat  Minusvalía lat  Minusvalía lat	Compra Divisa 6.814 GBP 6.202 AUD 70.562 SGD 37.355.285 USD A LATENTE SOBRE CONTRATOS D  Compra Divisa 111.927 USD 253.192 USD 2.840.591 USD 2.840.591 USD TIVOS Y PASIVOS  IO  INVERSIONES 0.423.364.626) Entle sobre contratos de futuros atente sobre contratos de futuros	Venta  5.013 8.405 95.159 42.183.795  E DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COI  Venta  153.906 187.408 2.102.826  DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE CO	BERTURA Fec	21/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 tha de vencimiento 21/01/2022 31/01/2022	Plusvalia latente USD  111 179 804 417.713 418.807  Plusvalia latente USD (4.249) (5.962) (20.504) (30.715)  389.994.286 11.660.453 401.654.739  Valor de mercado en USD  389.386.317 277.032 (11.625)	patrimonio  0,00  0,00  0,00  0,11  0,11  % del patrimonio  (0,00) (0,01)  97,10  2,90  100,00  % de patrimonio  96,96 0,07 (0,01)
Contratos  Divisa  USD  USD  USD  EUR  PLUSVALÍA  Divisa  GBP  AUD  SGD  MINUSVALÍ  VALOR DE  (coste USD  OTROS AC'  PATRIMONI  TOTAL DE I  Total inversi  (coste USD  Plusvalía lat  Minusvalía lat  Minusvalía lat  Minusvalía lat	Compra Divisa 6.814 GBP 6.202 AUD 70.562 SGD 37.355.285 USD A LATENTE SOBRE CONTRATOS D Compra Divisa 111.927 USD 253.192 USD 2.840.591 USD IA LATENTE SOBRE CONTRATOS I MERCADO DE LAS INVERSIONES 423.364.626) TIVOS Y PASIVOS IO INVERSIONES Ones excluyendo derivados 0.423.364.626) INVERSIONES atente sobre contratos de futuros atente sobre contratos de divisas a pla	Venta  5.013 8.405 95.159 42.183.795  E DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE CO  Venta  153.906 187.408 2.102.826  DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE CO	BERTURA Fec	21/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 tha de vencimiento 21/01/2022 31/01/2022	Plusvalia latente USD  111 179 804 417.713 418.807  Plusvalia latente USD (4.249) (5.962) (20.504) (30.715)  389.994.286 11.660.453 401.654.739  Valor de mercado en USD  389.386.317 277.032 (11.625) (45.530)	patrimonic  0,00  0,00  0,01  0,11  % de patrimonic  (0,00) (0,01)  97,10  2,90  100,00  % de patrimonic  96,98 0,07 (0,01) (0,01)
Contratos  Divisa  USD  USD  USD  EUR  PLUSVALÍA  Divisa  GBP  AUD  SGD  MINUSVALÍ  VALOR DE  (coste USD  OTROS AC  PATRIMONI  TOTAL DE I  Total inversia (coste USC  Plusvalía lat  Minusvalía lat  Plusvalía lat	Compra Divisa 6.814 GBP 6.202 AUD 70.562 SGD 37.355.285 USD  A LATENTE SOBRE CONTRATOS D  Compra Divisa 111.927 USD 253.192 USD 2.840.591 USD 1.840.591 USD	Venta  5.013 8.405 95.159 42.183.795  E DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE CO  Venta  153.906 187.408 2.102.826  DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE CO	BERTURA Fec	21/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 tha de vencimiento 21/01/2022 31/01/2022	Plusvalia latente USD  111 179 804 417.713 418.807  Plusvalia latente USD (4.249) (5.962) (20.504) (30.715)  389.994.286 11.660.453 401.654.739  Valor de mercado en USD  389.386.317 277.032 (11.625) (45.530) 418.807	patrimonio  0,00  0,00  0,00  0,11  0,11  % del patrimonio  (0,00) (0,01)  97,10  100,00  % de patrimonic  96,98 0,007 (0,01) (0,01) (0,01) (0,01)
Contratos  Divisa  USD  USD  USD  EUR  PLUSVALÍA  Divisa  GBP  AUD  SGD  MINUSVALÍ  VALOR DE  (coste USD  OTROS AC  PATRIMONI  TOTAL DE I  Total inversia (coste USC  Plusvalía lat  Minusvalía lat  Plusvalía lat	Compra Divisa 6.814 GBP 6.202 AUD 70.562 SGD 37.355.285 USD  A LATENTE SOBRE CONTRATOS D  Compra Divisa 111.927 USD 253.192 USD 2.840.591 USD 3.44.3364.626) TIVOS Y PASIVOS  INVERSIONES Ones excluyendo derivados 2.423.364.626) Inversiones de futuros atente sobre contratos de futuros atente sobre contratos de divisas a ple	Venta 5.013 8.405 95.159 42.183.795  E DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE CO  Venta 153.906 187.408 2.102.826  DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE CO  ZO celebrados con fines de cobertura	BERTURA Fec	21/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 tha de vencimiento 21/01/2022 31/01/2022	Plusvalia latente USD  111 179 804 417.713 418.807  Plusvalia latente USD (4.249) (5.962) (20.504) (30.715)  389.994.286 11.660.453 401.654.739  Valor de mercado en USD  389.386.317 277.032 (11.625) (45.530)	patrimonio  0,00  0,00  0,00  0,11  % del patrimonio  (0,00) (0,01)  97,10  2,90  100,00  % de patrimonio  96,98  0,07 (0,01) (0,01)

El Comisionista de futuros fue Bank of America N.A.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Australia & New Zealand Banking Group Ltd., Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., State Street Bank & Trust y Westpac Banking Corp.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,07 %.

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.

  (c) Este título tiene un cupón escalonado que pasará al segundo tipo en una fecha determinada del futuro.
- (d) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (e) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (f) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- (g) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

			Time de	V	/alor de mercado	0/ 1
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en USD	% del patrimonio
Valores mobi	iliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial					
Bonos - 88,8	5 %					
Argentina			0.000.0/	00/07/0000	44.000.000	0.05
	Arcor SAIC Cia General de Combustibles S.A.	USD USD	6,000 % 9,500 %	06/07/2023	14.696.803	0,35 0,22
	IRSA Propiedades Comerciales S.A.	USD	9,500 % 8,750 %	08/03/2025 23/03/2023	9.441.697 14.455.391	0,22
	Tecpetrol S.A.	USD	4,875 %	12/12/2022	8.086.365	0,19
	Telecom Argentina S.A.	USD	8,500 %	06/08/2025	5.193.252	0,12
	Telecom Argentina S.A.	USD	8,000 %	18/07/2026	1.855.129	0,04
2.000.000	YPF S.A.	USD	8,500 %	28/07/2025	1.500.750	0,04
17.180.000		USD	6,950 %	21/07/2027	11.541.352	0,27
	YPF S.A.	USD	8,500 %	27/06/2029	4.058.791	0,10
3.650.000	YPF S.A.	USD _	7,000 %	15/12/2047	2.261.358	0,05
					73.090.888	1,72
Australia						
	Santos Finance Ltd.	USD	4,125 %	14/09/2027	4.887.753	0,11
20.730.000	Santos Finance Ltd.	USD _	5,250 %	13/03/2029	23.320.006	0,55
					28.207.759	0,66
Bermudas						
	China Oil & Gas Group Ltd.	USD	4,700 %	30/06/2026	290.921	0,01
	Digicel Group Holdings Ltd.	USD	10,000 %	01/04/2024	7.367.469	0,17
	Geopark Ltd. Geopark Ltd.	USD USD	6,500 % 5,500 %	21/09/2024 17/01/2027	1.615.077 11.736.217	0,04 0,27
	Sagicor Financial Co., Ltd.	USD	5,300 %	13/05/2028	10.432.520	0,27
	Star Energy Geothermal Darajat II Via Star Energy Geothermal Salak	USD	4,850 %	14/10/2038	11.376.260	0,27
	Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	USD	2,625 %	15/08/2025	30.146.993	0,71
	Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	USD	4,000 %	15/08/2026	5.518.500	0,13
3.300.000	Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	USD _	3,250 %	15/08/2030	3.263.700	0,08
					81.747.657	1,92
Brasil						
	B3 S.A Brasil Bolsa Balcao	USD	4,125 %	20/09/2031	22.248.255	0,52
	Banco do Brasil S.A. <sup>(c)</sup> Banco do Brasil S.A. <sup>(c)</sup>	USD USD	9,000 %	Perp.	6.660.443	0,16
13.263.000		USD	6,250 % 4,875 %	Perp. 24/01/2030	33.050.533 13.044.558	0,78 0,31
	BRF S.A.	USD	5,750 %	21/09/2050	2.365.819	0,05
	Oi Movel S.A.	USD	8,750 %	30/07/2026	4.807.250	0,11
7.680.000	Samarco Mineracao S.A.	USD	4,125 %	01/11/2022	4.862.650	0,11
6.320.000	Samarco Mineracao S.A.	USD	5,750 %	24/10/2023	4.300.681	0,10
1.180.000	Samarco Mineracao S.A.	USD _	5,375 %	26/09/2024	808.397	0,02
					92.148.586	2,16
Islas Vírgenes		LICD	4,000 %	Dava	14 245 101	0.00
	CAS Capital No 1 Ltd. <sup>(c)</sup> Central American Bottling Corp.	USD USD	5,750 %	Perp. 31/01/2027	14.245.101 31.793.881	0,33 0,75
	China Cinda 2020 I Management Ltd.	USD	3,000 %	18/03/2027	1.255.478	0,73
	China Cinda 2020 I Management Ltd.	USD	2,500 %	20/01/2028	1.505.824	0,04
	China Cinda Finance 2017 I Ltd.	USD	4,750 %	08/02/2028	2.475.082	0,06
1.510.000	Easy Tactic Ltd.	USD	8,625 %	27/02/2024	777.650	0,02
1.430.000	Easy Tactic Ltd.	USD	8,125 %	11/07/2024	736.450	0,02
9.740.000	Elect Global Investments Ltd.(c)	USD	4,100 %	Perp.	9.822.059	0,23
	Fortune Star BVI Ltd.	EUR	3,950 %	02/10/2026	4.064.260	0,10
	FPC Resources Ltd.	USD	4,375 %	11/09/2027	3.455.600	0,08
	HKT Capital No 5 Ltd.	USD	3,250 %	30/09/2029	8.407.836	0,20
	Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	USD	4,750 %	27/04/2027	1.771.875	0,04
	Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	USD	4,250 %	07/11/2027	2.554.200	0,06
	Huarong Finance 2017 Co., Ltd. <sup>(c)</sup> Huarong Finance 2017 Co., Ltd. <sup>(c)</sup>	USD USD	4,000 % 4,500 %	Perp.	1.504.800	0,04 0,03
	Huarong Finance 2017 Co., Ltd. 67	USD	4,500 % 3,750 %	Perp. 29/05/2024	1.503.394 407.950	0,03
	Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	USD	3,250 %	13/11/2024	1.006.825	0,02
	Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	USD	3,875 %	13/11/2029	22.989.575	0,54
	Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	5,500 %	16/01/2025	6.878.625	0,16
	Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	5,000 %	19/11/2025	7.369.750	0,17
	Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	4,625 %	03/06/2026	5.135.900	0,12
	Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	4,875 %	22/11/2026	3.937.725	0,09
2.190.000	Kunzhi Ltd.	USD	6,250 %	17/10/2020	328.500	0,01
		USD	0,000 %	21/05/2021	160.500	0,00
1.070.000			0,000 /6	21/03/2021	100.000	0,00
8.440.000	Kunzni Ltd.     NWD Finance BVI Ltd. <sup>(c)</sup>   NWD Finance BVI Ltd. <sup>(c)</sup>	USD USD	4,125 % 5,250 %	Perp.	8.323.950 3.053.712	0,20 0,07

			T:	V	alor de mercado	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	en USD	% del
Bonos - (con	<u> </u>					
•	Británicas – (continuación)					
-	SF Holding Investment 2021 Ltd.	USD	3,000 %	17/11/2028	15.351.563	0,36
1.860.000	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd.	USD	4,750 %	14/01/2030	1.655.400	0,04
4.067.695	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	USD	6,750 %	24/04/2033	4.497.020	0,11
	Studio City Finance Ltd.	USD	6,000 %	15/07/2025	6.545.966	0,15
	Studio City Finance Ltd.	USD	6,500 %	15/01/2028	1.802.550	0,04
	Studio City Finance Ltd.	USD	5,000 %	15/01/2029	4.623.309	0,11
	Sunny Express Enterprises Corp. (c) Tianqi Finco Co., Ltd.	USD USD	3,350 % 3.750 %	Perp. 28/11/2022	1.004.023 4.762.964	0,02 0,11
3.040.000	manqri inco co., Ltd.	- 03D	3,730 /0	20/11/2022		
		<u>,                                      </u>			185.709.297	4,36
810 000	First Quantum Minerals Ltd.	USD	7,250 %	01/04/2023	820.631	0,02
	ShaMaran Petroleum Corp. 144A <sup>(d)</sup>	USD	12,000 %	30/07/2025	8.400.500	0,20
			,		9.221.131	0,22
Islas Caimán					9.221.131	0,22
	Agile Group Holdings Ltd. (c)	USD	8,375 %	Perp.	451.500	0,01
	Aldar Sukuk Ltd.	USD	4,750 %	29/09/2025	1.469.625	0,04
	Aldar Sukuk No 2 Ltd.	USD	3,875 %	22/10/2029	4.410.145	0,10
	Alibaba Group Holding Ltd.	USD	2,125 %	09/02/2031	12.429.325	0,29
	Baidu, Inc.	USD	3,075 %	07/04/2025	375.770	0,01
	CFLD Cayman Investment Ltd.	USD	6,900 %	13/01/2023	292.151	0,01
	China Aoyuan Group Ltd.	USD	5,980 %	18/08/2025	543.900	0,01
	China Aoyuan Group Ltd.	USD USD	5,880 %	01/03/2027	406.700	0,01
	China Evergrande Group China Evergrande Group	USD	9,500 % 11,500 %	11/04/2022 22/01/2023	138.000 430.650	0,00 0,01
	China Evergrande Group	USD	10,000 %	11/04/2023	957.950	0,01
	China Evergrande Group	USD	7,500 %	28/06/2023	151.900	0,00
	China Resources Land Ltd.	USD	4,125 %	26/02/2029	2.173.285	0,05
	China SCE Group Holdings Ltd.	USD	6,000 %	04/02/2026	3.010.800	0,07
2.920.000	Country Garden Holdings Co., Ltd.	USD	3,125 %	22/10/2025	2.613.400	0,06
5.340.000	Country Garden Holdings Co., Ltd.	USD	7,250 %	08/04/2026	5.273.250	0,12
	DP World Crescent Ltd.	USD	3,875 %	18/07/2029	2.301.480	0,05
	DP World Salaam <sup>(c)</sup>	USD	6,000 %	Perp.	14.599.487	0,34
	eHi Car Services Ltd.	USD	7,750 %	14/11/2024	2.501.900	0,06
	eHi Car Services Ltd.	USD	7,000 %	21/09/2026	2.040.600	0,05
	Embraer Overseas Ltd. Energuate Trust	USD USD	5,696 % 5,875 %	16/09/2023 03/05/2027	234.683 6.138.244	0,01 0,15
	ENN Energy Holdings Ltd.	USD	2,625 %	17/09/2030	7.081.522	0,13
	Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	USD	10,875 %	09/01/2023	240.000	0,01
	Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	USD	11,875 %	01/06/2023	260.000	0,01
	Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	USD	9,250 %	28/07/2023	135.150	0,00
2.220.000	Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	USD	10,875 %	02/03/2024	555.000	0,01
7.870.000	Grupo Aval Ltd.	USD	4,750 %	26/09/2022	8.025.305	0,19
	IHS Holding Ltd.	USD	5,625 %	29/11/2026	8.459.412	0,20
	IHS Holding Ltd.	USD	6,250 %	29/11/2028	6.922.650	0,16
10.670.000		USD	2,000 %	01/04/2025	9.062.447	0,21
4.850.000	•	USD	4,000 %	15/12/2026	4.011.576	0,10
	JD.com, Inc. JD.com, Inc.	USD USD	3,375 % 4,125 %	14/01/2030 14/01/2050	3.569.314 3.615.763	0,08 0,09
	Kaisa Group Holdings Ltd.	USD	11,500 %	30/01/2023	1.016.600	0,03
	Kaisa Group Holdings Ltd.	USD	10,875 %	23/07/2023	187.000	0,01
	Kaisa Group Holdings Ltd.	USD	11,950 %	12/11/2023	135.000	0,00
	Kaisa Group Holdings Ltd.	USD	9,375 %	30/06/2024	982.125	0,02
1.030.000	Kaisa Group Holdings Ltd.	USD	11,250 %	16/04/2025	347.625	0,01
2.350.000	King Talent Management Ltd.(c)	USD	5,600 %	Perp.	2.195.781	0,05
	KWG Group Holdings Ltd.	USD	6,000 %	14/08/2026	1.881.600	0,05
	KWG Group Holdings Ltd.	USD	7,400 %	13/01/2027	558.750	0,01
	Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	USD	4,350 %	05/04/2036	2.163.145	0,05
4.270.000		USD USD	3,050 % 5,750 %	28/10/2030	3.977.313	0,09
	Melco Resorts Finance Ltd. Melco Resorts Finance Ltd.	USD	5,750 % 5,375 %	21/07/2028 04/12/2029	11.316.705 15.416.448	0,27 0,36
	MGM China Holdings Ltd.	USD	5,375 % 5,250 %	18/06/2025	2.040.683	0,36
	MGM China Holdings Ltd.	USD	5,875 %	15/05/2026	12.084.991	0,03
	MGM China Holdings Ltd.	USD	4,750 %	01/02/2027	5.158.166	0,12
	Modern Land China Co., Ltd.	USD	11,950 %	04/03/2024	1.824.100	0,04
	Mongolian Mining Corp.	USD	0,000 %	Perp.	1.896.586	0,05
	NagaCorp Ltd.	USD	7,950 %	06/07/2024	9.920.070	0,23
5.090.000	New Oriental Education & Technology Group, Inc.	USD	2,125 %	02/07/2025	4.778.238	0,11
110 050	Peru Enhanced Pass-Through Finance Ltd.	USD	2,712 %	02/06/2025	113.688	0,00

			T: '	V	alor de mercado	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	en USD	% de patrimonio
Bonos - (con	· ·					
•	· (continuación)					
	Redsun Properties Group Ltd.	USD	9,700 %	16/04/2023	1.432.600	0,03
	Redsun Properties Group Ltd.	USD	7,300 %	13/01/2025	982.300	0,02
270.000	Ronshine China Holdings Ltd.	USD	6,750 %	05/08/2024	120.150	0,00
1.490.000	Sunac China Holdings Ltd.	USD	7,500 %	01/02/2024	1.065.350	0,03
3.640.000	Sunac China Holdings Ltd.	USD	5,950 %	26/04/2024	2.548.000	0,06
	Sunac China Holdings Ltd.	USD	6,500 %	10/01/2025	717.210	0,02
	Sunac China Holdings Ltd.	USD	7,000 %	09/07/2025	752.100	0,02
	Sunac China Holdings Ltd.	USD	6,500 %	26/01/2026	2.249.400	0,05
	Tencent Holdings Ltd.	USD	3,595 %	19/01/2028	10.393.453	0,25
	Vale Overseas Ltd.	USD USD	6,250 %	10/08/2026	7.201.178 5.008.800	0,17
	Vale Overseas Ltd. VLL International, Inc.	USD	3,750 % 7,250 %	08/07/2030 20/07/2027	8.028.292	0,12 0,19
	Wynn Macau Ltd.	USD	5,500 %	15/01/2026	16.215.000	0,18
	Wynn Macau Ltd.	USD	5,625 %	26/08/2028	18.791.771	0,44
	Yuzhou Group Holdings Co., Ltd.(c)	USD	5,375 %	Perp.	1.149.850	0,03
	Zhenro Properties Group Ltd.	USD	8,350 %	10/03/2024	567.000	0,01
	Zhenro Properties Group Ltd.	USD	7,100 %	10/09/2024	889.000	0,02
1.340.000	Zhenro Properties Group Ltd.	USD	6,700 %	04/08/2026	824.100	0,02
1.820.000	Zhenro Properties Group Ltd.(c)	USD	10,250 %	Perp.	1.510.600	0,04
		_			273.323.652	6,42
Chilo						5,72
Chile 15.880.000	CARSA	USD	3,900 %	27/04/2031	14.986.750	0,35
	Embotelladora Andina S.A.	USD	3,950 %	21/01/2050	2.098.269	0,35
	Enel Americas S.A.	USD	4,000 %	25/10/2026	8.970.603	0,05
	GNL Quintero S.A.	USD	4,634 %	31/07/2029	24.295.453	0,57
	Interchile S.A.	USD	4,500 %	30/06/2056	13.411.013	0,31
	Inversiones CMPC S.A.	USD	4,375 %	15/05/2023	1.978.353	0,05
	Inversiones CMPC S.A.	USD	4,375 %	04/04/2027	1.558.807	0,04
	Inversiones CMPC S.A.	USD	3,000 %	06/04/2031	9.656.500	0,23
2.320.000	Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A.	USD	3,625 %	03/04/2023	2.388.498	0,05
13.094.000	Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A.	USD	4,375 %	28/01/2025	13.926.549	0,33
					93.270.795	2,19
China			,			, -
	Bank of China Ltd.	USD	4,000 %	08/03/2028	310.002	0,01
	Bank of Offina Etc.		4,000 /0	00/03/2020	310.002	0,01
Colombia	2 2	1100	0.050.0/		44 000 000	0.07
	Banco Davivienda S.A. <sup>(c)</sup>	USD USD	6,650 %	Perp.	11.632.388	0,27
	Banco de Bogota S.A. Banco de Bogota S.A.	USD	5,375 % 6,250 %	19/02/2023 12/05/2026	13.044.550 57.834.400	0,31 1,36
	Banco de Bogota S.A.  Banco de Bogota S.A.	USD	4,375 %	03/08/2027	206.090	0,01
	Empresas Publicas de Medellin ESP	USD	4,250 %	18/07/2029	18.443.020	0,01
10.440.000	Empresas i abilitats de Medellin Esi	_	4,200 70	10/01/2020		
					101.160.448	2,38
Chipre						
31.550.000	MHP S.E.	USD	7,750 %	10/05/2024	32.488.691	0,76
República Dom	ninicana					
21.374.000	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI S.A.	USD	6,750 %	30/03/2029	22.486.784	0,53
Guatemala						
28.490.000	Banco Industrial S.A. <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	29/01/2031	28.365.356	0,67
Hong Kong						
	Airport Authority <sup>(c)</sup>	USD	2,100 %	Perp.	4.300.841	0,10
4.250.000	Airport Authority(c)	USD	2,400 %	Perp.	4.194.983	0,10
5.600.000	Bank of East Asia Ltd. (c)	USD	5,825 %	Perp.	5.852.000	0,14
1.470.000	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	USD	4,125 %	19/07/2027	1.598.750	0,04
	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	USD	5,125 %	14/03/2028	617.660	0,01
			3,875 %	19/06/2029	1.062.889	0,02
990.000	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	USD				
990.000 2.330.000	CNAC HK Finbridge Co., Ltd. Far East Horizon Ltd. <sup>(c)</sup>	USD	4,350 %	Perp.	2.341.650	0,06
990.000 2.330.000	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.				2.341.650 1.799.200	0,06 0,04
990.000 2.330.000	CNAC HK Finbridge Co., Ltd. Far East Horizon Ltd. <sup>(c)</sup>	USD	4,350 %	Perp.	2.341.650	0,06 0,04
990.000 2.330.000	CNAC HK Finbridge Co., Ltd. Far East Horizon Ltd. <sup>(c)</sup>	USD	4,350 %	Perp.	2.341.650 1.799.200	0,06 0,04
990.000 2.330.000 2.080.000 Hungría	CNAC HK Finbridge Co., Ltd. Far East Horizon Ltd. <sup>(c)</sup>	USD	4,350 %	Perp.	2.341.650 1.799.200	0,06 0,04 0,51
990.000 2.330.000 2.080.000 Hungría	CNAC HK Finbridge Co., Ltd. Far East Horizon Ltd. (c) Wanda Group Overseas Ltd.	USD USD _	4,350 % 8,875 %	Perp. 21/03/2023	2.341.650 1.799.200 21.767.973	0,06 0,04 0,51
990.000 2.330.000 2.080.000 Hungría 42.794.000	CNAC HK Finbridge Co., Ltd. Far East Horizon Ltd. (c) Wanda Group Overseas Ltd.	USD USD _	4,350 % 8,875 %	Perp. 21/03/2023	2.341.650 1.799.200 21.767.973	0,06 0,04 0,51 1,19
990.000 2.330.000 2.080.000 Hungría 42.794.000 India 17.250.000	CNAC HK Finbridge Co., Ltd. Far East Horizon Ltd. (c) Wanda Group Overseas Ltd.  OTP Bank Nyrt (c)	USD USD _ EUR	4,350 % 8,875 % 2,875 %	Perp. 21/03/2023 15/07/2029	2.341.650 1.799.200 21.767.973 50.488.740	0,06 0,04 0,51 1,19 0,41 0,06

			Tipo de	`	/alor de mercado en	% de
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	USD	patrimoni
Bonos – (con	tinuación)					
India – (contin	,					
4.940.000	Adani Green Energy UP Ltd. Via Prayatna Developers Pvt Ltd. Via					
0.050.000	Parampujya Solar Energy Pvt Ltd.	USD	6,250 %	10/12/2024	5.334.027	0,1
	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	USD USD	4,200 %	04/08/2027 03/07/2029	9.731.550 6.297.732	0,2 0,1
	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.  Adani Transmission Ltd.	USD	4,375 % 4,250 %	21/05/2036	2.152.829	0,1
	Future Retail Ltd.	USD	5,600 %	22/01/2025	640.054	0,0
	GMR Hyderabad International Airport Ltd.	USD	4,750 %	02/02/2026	1.278.467	0,0
	HDFC Bank Ltd.(c)	USD	3,700 %	Perp.	2.429.008	0,0
820.000	HPCL-Mittal Energy Ltd.	USD	5,450 %	22/10/2026	855.875	0,0
5.548.750	JSW Hydro Energy Ltd.	USD	4,125 %	18/05/2031	5.500.198	0,1
	Reliance Industries Ltd.	USD	5,400 %	14/02/2022	5.962.562	0,1
	Reliance Industries Ltd.	USD	4,125 %	28/01/2025	4.022.320	0,0
	Reliance Industries Ltd.	USD	3,667 %	30/11/2027	11.204.832	0,2
	ReNew Power Pvt Ltd. ReNew Power Synthetic	USD USD	6,450 % 6,670 %	27/09/2022 12/03/2024	1.600.643 1.942.994	0,0 0,0
	Yes Bank Ifsc Banking Unit Branch	USD	3,750 %	06/02/2023	5.182.866	0,0
5.250.000	res bank lise banking offic branch	030 _	3,730 /0	00/02/2023		
					88.162.751	2,0
3.915.000	ABM Investama Tbk PT	USD	7,125 %	01/08/2022	3.972.736	0,0
	ABM Investama Tbk PT	USD	9,500 %	05/08/2026	3.876.675	0,0
	Alam Sutera Realty Tbk PT	USD	8,250 %	02/11/2025	2.604.920	0,0
	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	USD	3,750 %	30/03/2026	3.551.075	0,0
	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT <sup>(c)</sup>	USD	4,300 %	Perp.	4.255.313	0,1
	Cikarang Listrindo Tbk PT	USD	4,950 %	14/09/2026	5.432.794	0,1
	Delta Merlin Dunia Tekstil PT – Serie A <sup>(e)</sup>	USD	2,500 %	26/06/2028	485.344	0,0
	Delta Merlin Dunia Tekstil PT – Serie B	USD	0,000 %	26/06/2032	265.812	0,0
	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	USD	3,398 %	09/06/2031	15.151.537	0,3
	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	USD USD	3,541 %	27/04/2032	6.208.337	0,1
	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	USD	4,745 % 4,805 %	09/06/2051 27/04/2052	4.232.800 3.733.200	0,1 0,0
	Pakuwon Jati Tbk PT	USD	4,805 % 4,875 %	29/04/2028	4.840.813	0,0
	Perusahaan Gas Negara Tbk PT	USD	4,675 % 5,125 %	16/05/2024	10.264.944	0,1
	Sri Rejeki Isman Tbk PT	USD	7,250 %	16/01/2025	389.500	0,0
	Tower Bersama Infrastructure Tbk PT	USD	4,250 %	21/01/2025	10.985.370	0,2
	Tower Bersama Infrastructure Tbk PT	USD	2,750 %	20/01/2026	9.864.332	0,2
		_			90.115.502	2,1
rlanda						
38.230.000	Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance Plc.(c)	USD	5,950 %	15/04/2030	38.612.300	0,9
7.880.000	Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc.	USD	4,700 %	29/01/2025	8.023.613	0,1
	Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc.(c)	USD	7,500 %	05/10/2027	24.699.852	0,5
	Eurotorg LLC Via Bonitron DAC	USD	9,000 %	22/10/2025	8.763.600	0,2
	Oilflow SPV 1 DAC	USD	12,000 %	13/01/2022	854.268	0,0
	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC	USD	3,050 %	23/01/2025	30.702.262	0,7
13.630.000	Tinkoff Bank JSC Via TCS Finance Ltd. (c)	USD _	6,000 %	Perp.	13.289.250	2,9
Isla de Man					124.943.143	
	AngloGold Ashanti Holdings Plc.	USD	3,375 %	01/11/2028	11.325.600	0,2
	Gohl Capital Ltd.	USD	4,250 %	24/01/2027	38.371.807	0,9
11.370.000	Sasol Financing International Ltd.	USD	4,500 %	14/11/2022	11.540.550	0,2
					61.237.957	1,4
Israel	Pank Louri La Jarcel PM 4.44A(c)(d)	HOD	2 075 0/	20/04/2004	27 544 004	0.0
	Bank Leumi Le-Israel BM 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,275 %	29/01/2031	37.514.334 5.156.038	0,8
	ICL Group Ltd. 144A <sup>(d)</sup> Leviathan Bond Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD	6,375 % 5,750 %	31/05/2038	5.156.038 26.976.958	0,1 0,6
	Leviathan Bond Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	6,750 %	30/06/2023 30/06/2030	5.054.784	0,0
	Mizrahi Tefahot Bank Ltd.(c)	USD	3,077 %	07/04/2031	19.646.523	0,1
	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	EUR	3,750 %	09/05/2027	24.934.387	0,4
		2011	5,100 /0	33/03/2021	119.283.024	2,8
Japón						
2.594.000	SoftBank Group Corp.	USD	5,125 %	19/09/2027	2.584.273	0,0
3.910.000	SoftBank Group Corp.(c)	USD _	6,000 %	Perp.	3.831.800	0,0

				v	alor de mercado	
Tenencias	Pocarinaión del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en USD	% del patrimonio
	Descripción del valor	DIVISA	Interes	recna de vencimiento	090	patrimonio
Bonos – (con Jersey	tinuacion)					
-	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,160 %	31/03/2034	8.346.195	0,20
	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,940 %	30/09/2040	8.276.937	0,19
					16.623.132	0,39
Luxemburgo						
-	Altice Financing S.A.	EUR	2,250 %	15/01/2025	22.519.068	0,53
	Altice Financing S.A.	EUR	3,000 %	15/01/2028	8.226.112	0,19
	Altice Financing S.A.	EUR	4,250 %	15/08/2029	3.937.522	0,09
	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.	USD	4,950 %	23/03/2027	3.316.275	0,08
	GTC Aurora Luxembourg S.A.	EUR	2,250 %	23/06/2026	2.655.963	0,06
	Guara Norte SARL JSM Global SARL	USD USD	5,198 % 4,750 %	15/06/2034 20/10/2030	10.036.918 5.251.245	0,24 0,12
	MHP Lux S.A.	USD	6,950 %	03/04/2026	2.997.131	0,07
	Puma International Financing S.A.	USD	5,000 %	24/01/2026	1.967.350	0,05
	Rede D'or Finance SARL	USD	4,500 %	22/01/2030	16.675.113	0,39
1.970.000	Tupy Overseas S.A.	USD	4,500 %	16/02/2031	1.796.335	0,04
		_			79.379.032	1,86
Malasia						
	Axiata Spv5 Labuan Ltd.	USD	3,064 %	19/08/2050	3.737.550	0,09
14.260.000	Genm Capital Labuan Ltd.	USD	3,882 %	19/04/2031	14.105.992	0,33
710.000	Petronas Capital Ltd.	USD _	4,800 %	21/04/2060	945.255	0,02
					18.788.797	0,44
Mauricio						
	Azure Power Energy Ltd.	USD	3,575 %	19/08/2026	2.200.950	0,05
	CA Magnum Holdings	USD USD	5,375 % 4,250 %	31/10/2026	1.520.700	0,04
	Clean Renewable Power Mauritius Pte Ltd. Greenko Investment Co.	USD	4,250 % 4,875 %	25/03/2027 16/08/2023	4.953.200 8.749.620	0,12 0,21
	HTA Group Ltd.	USD	7,000 %	18/12/2025	15.510.734	0,36
	India Airport Infrastructure	USD	6,250 %	25/10/2025	4.668.557	0,11
8.380.000	India Green Power Holdings	USD	4,000 %	22/02/2027	8.421.900	0,20
	MTN Mauritius Investments Ltd.	USD	4,755 %	11/11/2024	37.758.159	0,89
	MTN Mauritius Investments Ltd.	USD	6,500 %	13/10/2026	13.075.201	0,31
	Network i2i Ltd. <sup>(c)</sup> UPL Corp., Ltd.	USD USD	5,650 % 4,500 %	Perp. 08/03/2028	4.782.355 3.410.127	0,11 0,08
	UPL Corp., Ltd.	USD	4,625 %	16/06/2030	24.908.831	0,58
	UPL Corp., Ltd.(c)	USD	5,250 %	Perp.	8.280.668	0,19
		_			138.241.002	3,25
México						
	America Movil SAB de CV	MXN	7,125 %	09/12/2024	657.000	0,02
	Banco Mercantil del Norte S.A. <sup>(c)</sup> Banco Mercantil del Norte S.A. <sup>(c)</sup>	USD USD	5,750 % 5,875 %	04/10/2031 Perp.	20.297.238 3.683.887	0,48 0,09
	Banco Mercantil del Norte S.A.(c)	USD	6,750 %	Perp.	18.597.613	0,09
	Banco Mercantil del Norte S.A.(c)	USD	7,625 %	Perp.	2.691.012	0,06
	Banco Mercantil del Norte S.A.(c)	USD	8,375 %	Perp.	1.028.437	0,02
11.110.000	Banco Santander Mexico S.A. Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santander <sup>(c)</sup>	USD	5,950 %	01/10/2028	11.764.018	0,28
28.067.000	BBVA Bancomer S.A.(c)	USD	5,930 % 5,125 %	18/01/2033	28.586.239	0,20
	BBVA Bancomer S.A. (c)	USD	5,875 %	13/09/2034	6.459.107	0,15
	Cemex SAB de CV	USD	7,375 %	05/06/2027	10.088.524	0,24
	Cemex SAB de CV	USD	5,200 %	17/09/2030	11.476.154	0,27
	Cemex SAB de CV <sup>(c)</sup> CIBANCO S.A. Institucion de Banca Multiple Trust CIB	USD USD	5,125 % 4,375 %	Perp. 22/07/2031	12.152.212 33.546.154	0,29 0,79
	GCC SAB de CV	USD	5,250 %	23/06/2024	5.582.637	0,13
	Gruma SAB de CV	USD	4,875 %	01/12/2024	18.638.651	0,44
	Industrias Penoles SAB de CV	USD	4,750 %	06/08/2050	5.927.483	0,14
	Mexico City Airport Trust Mexico City Airport Trust	USD USD	4,250 % 3,875 %	31/10/2026 30/04/2028	18.191.275 4.462.008	0,43 0,10
	Mexico City Airport Trust  Mexico City Airport Trust	USD	5,500 %	31/10/2046	387.080	0,10
	Mexico City Airport Trust	USD	5,500 %	31/07/2047	13.296.024	0,31
	Mexico City Airport Trust 144A(d)	USD	4,250 %	31/10/2026	853.556	0,02
	Mexico City Airport Trust 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,875 %	30/04/2028	5.747.149	0,13
	Mexico City Airport Trust 144A <sup>(d)</sup> Mexico City Airport Trust 144A <sup>(d)</sup>	USD USD	5,500 % 5,500 %	31/10/2046 31/07/2047	1.461.227 3.892.980	0,03 0,09
	Petroleos Mexicanos	USD	6,490 %	23/01/2027	4.148.676	0,09
5.060.000	Petroleos Mexicanos	USD	6,500 %	13/03/2027	5.192.876	0,12
	Trust Fibra Uno	USD	6,950 %	30/01/2044	242.816	0,01
660.000	Unifin Financiera SAB de CV	USD	7,000 %	15/01/2025	562.237	0,01

			Tino do	\	/alor de mercado	0/ da
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	en USD	% de patrimonio
Bonos – (con	tinuación)					
México – (cont	inuación)					
	Unifin Financiera SAB de CV	USD	7,375 %	12/02/2026	7.372.784	0,17
2.280.000	Unifin Financiera SAB de CV	USD _	8,375 %	27/01/2028	1.874.935	0,04
					258.861.989	6,08
Marruecos	0000	USD	2.750.0/	22/06/2024	4 760 775	0.4
4.930.000 19.980.000		USD	3,750 % 5,125 %	23/06/2031 23/06/2051	4.769.775 18.874.107	0,1 <sup>2</sup> 0,4 <sup>4</sup>
	OCP S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,750 %	23/06/2031	3.840.975	0,09
	OCP S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,125 %	23/06/2051	2.456.090	0,06
2.000.000		_	0,120 /0	25/05/2501	29.940.947	0,70
Países Bajos						
9.490.000	Bharti Airtel International Netherlands BV	USD	5,350 %	20/05/2024	10.282.439	0,24
4.930.000	First Bank of Nigeria Ltd. Via FBN Finance Co., BV	USD	8,625 %	27/10/2025	5.262.775	0,12
2.314.750	Greenko Dutch BV	USD	3,850 %	29/03/2026	2.337.898	0,05
7.560.000	IHS Netherlands Holdco BV	USD	8,000 %	18/09/2027	7.985.401	0,19
2.140.000	Jababeka International BV	USD	6,500 %	05/10/2023	2.027.650	0,05
	Lukoil International Finance BV	USD	4,563 %	24/04/2023	2.688.744	0,06
	Lukoil Securities BV	USD	3,875 %	06/05/2030	41.655.707	0,98
	Metinvest BV	USD	7,750 %	23/04/2023	286.219	0,0
	Metinvest BV	EUR	5,625 %	17/06/2025	12.274.695	0,29
	Metinvest BV	USD	8,500 %	23/04/2026	14.779.805	0,35
	Metinvest BV	USD	7,650 %	01/10/2027	1.211.616	0,03
	Minejesa Capital BV	USD USD	4,625 %	10/08/2030 07/05/2029	27.107.563 22.882.135	0,64
	Mong Duong Finance Holdings BV MV24 Capital BV	USD	5,125 % 6,748 %	01/06/2034	21.940.858	0,54 0,5
	NE Property BV	EUR	1,875 %	09/10/2026	16.521.772	0,3
	NE Property BV	EUR	3,375 %	14/07/2027	13.561.871	0,3
	Petrobras Global Finance BV	USD	5,500 %	10/06/2051	9.009.177	0,2
23.200.000		USD	3,680 %	21/01/2030	23.674.730	0,56
	Prosus NV	USD	4,027 %	03/08/2050	4.235.550	0,10
3.210.000	Prosus NV	USD	3,832 %	08/02/2051	2.899.533	0,07
5.670.000	Royal Capital BV <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	Perp.	6.011.348	0,14
460.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	EUR	1,250 %	31/03/2023	514.950	0,0
490.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	EUR	1,125 %	15/10/2024	533.254	0,0
8.600.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	USD	2,800 %	21/07/2023	8.664.500	0,20
17.300.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	USD	6,000 %	15/04/2024	18.078.500	0,42
	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	USD	4,750 %	09/05/2027	17.078.625	0,40
	VEON Holdings BV	USD	3,375 %	25/11/2027	15.141.000	0,36
3.790.000	Vivo Energy Investments BV	USD _	5,125 %	24/09/2027	3.982.589	0,09
Nil and a sile					312.630.904	7,34
Nigeria 22.070.000	Access Bank Plc.	USD	6,125 %	21/09/2026	21.932.062	0,51
	Access Bank Pic. (c)	USD	9,125 %	Perp.	2.747.500	0,06
	SEPLAT Energy Plc.	USD	7,750 %	01/04/2026	27.175.200	0,64
	United Bank for Africa Plc.	USD	7,750 %	08/06/2022	2.001.071	0,05
		_			53.855.833	1,26
Noruega						
	DNO ASA 144A <sup>(d)</sup>	USD	8,375 %	29/05/2024	14.620.291	0,34
17.070.000	DNO ASA 144A <sup>(d)</sup>	USD _	7,875 %	09/09/2026	17.731.270	0,42
D-I-I-44					32.351.561	0,76
Pakistán 4 630 000	Bonos internacionales del Estado de Pakistán	USD	6,000 %	08/04/2026	4.583.700	0,11
Panamá	25.155STINGGINGG GGI EGNAG GG I ANGLATI		0,000 /0	00/04/2020	4.000.700	0,1
	Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.	USD	4,000 %	11/08/2041	4.251.803	0,10
	Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.	USD	5,125 %	11/08/2061	12.011.818	0,28
25.680.000	AES Panama Generation Holdings SRL	USD	4,375 %	31/05/2030	26.244.318	0,62
	Autoridad del Canal de Panama	USD	4,950 %	29/07/2035	246.125	0,00
	Banco Latinoamericano de Comercio Exterior S.A.	USD	2,375 %	14/09/2025	6.958.142	0,16
∠ა.∪∠∪.∪∪∪	Cable Onda S.A.	USD _	4,500 %	30/01/2030	23.673.250	0,56
					73.385.456	1,7

				V	alor de mercado	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en USD	% de
	· · ·	Divisa	interes	recha de vencimiento.	035	patrinoni
Bonos – (con Paraguay	tinuacion)					
	Banco Continental SAECA	USD	2,750 %	10/12/2025	22.480.125	0,53
30.200.000	Telefonica Celular del Paraguay S.A.	USD	5,875 %	15/04/2027	31.319.514	0,73
		_			53.799.639	1,26
Perú						
	ABY Transmision Sur S.A.	USD	6,875 %	30/04/2043	11.387.882	0,27
736.428	ABY Transmision Sur S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	6,875 %	30/04/2043	965.181	0,02
27.020.000	Consorcio Transmantaro S.A.	USD	4,700 %	16/04/2034	29.823.325	0,70
624.000	Corp. Lindley S.A.	USD	4,625 %	12/04/2023	636.316	0,01
15.500.000	Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	USD	6,375 %	01/06/2028	15.405.334	0,36
26.350.000	InRetail Consumer	USD	3,250 %	22/03/2028	25.902.050	0,61
27.230.000	SAN Miguel Industrias Pet S.A. Via NG PET R&P Latin America S.A.	USD _	3,500 %	02/08/2028	26.644.623	0,63
					110.764.711	2,60
Filipinas	Olaha Talaassa Jan (C)	HOD	4 000 0/	D	0.770.400	0.00
	Globe Telecom, Inc. (c)	USD	4,200 %	Perp.	8.779.138	0,20
	International Container Terminal Services, Inc. SMC Global Power Holdings Corp.(c)	USD USD	4,750 %	17/06/2030	11.391.116	0,27
	• .		6,500 %	Perp.	3.131.444	0,07
16.770.000	SMC Global Power Holdings Corp.(c)	USD _	7,000 %	Perp.	17.327.812	0,41
					40.629.510	0,95
5 810 000	Qatar Energy	USD	2,250 %	12/07/2031	5.737.375	0,14
	Qatar Energy	USD	3,125 %	12/07/2041	4.249.035	0,14
	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co., Ltd. III	USD	5,838 %	30/09/2027	1.848.685	0,10
	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co., Ltd. III	USD	6,332 %	30/09/2027	6.780.650	0,04
0.000.000	Tab Edital Equalica Natural Cab Co., Etc. III	_	0,002 70	00/00/2027	18.615.745	0,44
					16.015.745	0,44
Singapur 360 000	ABJA Investment Co., Pte Ltd.	USD	4,450 %	24/07/2023	372.600	0,01
	ABJA Investment Co., Pte Ltd.	USD	5,450 %	24/01/2028	26.623.550	0,63
	Continuum Energy Levanter Pte Ltd.	USD	4,500 %	09/02/2027	1.407.167	0,03
	Global Prime Capital Pte Ltd.	USD	5,950 %	23/01/2025	2.208.600	0,05
	Indika Energy Capital IV Pte Ltd.	USD	8,250 %	22/10/2025	6.613.650	0,16
	Innovate Capital Pte Ltd. – Serie MCB <sup>(c)</sup>	USD	6,000 %	11/12/2024	2.147.914	0,05
	Jollibee Worldwide Pte Ltd. (c)	USD	3,900 %	Perp.	4.198.493	0,10
17.754.660	LLPL Capital Pte Ltd.	USD	6,875 %	04/02/2039	20.316.302	0,48
1.000.000	Medco Bell Pte Ltd.	USD	6,375 %	30/01/2027	966.275	0,02
4.640.000	Modernland Overseas Pte Ltd.	USD	6,950 %	13/04/2024	2.148.761	0,05
6.470.000	Parkway Pantai Ltd. (c)	USD	4,250 %	Perp.	6.486.482	0,15
3.800.000	SSMS Plantation Holdings Pte Ltd.	USD	7,750 %	23/01/2023	2.752.520	0,07
1.820.000	Theta Capital Pte Ltd.	USD	8,125 %	22/01/2025	1.890.525	0,04
980.000	Theta Capital Pte Ltd.	USD	6,750 %	31/10/2026	960.400	0,02
11.704.500	Tiger Holdco Pte Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	13,000 %	10/06/2023	11.945.905	0,28
4.500.000	TML Holdings Pte Ltd.	USD	5,500 %	03/06/2024	4.696.875	0,11
4.100.000	TML Holdings Pte Ltd.	USD _	4,350 %	09/06/2026	4.151.250	0,10
					99.887.269	2,35
Sudáfrica	Abov Comm 144 (C)	1100	0.075.0/	5	40.770.000	2
	Absa Group Ltd.(C)	USD	6,375 %	Perp.	12.779.800	0,30
	Bidvest Group Ltd.	USD	3,625 %	23/09/2026	10.079.350	0,24
11.140.000	Growthpoint Properties International Pty Ltd.	USD _	5,872 %	02/05/2023	11.555.243	0,27
					34.414.393	0,81
Corea del Sur 8.430.000	Shinhan Financial Group Co., Ltd.(C)	USD	2,875 %	Perp.	8.314.087	0,19
España			,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,	- r		-, -
•	International Airport Finance S.A.	USD	12,000 %	15/03/2033	12.250.465	0,29
Supranacional	es					
•	African Export-Import Bank	USD	2,634 %	17/05/2026	8.164.908	0,19
	African Export-Import Bank	USD	3,798 %	17/05/2031	13.220.632	0,31
	African Export-Import Bank 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,634 %	17/05/2026	1.504.590	0,03
	ATP Tower Holdings LLC Via Andean Tower Partners Colombia SAS Via	USD	4,050 %	27/04/2026		
10.01	Andean Telecom Partners				17.317.611	0,41
10 010 000	Black Sea Trade & Development Bank	USD	3,500 %	25/06/2024	12.914.421	0,30
	0 104 10 0 1110110 111141	1100				
2.000.000	Canpack S.A. Via Canpack US LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,125 %	01/11/2025	1.987.500	0,05
2.000.000 6.687.000	Canpack S.A. Via Canpack US LLC 144A <sup>(d)</sup> Eastern & Southern African Trade & Development Bank Eastern & Southern African Trade & Development Bank	USD USD USD	3,125 % 5,375 % 4,875 %	01/11/2025 14/03/2022 23/05/2024	1.987.500 6.716.022 32.424.072	0,05 0,16 0,76

			Tipo de	`	/alor de mercado en	% de
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	USD	patrimonic
Bonos – (cont	tinuación)					
•	es – (continuación)					
	Eastern & Southern African Trade & Development Bank	USD	4,125 %	30/06/2028	5.412.395	0,13
9.890.000	Promigas S.A. ESP Via Gases del Pacifico SAC	USD _	3,750 %	16/10/2029	9.656.299	0,23
					109.318.450	2,57
Tailandia	B		0.400.0/	00/00/000	10 100 171	0.00
	Bangkok Bank PCL <sup>(c)</sup> GC Treasury Center Co., Ltd.	USD USD	3,466 % 2,980 %	23/09/2036 18/03/2031	16.128.474 5.189.664	0,38 0,12
	GC Treasury Center Co., Ltd.	USD	4,300 %	18/03/2051	2.852.451	0,12
	Krung Thai Bank PCL <sup>(c)</sup>	USD	4,400 %	Perp.	3.870.000	0,09
	Minor International PCL <sup>(c)</sup>	USD	2,700 %	Perp.	11.360.499	0,27
8.700.000	PTT Treasury Center Co., Ltd.	USD	3,700 %	16/07/2070	8.993.799	0,21
9.510.000	PTTEP Treasury Center Co., Ltd.	USD	2,993 %	15/01/2030	9.987.759	0,24
3.630.000	Thaioil Treasury Center Co., Ltd.	USD_	4,625 %	20/11/2028	4.003.990	0,09
					62.386.636	1,47
Turquía						
	Akbank TAS	USD	6,800 %	06/02/2026	19.400.000	0,46
	Akbank TAS <sup>(c)</sup> Akbank TAS <sup>(c)</sup>	USD USD	6,797 % 6,800 %	27/04/2028 22/06/2031	5.197.425 15.087.850	0,12
	Anadolu Efes Biracilik ve Malt Sanayii AS	USD	6,800 % 3,375 %	29/06/2031	44.630.350	0,35 1,05
	Coca-Cola Icecek AS	USD	4,215 %	19/09/2024	46.986.109	1,11
	Limak Iskenderun Uluslararasi Liman Isletmeciligi AS	USD	9,500 %	10/07/2036	13.006.713	0,31
	Mersin Uluslararasi Liman Isletmeciligi AS	USD	5,375 %	15/11/2024	33.569.517	0,79
14.900.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO	USD	8,125 %	28/03/2024	15.546.697	0,36
	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO	USD	5,250 %	05/02/2025	12.875.365	0,30
	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO	USD	6,500 %	08/01/2026	6.914.475	0,16
	Yapi ve Kredi Bankasi AS	USD USD	6,100 %	16/03/2023 21/06/2024	5.485.643	0,13
	Yapi ve Kredi Bankasi AS Yapi ve Kredi Bankasi AS	USD	5,850 % 8,250 %	15/10/2024	3.924.112 27.193.987	0,09 0,64
	Yapi ve Kredi Bankasi AS <sup>(c)</sup>	USD	7,875 %	22/01/2031	26.516.200	0,62
	Yapi ve Kredi Bankasi AS <sup>(c)</sup>	USD	13,875 %	Perp.	20.372.000	0,48
		_			296.706.443	6,97
340.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	7,750 %	01/09/2022	343.060	0,01
	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	7,750 %	01/09/2023	1.263.750	0,03
1.380.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD _	7,750 %	01/09/2024	1.382.957	0,03
					2.989.767	0,07
Emiratos Árabe		USD	4 600 9/	02/11/2047	4.001.400	0.10
	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC DP World Plc.	USD	4,600 % 5,625 %	02/11/2047 25/09/2048	4.001.400 2.141.562	0,10 0,05
	DP World Plc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	6,850 %	02/07/2037	842.402	0,02
	National Central Cooling Co., PJSC	USD	2,500 %	21/10/2027	35.474.025	0,83
	NBK Tier 1 Financing 2 Ltd.(c)	USD	4,500 %	Perp.	38.782.897	0,91
		_			81.242.286	1,91
Reino Unido						
6.120.000	Endeavour Mining Plc.	USD	5,000 %	14/10/2026	6.089.400	0,14
25.240.000	Gazprom PJSC Via Gaz Finance Plc.	USD	3,000 %	29/06/2027	24.766.750	0,58
	Gazprom PJSC Via Gaz Finance Plc.	USD	2,950 %	27/01/2029	16.277.252	0,38
	Gazprom PJSC Via Gaz Finance Plc.(c)	USD	4,599 %	Perp.	15.502.575	0,36
	Vedanta Resources Finance II Plc.	USD	8,000 %	23/04/2023	565.982	0,01
	Vedanta Resources Finance II Plc.	USD	8,950 %	11/03/2025	5.294.557	0,13
	Vedanta Resources Finance II Plc.	USD	9,250 %	23/04/2026	3.339.250	0,08
	Vedanta Resources Ltd. Vedanta Resources Ltd.	USD USD	7,125 % 6,125 %	31/05/2023 09/08/2024	7.223.531 12.118.872	0,17 0,29
14.040.000	vedanta Nesources Ltd.	035_	0,125 /0	09/00/2024	91.178.169	2,14
Estados Unido	s					_,
	Austin BidCo, Inc.	USD	7,125 %	15/12/2028	3.787.875	0,09
	Azul Investments LLP	USD	5,875 %	26/10/2024	1.861.967	0,04
	Azul Investments LLP	USD	7,250 %	15/06/2026	5.602.747	0,13
	Hikma Finance USA LLC	USD	3,250 %	09/07/2025	15.134.100	0,36
14.640.000			7,125 %	04/04/2026	27.494.450	0,65
	Kosmos Energy Ltd.	USD	7,125 70	04/04/2020	21.434.430	0,00
28.790.000	Kosmos Energy Ltd. Kosmos Energy Ltd.	USD	7,750 %	01/05/2027	6.212.250	0,05
28.790.000 6.600.000 1.820.000	Kosmos Energy Ltd. Kosmos Energy Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD	7,750 % 7,125 %	01/05/2027 04/04/2026	6.212.250 1.738.100	0,15 0,04
28.790.000 6.600.000 1.820.000 4.770.000	Kosmos Energy Ltd.	USD	7,750 %	01/05/2027	6.212.250	0,15

			Tipo de	`	Valor de mercado en	% de
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	USD	patrimonio
Bonos - (con	•					
	es – (continuación)					
	Sasol Financing USA LLC	USD	5,875 %	27/03/2024	41.543.262	0,98
	Sasol Financing USA LLC	USD	6,500 %	27/09/2028	409.450	0,01
	SK Battery America, Inc.	USD	2,125 %	26/01/2026	11.480.363	0,27
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	0,375 %	31/12/2025	6.510.652	0,15
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	0,750 %	31/01/2028	4.800.533	0,1
6.640.000	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD _	3,125 %	15/11/2028	7.438.875	0,17
					145.551.693	3,42
Uzbekistán 4.150.000	National Bank of Uzbekistan	USD	4,850 %	21/10/2025	4.219.554	0,10
Venezuela						
35.140.000	Petroleos de Venezuela S.A.	USD	6,000 %	28/10/2022	1.405.600	0,04
2.440.000	Petroleos de Venezuela S.A.	USD	6,000 %	15/11/2026	118.340	0,00
					1.523.940	0,04
Vietnam				-		
6.970.000	Viet Nam Debt & Asset Trading Corp.	USD	1,000 %	10/10/2025	6.375.215	0,15
TOTAL DE BOI (coste USD 3.8					3.782.758.536	88,85
					/alor de mercado	
					en	% de
Tenencias	Descripción del valor				USD	patrimonic
Acciones ord Mongolia	inarias – 0,00 %					
_	Mongolian Mining Corp.				198.731	0,00
TOTAL DE ACC	CIONES ORDINARIAS 2.046)				198,731	0,00
	versión – 3,47 %					-,
Irlanda	70101011 0,41 70					
	Coldman Sacha LISS Traccury Liquid Bosonyon Fund (Class)	do aggionas do distribusi	Sp. ∨\(f)(a)		147.654.057	3,47
	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase	ue acciones de distribuci	) ( ) ( ) ( ) ( ) ( ) ( ) ( ) ( ) ( ) (		147.054.057	3,47
TOTAL DE FOR (coste USD 14)	NDOS DE INVERSIÓN 7.654.057)				147.654.057	3,47
	ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA	BOLSA DE VALORES O	FICIAL		0.000.044.004	20.00
(coste USD 3.9	//1./15.986)				3.930.611.324	92,32
			Tipo de	`		
Tenencias	Descripción del valor	Divisa		(le)	/alor de mercado en	% de
Valores mobil		Diviou	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>		
	liarios negociados en otro mercado regulado	Dividu	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en	
Bonos - 2,38		217134	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en	
Bonos – 2,38 Bermudas		5,000	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en	
Bermudas		USD	interés <sup>(a)</sup> 8,000 %	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup> 01/04/2025	en	patrimonio
Bermudas 1.691.916	%				en USD	patrimonio
Bermudas 1.691.916 Canadá	% Digicel Group Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	8,000 %	01/04/2025	1.603.416	patrimonic
Bermudas 1.691.916 Canadá 28.550.000	%				en USD	patrimonic
1.691.916  Canadá  28.550.000  Islas Caimán	% Digicel Group Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> First Quantum Minerals Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	8,000 % 7,250 %	01/04/2025	1.603.416 28.924.719	0,04 0,68
Bermudas	% Digicel Group Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> First Quantum Minerals Ltd. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD	8,000 % 7,250 %	01/04/2025 01/04/2023 01/02/2026	1.603.416 28.924.719 9.626.191	0,04 0,68
Bermudas	% Digicel Group Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> First Quantum Minerals Ltd. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD	8,000 % 7,250 % 2,802 % 0,500 %	01/04/2025 01/04/2023 01/02/2026 01/02/2027	1.603.416 28.924.719 9.626.191 6.652.475	0,04 0,68 0,22 0,16
Bermudas	% Digicel Group Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> First Quantum Minerals Ltd. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD	8,000 % 7,250 %	01/04/2025 01/04/2023 01/02/2026	1.603.416 28.924.719 9.626.191	0,04 0,68 0,22 0,16
Bermudas	% Digicel Group Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> First Quantum Minerals Ltd. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD	8,000 % 7,250 % 2,802 % 0,500 %	01/04/2025 01/04/2023 01/02/2026 01/02/2027	1.603.416 28.924.719 9.626.191 6.652.475	0,04 0,68 0,22 0,16 0,51
Bermudas	% Digicel Group Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> First Quantum Minerals Ltd. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD	8,000 % 7,250 % 2,802 % 0,500 %	01/04/2025 01/04/2023 01/02/2026 01/02/2027	1.603.416 28.924.719 9.626.191 6.652.475 21.666.120	0,04 0,68 0,22 0,16 0,51
Bermudas	% Digicel Group Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> First Quantum Minerals Ltd. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Vnet Group, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD USD	8,000 %  7,250 %  2,802 % 0,500 % 5,674 %	01/04/2025 01/04/2023 01/02/2026 01/02/2027 01/02/2026	9.626.191 6.652.475 21.666.120 37.944.786	0,04 0,68 0,22 0,16 0,51
Bermudas	% Digicel Group Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> First Quantum Minerals Ltd. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD	8,000 % 7,250 % 2,802 % 0,500 %	01/04/2025 01/04/2023 01/02/2026 01/02/2027	1.603.416 28.924.719 9.626.191 6.652.475 21.666.120	0,04 0,68 0,22 0,16 0,51
Bermudas	% Digicel Group Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> First Quantum Minerals Ltd. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Vnet Group, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD USD	8,000 %  7,250 %  2,802 % 0,500 % 5,674 %	01/04/2025 01/04/2023 01/02/2026 01/02/2027 01/02/2026	9.626.191 6.652.475 21.666.120 37.944.786	0,04 0,68 0,22 0,16 0,5
Bermudas	% Digicel Group Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> First Quantum Minerals Ltd. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Vnet Group, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD USD	8,000 %  7,250 %  2,802 % 0,500 % 5,674 %	01/04/2025 01/04/2023 01/02/2026 01/02/2027 01/02/2026	9.626.191 6.652.475 21.666.120 37.944.786	0,04 0,68 0,22 0,11 0,5
Bermudas	% Digicel Group Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> First Quantum Minerals Ltd. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Vnet Group, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Banco Industrial S.A. Via Guatemala 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD USD USD USD USD USD	8,000 %  7,250 %  2,802 % 0,500 % 5,674 %	01/04/2025 01/04/2023 01/02/2026 01/02/2027 01/02/2026 29/01/2031	9.626.191 6.652.475 21.666.120 37.944.786	0,04 0,68 0,22 0,11 0,5
Bermudas	% Digicel Group Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> First Quantum Minerals Ltd. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Vnet Group, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Banco Industrial S.A. Via Guatemala 144A <sup>(c)(d)</sup> Tupy Overseas S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD USD	8,000 %  7,250 %  2,802 % 0,500 % 5,674 %  4,875 %	01/04/2025 01/04/2023 01/02/2026 01/02/2027 01/02/2026 29/01/2031	1.603.416 28.924.719 9.626.191 6.652.475 21.666.120 37.944.786 2.668.275	0,04 0,68 0,22 0,11 0,5 0,88
Bermudas	% Digicel Group Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> First Quantum Minerals Ltd. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Vnet Group, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Banco Industrial S.A. Via Guatemala 144A <sup>(c)(d)</sup> Tupy Overseas S.A. 144A <sup>(d)</sup> Cemex SAB de CV 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD USD USD USD USD USD	8,000 %  7,250 %  2,802 % 0,500 % 5,674 %  4,875 %  4,500 %  5,125 %	01/04/2025 01/04/2023 01/02/2026 01/02/2027 01/02/2026 29/01/2031 16/02/2031	9.626.191 6.652.475 21.666.120 37.944.786 2.668.275 319.146	0,04 0,68 0,22 0,14 0,55 0,88 0,06
Bermudas	% Digicel Group Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> First Quantum Minerals Ltd. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Vnet Group, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Banco Industrial S.A. Via Guatemala 144A <sup>(c)</sup> Tupy Overseas S.A. 144A <sup>(d)</sup> Cemex SAB de CV 144A <sup>(c)</sup> Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD USD USD USD USD	8,000 %  7,250 %  2,802 % 0,500 % 5,674 %  4,875 %  4,500 %  5,125 % 3,800 %	01/04/2025 01/04/2023 01/02/2026 01/02/2027 01/02/2026 29/01/2031 16/02/2031 Perp. 08/04/2024	1.603.416  28.924.719  9.626.191 6.652.475 21.666.120 37.944.786  2.668.275  319.146  5.518.200 316.176	0,04 0,68 0,05 0,00 0,00
Bermudas	% Digicel Group Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> First Quantum Minerals Ltd. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Vnet Group, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Banco Industrial S.A. Via Guatemala 144A <sup>(c)(d)</sup> Tupy Overseas S.A. 144A <sup>(d)</sup> Cemex SAB de CV 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD USD USD USD USD USD	8,000 %  7,250 %  2,802 % 0,500 % 5,674 %  4,875 %  4,500 %  5,125 %	01/04/2025 01/04/2023 01/02/2026 01/02/2027 01/02/2026 29/01/2031 16/02/2031	9.626.191 6.652.475 21.666.120 37.944.786 2.668.275 319.146	0,04 0,68 0,22 0,16 0,5 0,88 0,06
Bermudas	% Digicel Group Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> First Quantum Minerals Ltd. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Vnet Group, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Banco Industrial S.A. Via Guatemala 144A <sup>(c)</sup> (d)  Tupy Overseas S.A. 144A <sup>(d)</sup> Cemex SAB de CV 144A <sup>(c)</sup> (d)  Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV 144A <sup>(d)</sup> Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV 144A <sup>(d)</sup> Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV 144A <sup>(d)</sup>	USD  USD  USD  USD  USD  USD  USD  USD	8,000 %  7,250 %  2,802 % 0,500 % 5,674 %  4,875 %  4,500 %  5,125 % 3,800 % 3,250 %	01/04/2025 01/04/2023 01/02/2026 01/02/2027 01/02/2026 29/01/2031 16/02/2031 Perp. 08/04/2024 12/03/2025	1.603.416  28.924.719  9.626.191 6.652.475 21.666.120  37.944.786  2.668.275  319.146  5.518.200 316.176 932.422 1.735.982	0,04  0,68  0,22  0,16  0,51  0,89  0,06  0,01  0,13  0,01  0,02  0,04
Bermudas	% Digicel Group Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> First Quantum Minerals Ltd. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Vnet Group, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Banco Industrial S.A. Via Guatemala 144A <sup>(c)</sup> (d)  Tupy Overseas S.A. 144A <sup>(d)</sup> Cemex SAB de CV 144A <sup>(c)</sup> (d)  Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV 144A <sup>(d)</sup> Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV 144A <sup>(d)</sup> Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV 144A <sup>(d)</sup>	USD  USD  USD  USD  USD  USD  USD  USD	8,000 %  7,250 %  2,802 % 0,500 % 5,674 %  4,875 %  4,500 %  5,125 % 3,800 % 3,250 %	01/04/2025 01/04/2023 01/02/2026 01/02/2027 01/02/2026 29/01/2031 16/02/2031 Perp. 08/04/2024 12/03/2025	9.626.191 6.652.475 21.666.120 37.944.786 2.668.275 319.146 5.518.200 316.176 932.422	0,0 0,6 0,2 0,1 0,5 0,8 0,0

				•	/alor de mercado	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en USD	% de patrimoni
Bonos – (con	ntinuación)					
Panamá <sup>`</sup>	·					
	Cable Onda S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,500 %	30/01/2030	2.488.674	0,0
Paraguay 1.140.000	Telefonica Celular del Paraguay S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,875 %	15/04/2027	1.182.260	0,0
Perú						
1.350.000 Catar	Consorcio Transmantaro S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,700 %	16/04/2034	1.490.062	0,0
	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co., Ltd. III 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,838 %	30/09/2027	560.837	0,0
Supranaciona						
5.630.000	ATP Tower Holdings LLC Via Andean Tower Partners Colombia SAS Via Andean Telecom Partners 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,050 %	27/04/2026	5.577.697	0,1
6.375.136	Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	13,000 %	31/12/2025	6.539.057	0,1
3.569.711	Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd.	USD	8,000 %	31/12/2026	3.482.699	0,0
	144A <sup>(d)</sup>	-			15.599.453	0,3
TOTAL DE BO						-
(coste USD 10	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·				101.284.408	2,3
TOTAL DE VAI (coste USD 10	LORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO 4.577.892)	)			101.284.408	2,3
VALOR DE ME (coste USD 4.0	ERCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS 076.293.878)				4.031.895.732	94,7
Contratos de	futuros – 0,12 %					
				Compromiso		
Número de				Valor de mercado en	Plusvalía latente	% de
contratos	Descripción del valor			USD	USD	patrimoni
	USD					
	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022		Larga	90.054.625	2.192.539	0,0
	Pruturos sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022		Larga	164.705.626 119.869.883	484.543 1.213.655	0,0
	Futuros sobre pagares del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022		Larga Larga	120.449.250	3.490.141	0,0
	Pruturos sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años		-	16.462.250	339.999	0,0
				511.541.634	7.720.877	0,18
PLUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS				7.720.877	0,18
				Valor de mercado	Minusvalía	
Número de contratos	Descripción del valor			de la asignación USD	latente USD	% de patrimonie
	USD					patimoni
(1.164)	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022		Corta	(152.556.750)	(2.397.836)	(0,06
	ATTUTE CORDE CONTRATOS DE FUTUROS			-	(2.397.836)	(0.00
MINUSVALÍA I	LATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS					(0,06
	e divisas a plazo – (0,03 %)					(0,06
						(0,06
					Minusvalía	
Contratos de	e divisas a plazo – (0,03 %)  Compra Divisa Venta			Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% de patrimonio
Contratos de Divisa USD	Compra         Divisa         Venta           161.276.931         EUR         142.706.530			Fecha de vencimiento 10/02/2022	Minusvalía latente	% de patrimonio
Contratos de Divisa USD	e divisas a plazo – (0,03 %)  Compra Divisa Venta				Minusvalía latente USD	% de patrimonio (0,03
Contratos de Divisa USD MINUSVALÍA I PLAZO	Compra         Divisa         Venta           161.276.931         EUR         142.706.530				Minusvalia latente USD (1.471.480)	% de patrimonio (0,03
Contratos de Divisa USD MINUSVALÍA I PLAZO	Compra Divisa Venta   161.276.931   EUR   142.706.530				Minusvalia latente USD (1.471.480) (1.471.480)	% de patrimoni (0,03
Contratos de Divisa USD MINUSVALÍA I PLAZO	Compra Divisa Venta   161.276.931   EUR   142.706.530				Minusvalia latente USD (1.471.480)	% de patrimonio (0,03 (0,03 % de
Divisa USD MINUSVALÍA I PLAZO Contratos de	c divisas a plazo – (0,03 %)  Compra Divisa Venta  161.276.931 EUR 142.706.530  LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  e divisas a plazo específicos de una clase de acciones – 0,23 %  Compra Divisa Venta  10.780.370 USD 1.918.999			10/02/2022  Fecha de vencimiento 02/12/2021	Minusvalia latente USD (1.471.480) (1.471.480)	% de patrimonio (0,03 % de patrimonio 0,00
Divisa USD MINUSVALÍA I PLAZO Contratos de Divisa BRIL USD	Compra   Divisa   Venta   161.276.931   EUR   142.706.530			10/02/2022  Fecha de vencimiento  02/12/2021 04/01/2022	Minusvalia latente USD (1.471.480)  Plusvalia latente USD 5.930 737	% de patrimonio (0,03 (0,03 % de patrimonio 0,0 0,0 0,0 0,0 )
Divisa USD MINUSVALÍA I PLAZO Contratos de Divisa BRI USD USD	Compra   Divisa   Venta			Fecha de vencimiento 02/12/2021 04/01/2022 21/01/2022	Minusvalia latente USD (1.471.480)  Plusvalia latente USD 5.930 737 6.623	% de patrimoni (0,03 (0,03 (0,03 % de patrimoni 0,0 0,0 0,0
Divisa USD MINUSVALÍA I PLAZO Contratos de Divisa BRL USD USD USD	Compra   Divisa   Venta			Fecha de vencimiento 02/12/2021 04/01/2022 21/01/2022 31/01/2022	Minusvalia latente USD (1.471.480)  (1.471.480)  Plusvalia latente USD 5.930 737 6.623 58	% de patrimonio (0,03 (0,03 (0,03 (0,03 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,0) (0,00 (0,0) (0,00 (0,0) (0,00 (0,0) (0,0) (0,00 (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0
Divisa USD MINUSVALÍA I PLAZO Contratos de Divisa BRIL USD USD	Compra   Divisa   Venta			Fecha de vencimiento 02/12/2021 04/01/2022 21/01/2022	Minusvalia latente USD (1.471.480)  Plusvalia latente USD 5.930 737 6.623	% de patrimonio (0,03 % de patrimonio (0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones – (continua	ción)
-------------------------------------------------------------------------------	-------

Divisa	Compra Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% del patrimonio
USD	1.923.438 BRL	10.780.370		02/12/2021	(1.489)	(0,00)
BRL	9.663.131 USD	1.713.984		04/01/2022	(590)	(0,00)
GBP	94.536.226 USD	130.081.780		21/01/2022	(3.677.036)	(0,09)
CHF	2.213.550 USD	2.426.114		25/01/2022	(4.439)	(0,00)
USD	42.991 CHF	39.519		25/01/2022	(243)	(0,00)
AUD	9.991.526 USD	7.398.775		31/01/2022	(238.545)	(0,00)
SGD	81.666.226 USD	60.511.761		07/02/2022	(645.591)	(0,02)
USD	7.328.519 EUR	6.493.000		10/02/2022	(76.366)	(0,00)
MINUSVALÍA LATE	NTE SOBRE CONTRATOS DE DIV	ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE C	OBERTURA		(4.644.299)	(0,11)
Contratos de per	mutas financieras – 0,04 %				Plusvalía	
Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	latente en USD	% del patrimonio
	Permutas de tipos de interés					
71.380.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2024	350.202	0,01
	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2026	302.167	0,01
15.740.000	Fijo 0,000 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2028	166.312	0,00
3.020.000	Fijo 0,000 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2031	38.020	0,00
PLUSVALÍA LATEN	ITE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS	DE INTERÉS			856.701	0,02
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)					
12.670.000	Variable (Bonos internacionales de Estado de Indonesia)	I Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	232.666	0,01
23.070.000	Variable (Bonos internacionales de Estado de Abu Dabi)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2025	232.557	0,01
10.480.000	Variable (Bonos internacionales de Estado de Indonesia)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2025	109.002	0,00
22.940.000	Variable (Bonos internacionales de Estado de Catar)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2025	196.902	0,00
10.680.000	Variable (Bonos extranjeros rusos	- Fijo 1,000 %	USD	20/06/2025	120.834	0,00

	NTE SOBRE PERMUTAS DE CREDITICIO (CDS)				1.583.902	0,04
32.450.000	Variable (Bonos internacionales del Estado saudí)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	2.336	0,00
18.870.000	Variable (Bonos internacionales del Estado saudí)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	236.227	0,01

Fijo 1,000 %

Fijo 1,000 %

Eurobono) 23.640.000 Variable (Bonos internacionales del

Estado saudí)

19.340.000 Variable (Bonos internacionales del Estado de Indonesia)

TOTAL DE PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE PERMUTAS FINANCIERAS

USD

USD

Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% de patrimonio
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)					
10.590.000	Fijo 0,000 %	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2021	(1.500)	(0,00
42.370.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Chile)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	(518.456)	(0,01
32.720.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Indonesia)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(219.317)	(0,01)
85.990.000	Variable (iTraxx Asia ex-Japan IG Serie 36 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(59.181)	(0,00
MINUSVALÍA LATE INCUMPLIMIENTO	NTE SOBRE PERMUTAS DE CREDITICIO (CDS)				(798.454)	(0,02
TOTAL DE MINUSV DE PERMUTAS FIN	ALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS IANCIERAS	•			(798.454)	(0,02
VALOR DE MERCA (coste USD 4.076.2	DO DE LAS INVERSIONES 93.878)			4	.047.143.134	95,06
OTROS ACTIVOS Y	PASIVOS		-		210.456.749	4,94
PATRIMONIO				4	.257.599.883	100,00

20/06/2025

20/12/2025

339.300

114.078

2.440.603

0,01

0,00

0,06

TOTAL DE INVERSIONES	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Total inversiones excluyendo derivados (coste USD 4.076.293.878)	4.031.895.732	94,70
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	7.720.877	0,18
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(2.397.836)	(0,06)
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	(1.471.480)	(0,03)
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	14.397.991	0,34
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	(4.644.299)	(0,11)
Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	2.440.603	0,06
Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	(798.454)	(0,02)
Otros activos y pasivos	210.456.749	4,94
Patrimonio	4.257.599.883	100,00

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Australia & New Zealand Banking Group Ltd., Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Natwest Markets Plc., Royal Bank of Canada, Standard Chartered Bank, State Street Bank & Trust y UBS AG.

La contraparte de los contratos de permutas financieras fue Barclays Bank Plc.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,20 %.

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (d) 144A. La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (e) Este título tiene un cupón escalonado que pasará al segundo tipo en una fecha determinada del futuro.
- (f) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- (g) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de patrimonio
		DIVISA	ripo de interes	recha de vencimiento	030	patrinonic
Valores mobil Bonos – 83,73 Angola	iarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial 3 %					
-	Bonos internacionales del Estado de Angola	USD	8,250 %	09/05/2028	340.668	0,05
	Bonos internacionales del Estado de Angola	USD	8,000 %	26/11/2029	1.340.682	0,20
470.000	Bonos internacionales del Estado de Angola	USD	9,125 %	26/11/2049	420.081	0,07
		_			2.101.431	0,32
Argentina						
	Arcor SAIC	USD	6,000 %	06/07/2023	853.553	0,13
	Bonos internacionales del Estado de Argentina	EUR	0,500 %	09/07/2029	4.062	0,00
	Bonos internacionales del Estado de Argentina Bonos internacionales del Estado de Argentina <sup>(c)</sup>	USD EUR	1,000 % 0.125 %	09/07/2029 09/07/2030	89.580 105.041	0,01 0,02
	Bonos internacionales del Estado de Argentina <sup>(d)</sup>	USD	0,123 %	09/07/2030	631.721	0,02
	Bonos internacionales del Estado de Argentina <sup>(d)</sup>	USD	0,500 % 1,125 %	09/07/2035	198.962	0,10
	Bonos internacionales del Estado de Argentina <sup>(d)</sup>	USD		09/07/2033	233.660	0,03
	Bonos internacionales del Estado de Argentina <sup>(d)</sup>	USD	2,500 % 1,125 %	09/07/2041	147.350	0,02
	Cia General de Combustibles S.A.	USD	9,500 %	08/03/2025	1.221.206	0,02
		USD	9,500 % 8,750 %	23/03/2023	695.100	0,10
	IRSA Propiedades Comerciales S.A. Tecpetrol S.A.	USD	4,875 %	12/12/2022	440.785	0,11
	Telecom Argentina S.A.	USD	4,875 % 8,500 %	06/08/2025	340.254	0,07
	YPF S.A.	USD	6,950 %	21/07/2027	208.255	0,03
	YPF S.A.	USD	8,500 %	27/06/2029	280.164	0,04
	YPF S.A.	USD	7,000 %	15/12/2047	204.451	0,04
330.000	IFI S.A.	- 03D	7,000 78	13/12/204/	5.654.144	0.86
Armenia					0.004.144	0,00
390.000	Bono internacional de Armenia	USD	3,950 %	26/09/2029	374.790	0,06
Australia	Control Finance Ltd	Heb	E 250 W	42/02/2020	1 202 606	0.10
	Santos Finance Ltd.	USD	5,250 %	13/03/2029	1.203.686	0,18
Azerbaiyán 460 000	Bonos internacionales de Azerbaiyán	USD	3,500 %	01/09/2032	460.192	0,07
Baréin	Bollos illelliacionales de Azerbaiyan	030	3,300 /6	01/09/2032	400.192	0,07
	Bonos internacionales del Estado de Baréin	USD	4,250 %	25/01/2028	358.437	0,05
	Bonos internacionales del Estado de Baréin	USD	7,375 %	14/05/2030	306.261	0,05
	Bonos internacionales del Estado de Baréin	USD	5,625 %	30/09/2031	845.588	0,13
	Bonos internacionales del Estado de Baréin	USD	5,450 %	16/09/2032	596.925	0,09
	Bonos internacionales del Estado de Baréin	USD	5,250 %	25/01/2033	334.350	0,05
1.950.000	Bonos internacionales del Estado de Baréin	USD	5,625 %	18/05/2034	1.840.312	0,28
440.000	CBB International Sukuk Programme Co., WLL	USD_	3,950 %	16/09/2027	441.100	0,07
					4.722.973	0,72
Bielorrusia 290.000	Bonos internacionales de Bielorrusia	USD	6,200 %	28/02/2030	238.960	0,04
Belice						
2.557	Bonos internacionales del Estado de Belice <sup>(c)</sup>	USD	4,938 %	20/02/2034	1.321	0,00
Benín 550 000	Bonos internacionales del Estado de Benín	EUR	4,875 %	19/01/2032	599.220	0,09
	Bonos internacionales del Estado de Benín	EUR	4,950 %	22/01/2035	785.862	0,08
	Bonos internacionales del Estado de Benín	EUR	6,875 %	19/01/2052	111.225	0,02
					1.496.307	0,23
Bermudas	Parasitation advantage del Estado d. C.	1100	0.075.01	20/20/20==	045.000	0.55
	Bonos internacionales del Estado de Bermudas	USD	3,375 %	20/08/2050	315.360	0,05
	Digicel Group Holdings Ltd.	USD	10,000 %	01/04/2024	293.353	0,04
	Geopark Ltd.	USD	5,500 %	17/01/2027	762.092	0,12
	Sagicor Financial Co., Ltd. Star Energy Geothermal Darajat II Via Star Energy Geothermal Salak	USD	5,300 %	13/05/2028	611.240	0,09
	Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	USD USD	4,850 % 2,625 %	14/10/2038 15/08/2025	529.641 1.510.875	0,08 0,23
	Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.  Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	USD	2,625 % 4,000 %	15/08/2025	212.250	0,23
200.000	rengizenevion i mance co. international ciu.	035_	4,000 /8	13/00/2020	4.234.811	0,6
Brasil						
	B3 S.A Brasil Bolsa Balcao	USD	4,125 %	20/09/2031	874.670	0,13
	Banco do Brasil S.A.(c)	USD	9,000 %	Perp.	516.395	0,08
1 420 000	Banco do Brasil S.A.(c)	USD	6,250 %	Perp.	1.366.679	0,21
36.891.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional – Serie F Brazil Notas do Tesouro Nacional – Serie F	BRL BRL	10,000 % 10,000 %	01/01/2025 01/01/2027	6.592.912 6.601.977	1,00 1,00

enencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de
Bonos – (con	· ·	Divisa	ripo de interes	r echa de vencimiento		patrimonic
Brasil – (contir	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					
25.101.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional – Serie F	BRL	10,000 %	01/01/2029	4.349.598	0,66
2.045.000	Bonos internacionales del Estado de Brasil	USD	4,500 %	30/05/2029	2.041.386	0,31
	Bonos internacionales del Estado de Brasil	USD	4,750 %	14/01/2050	539.360	0,08
	BRF S.A.	USD	4,875 %	24/01/2030	865.506	0,13
	Oi Movel S.A. Samarco Mineracao S.A.	USD USD	8,750 % 5,750 %	30/07/2026 24/10/2023	205.000 319.829	0,03 0,05
	Samarco Mineracao S.A.	USD	5,375 %	26/09/2024	431.602	0,00
		_			24.704.914	3,74
slas Vírgenes			4.000.0/		050.145	0.44
	CAS Capital No 1 Ltd. (c) Central American Bottling Corp.	USD USD	4,000 % 5,750 %	Perp. 31/01/2027	653.445 1.372.987	0,1 0,2
	China Cinda 2020 I Management Ltd.	USD	3,000 %	18/03/2027	202.497	0,0
	China Cinda 2020 I Management Ltd.	USD	2,500 %	20/01/2028	195.562	0,0
	Easy Tactic Ltd.	USD	8,125 %	11/07/2024	175.100	0,0
	Elect Global Investments Ltd.(c)	USD	4,100 %	Perp.	413.454	0,0
100.000	Fortune Star BVI Ltd.	EUR	3,950 %	02/10/2026	108.380	0,0
	Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	USD	4,750 %	27/04/2027	202.500	0,0
	Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	USD	4,250 %	07/11/2027	198.000	0,0
	Huarong Finance 2017 Co., Ltd.(c)	USD	4,000 %	Perp.	336.600	0,0
	Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	USD	3,750 %	29/05/2024	199.000	0,0
	Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	USD	3,375 %	24/02/2030	298.400 300.875	0,0
	Huarong Finance II Co., Ltd. Huarong Finance II Co., Ltd.	USD USD	5,500 % 5,000 %	16/01/2025 19/11/2025	1.158.250	0,0 0,1
	Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	4,625 %	03/06/2026	406.000	0,0
	Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	4,875 %	22/11/2026	702.075	0,0
	Kunzhi Ltd.	USD	6,250 %	17/10/2020	54.000	0,0
	NWD Finance BVI Ltd.	USD	4,125 %	Perp.	325.462	0,0
	NWD Finance BVI Ltd.(c)	USD	5,250 %	Perp.	290.830	0,0
310.000	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd.	USD	4,750 %	14/01/2030	275.900	0,0
360.000	Studio City Finance Ltd.	USD	6,000 %	15/07/2025	352.777	0,0
	Sunny Express Enterprises Corp.(c)	USD	3,350 %	Perp.	223.116	0,0
	Tianqi Finco Co., Ltd.	USD	3,750 %	28/11/2022	189.007	0,0
1.000.000	TSMC Global Ltd.	USD _	2,250 %	23/04/2031	9.634.897	0,15
Camerún					9.034.097	1,40
	Bonos internacionales de Camerún	EUR	5,950 %	07/07/2032	602.769	0,09
330 000	ShaMaran Petroleum Corp. 144A <sup>(e)</sup>	USD	12,000 %	30/07/2025	326.906	0,05
	- Chamaran Caolean Corp. 1447			00/01/2020		
slas Caimán						
slas Caimán 600.000	Aldar Sukuk No 2 Ltd.		3.875 %	22/10/2029		0,10
600.000	Aldar Sukuk No 2 Ltd. China Aoyuan Group Ltd.	USD USD	3,875 % 5,880 %	22/10/2029 01/03/2027	646.965 53.900	
600.000 220.000		USD			646.965	0,10
600.000 220.000 260.000	China Aoyuan Group Ltd.	USD USD	5,880 %	01/03/2027	646.965 53.900	0,1 0,0
600.000 220.000 260.000 350.000 1.530.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd.	USD USD USD USD USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425	0,11 0,0 0,0 0,0 0,0 0,2
600.000 220.000 260.000 350.000 1.530.000 2.090.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd. DP World Salaam <sup>(c)</sup>	USD USD USD USD USD USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 % 6,000 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028 Perp.	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425 2.256.873	0,11 0,0 0,0; 0,0; 0,0; 0,2;
600.000 220.000 260.000 350.000 1.530.000 2.090.000 440.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd. DP World Salaam(c) Dubai DOF Sukuk Ltd.	USD USD USD USD USD USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 % 6,000 % 2,763 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028 Perp. 09/09/2030	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425 2.256.873 444.400	0,11 0,0 0,0; 0,0; 0,2; 0,3; 0,0;
600.000 220.000 260.000 350.000 1.530.000 2.090.000 440.000 82.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd. DP World Salaam(c) Dubai DOF Sukuk Ltd. Embraer Overseas Ltd.	USD USD USD USD USD USD USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 % 6,000 % 2,763 % 5,696 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028 Perp. 09/09/2030 16/09/2023	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425 2.256.873 444.400 85.911	0,11 0,0 0,0; 0,0; 0,2; 0,3; 0,0;
600.000 220.000 260.000 350.000 1.530.000 2.090.000 440.000 82.000 590.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd. DP World Salaam <sup>(c)</sup> Dubai DOF Sukuk Ltd. Embraer Overseas Ltd. Energuate Trust	USD USD USD USD USD USD USD USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 % 6,000 % 2,763 % 5,696 % 5,875 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028 Perp. 09/09/2030 16/09/2023 03/05/2027	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425 2.256.873 444.400 85.911 609.896	0,11 0,0 0,0 0,0 0,2 0,3 0,0 0,0
600.000 220.000 260.000 350.000 1.530.000 440.000 82.000 590.000 730.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd. DP World Salaam <sup>(c)</sup> Dubai DOF Sukuk Ltd. Embraer Overseas Ltd. Energuate Trust ENN Energy Holdings Ltd.	USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 % 6,000 % 2,763 % 5,696 % 5,875 % 2,625 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028 Perp. 09/09/2030 16/09/2023 03/05/2027 17/09/2030	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425 2.256.873 444.400 85.911 609.896 730.157	0,1 0,0 0,0 0,0 0,2 0,3 0,0 0,0 0,0
600.000 220.000 260.000 350.000 1.530.000 2.090.000 440.000 82.000 590.000 730.000 220.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd. DP World Salaam(°) Dubai DOF Sukuk Ltd. Embraer Overseas Ltd. Energuate Trust ENN Energy Holdings Ltd. Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 % 6,000 % 2,763 % 5,696 % 5,875 % 2,625 % 10,875 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028 Perp. 09/09/2030 16/09/2023 03/05/2027 17/09/2030 09/01/2023	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425 2.256.873 444.400 85.911 609.896 730.157 55.000	0,11 0,0 0,0 0,0 0,2 0,3 0,0 0,0 0,0 0,1
600.000 220.000 260.000 350.000 1.530.000 2.090.000 440.000 82.000 590.000 730.000 220.000 2.270.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd. DP World Salaam(e) Dubai DOF Sukuk Ltd. Embraer Overseas Ltd. Energuate Trust ENN Energy Holdings Ltd. Fantasia Holdings Group Co., Ltd. Grupo Aval Ltd.	USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 % 6,000 % 2,763 % 5,696 % 5,875 % 2,625 % 10,875 % 4,750 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028 Perp. 09/09/2030 16/09/2023 03/05/2027 17/09/2030 09/01/2023 26/09/2022	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425 2.256.873 444.400 85.911 609.896 730.157 55.000 2.314.796	0,11 0,0 0,0 0,0 0,2 0,3 0,0 0,0 0,0 0,1
600.000 220.000 260.000 350.000 1.530.000 2.090.000 440.000 590.000 730.000 220.000 2.270.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd. DP World Salaam(°) Dubai DOF Sukuk Ltd. Embraer Overseas Ltd. Energuate Trust ENN Energy Holdings Ltd. Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 % 6,000 % 2,763 % 5,696 % 5,875 % 2,625 % 10,875 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028 Perp. 09/09/2030 16/09/2023 03/05/2027 17/09/2030 09/01/2023	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425 2.256.873 444.400 85.911 609.896 730.157 55.000	0,1 0,0 0,0 0,0 0,2 0,3 0,0 0,0 0,0 0,1 0,0
600.000 220.000 260.000 350.000 1.530.000 2.090.000 82.000 730.000 220.000 2270.000 410.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd. DP World Salaam(e) Dubai DOF Sukuk Ltd. Embraer Overseas Ltd. Energuate Trust ENN Energy Holdings Ltd. Fantasia Holdings Group Co., Ltd. Grupo Aval Ltd. IHS Holding Ltd.	USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 % 6,000 % 2,763 % 5,696 % 5,875 % 2,625 % 10,875 % 4,750 % 5,625 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028 Perp. 09/09/2030 16/09/2023 03/05/2027 17/09/2030 09/01/2023 26/09/2022 29/11/2026	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425 2.256.873 444.400 85.911 609.896 730.157 55.000 2.314.796 499.375	0,1 0,0 0,0 0,0 0,2 0,3 0,0 0,0 0,0 0,1 0,0 0,3
600.000 220.000 260.000 350.000 1.530.000 2.090.000 440.000 590.000 730.000 220.000 5.270.000 500.000 410.000 620.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd. DP World Salaam <sup>(c)</sup> Dubai DOF Sukuk Ltd. Embraer Overseas Ltd. Energuate Trust ENN Energy Holdings Ltd. Fantasia Holdings Group Co., Ltd. Grupo Aval Ltd. IHS Holding Ltd. IHS Holding Ltd.	USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 % 6,000 % 2,763 % 5,696 % 5,875 % 2,625 % 10,875 % 4,750 % 5,625 % 6,250 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028 Perp. 09/09/2030 16/09/2023 03/05/2027 17/09/2030 09/01/2023 26/09/2022 29/11/2028	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425 2.256.873 444.400 85.911 609.896 730.157 55.000 2.314.796 499.375 408.975	0,1 0,0 0,0 0,0 0,2 0,3 0,0 0,0 0,0 0,1 0,0 0,3 0,0 0,0
600.000 220.000 260.000 350.000 1.530.000 440.000 82.000 590.000 730.000 220.000 2.270.000 410.000 620.000 380.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd. DP World Salaam(e) Dubai DOF Sukuk Ltd. Embraer Overseas Ltd. Emerguate Trust ENN Energy Holdings Ltd. Fantasia Holdings Group Co., Ltd. Grupo Aval Ltd. IHS Holding Ltd. IHS Holding Ltd. IHS Holding Ltd. iQIYI, Inc. iQIYI, Inc. JD.com, Inc.	USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 % 6,000 % 2,763 % 5,696 % 5,875 % 2,625 % 4,750 % 5,625 % 6,250 % 2,000 % 4,000 % 3,875 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028 Perp. 09/09/2030 16/09/2023 03/05/2027 17/09/2030 09/01/2023 26/09/2022 29/11/2026 29/11/2028 01/04/2025 15/12/2026 29/04/2026	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425 2.256.873 444.400 85.911 609.896 730.157 55.000 2.314.796 499.375 408.975 526.590 107.527 409.963	0,1 0,0 0,0 0,0 0,2 0,3 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
600.000 220.000 260.000 350.000 1.530.000 440.000 590.000 730.000 2.270.000 410.000 130.000 380.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd. DP World Salaam(e) Dubai DOF Sukuk Ltd. Embraer Overseas Ltd. Emerguate Trust ENN Energy Holdings Ltd. Fantasia Holdings Group Co., Ltd. Grupo Aval Ltd. IHS Holding Ltd. IHS Holding Ltd. IHS Holding Ltd. IGIYI, Inc. JD.com, Inc. JD.com, Inc.	USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 % 6,000 % 2,763 % 5,696 % 5,875 % 2,625 % 4,750 % 5,625 % 6,250 % 2,000 % 4,000 % 3,875 % 4,125 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028 Perp. 09/09/2030 16/09/2023 03/05/2027 17/09/2030 09/01/2023 26/09/2022 29/11/2026 29/11/2028 01/04/2025 15/12/2026 29/04/2026 14/01/2050	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425 2.256.873 444.400 85.911 609.896 730.157 55.000 2.314.796 499.375 408.975 526.590 107.527 409.963 215.224	0,1 0,0 0,0 0,0 0,2 0,3 0,0 0,0 0,1 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
600.000 220.000 260.000 350.000 1.530.000 440.000 590.000 730.000 220.000 2.270.000 410.000 620.000 130.000 380.000 260.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd. DP World Salaam(c) Dubai DOF Sukuk Ltd. Embraer Overseas Ltd. Emerguate Trust ENN Energy Holdings Ltd. Fantasia Holdings Group Co., Ltd. Grupo Aval Ltd. IHS Holding Ltd. IHS Holding Ltd. iQIYI, Inc. iQIYI, Inc. JD.com, Inc. JD.com, Inc. Kaisa Group Holdings Ltd.(c)	USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 % 6,000 % 2,763 % 5,696 % 5,875 % 2,625 % 10,875 % 4,750 % 5,625 % 6,250 % 2,000 % 4,000 % 3,875 % 4,125 % 10,875 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028 Perp. 09/09/2030 16/09/2023 03/05/2027 17/05/2030 09/01/2023 26/09/2022 29/11/2026 29/11/2028 01/04/2025 15/12/2026 29/04/2026 14/01/2050 Perp.	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425 2.256.873 444.400 85.911 609.896 730.157 55.000 2.314.796 499.375 408.975 526.590 107.527 409.963 215.224 67.600	0,1 0,0 0,0 0,0 0,2 0,3 0,0 0,0 0,1 0,0 0,3 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
600.000 220.000 260.000 350.000 1.530.000 440.000 82.000 590.000 220.000 2.270.000 500.000 410.000 380.000 260.000 350.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd. DP World Salaam(°) Dubai DOF Sukuk Ltd. Embraer Overseas Ltd. Ennerguate Trust ENN Energy Holdings Ltd. Fantasia Holdings Group Co., Ltd. Grupo Aval Ltd. IHS Holding Ltd. IHS Holding Ltd. IHS Holding Ltd. IGIYI, Inc. JD.com, Inc. JD.com, Inc. Kaisa Group Holdings Ltd.(°) Meituan	USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 % 6,000 % 2,763 % 5,696 % 5,875 % 2,625 % 10,875 % 4,750 % 5,625 % 6,250 % 2,000 % 4,000 % 3,875 % 4,125 % 10,875 % 3,050 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028 Perp. 09/09/2030 16/09/2023 03/05/2027 17/09/2030 09/01/2023 26/09/2022 29/11/2026 29/11/2028 01/04/2026 15/12/2026 29/04/2026 14/01/2050 Perp. 28/10/2030	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425 2.256.873 444.400 85.911 609.896 730.157 55.000 2.314.796 499.375 408.975 526.590 107.527 409.963 215.224 67.600 326.009	0,1 0,0 0,0 0,0 0,2 0,3 0,0 0,0 0,1 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
600.000 220.000 260.000 350.000 1.530.000 440.000 82.000 590.000 220.000 2.270.000 410.000 620.000 130.000 380.000 260.000 350.000 990.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd. DP World Salaam(e) Dubai DOF Sukuk Ltd. Embraer Overseas Ltd. Energuate Trust ENN Energy Holdings Ltd. Fantasia Holdings Group Co., Ltd. Grupo Aval Ltd. IHS Holding Ltd. IHS Holding Ltd. iQIYI, Inc. iQIYI, Inc. JD.com, Inc. JD.com, Inc. Kaisa Group Holdings Ltd.(e) Meituan Melco Resorts Finance Ltd.	USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 % 6,000 % 2,763 % 5,696 % 5,875 % 2,625 % 4,750 % 5,625 % 6,250 % 2,000 % 4,000 % 3,875 % 4,125 % 10,875 % 3,050 % 5,750 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028 Perp. 09/09/2030 16/09/2023 03/05/2027 17/09/2030 09/01/2023 26/09/2022 29/11/2026 29/11/2028 01/04/2025 15/12/2026 29/04/2026 14/01/2050 Perp. 28/10/2030 21/07/2028	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425 2.256.873 444.400 85.911 609.896 730.157 55.000 2.314.796 499.375 408.975 526.590 107.527 409.963 215.224 67.600 326.009 979.330	0,1 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
600.000 220.000 260.000 350.000 1.530.000 440.000 82.000 590.000 22.070.000 410.000 620.000 130.000 260.000 260.000 350.000 990.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd. DP World Salaam(e) Dubai DOF Sukuk Ltd. Embraer Overseas Ltd. Energuate Trust ENN Energy Holdings Ltd. Fantasia Holdings Group Co., Ltd. Grupo Aval Ltd. IHS Holding Ltd. IHS Holding Ltd. IHS Holding Ltd. iQIYI, Inc. iQIYI, Inc. JD.com, Inc. JD.com, Inc. Kaisa Group Holdings Ltd.(c) Meituan Melco Resorts Finance Ltd. MGM China Holdings Ltd.	USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 % 6,000 % 2,763 % 5,696 % 5,875 % 2,625 % 4,750 % 5,625 % 6,250 % 2,000 % 4,000 % 3,875 % 4,125 % 10,875 % 3,050 % 5,750 % 5,250 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028 Perp. 09/09/2030 16/09/2023 03/05/2027 17/09/2030 09/01/2023 26/09/2022 29/11/2026 29/11/2026 29/11/2026 29/04/2026 14/01/2050 Perp. 28/10/2030 21/07/2028 18/06/2025	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425 2.256.873 444.400 85.911 609.896 730.157 55.000 2.314.796 499.375 408.975 526.590 107.527 409.963 215.224 67.600 326.009 979.330 200.067	0,1 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
600.000 220.000 260.000 350.000 1.530.000 2.090.000 82.000 590.000 220.000 2.270.000 620.000 130.000 380.000 260.000 350.000 990.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd. DP World Salaam(c) Dubai DOF Sukuk Ltd. Embraer Overseas Ltd. Emerguate Trust ENN Energy Holdings Ltd. Fantasia Holdings Group Co., Ltd. Grupo Aval Ltd. IHS Holding Ltd. IHS Holding Ltd. iQIYI, Inc. iQIYI, Inc. jD.com, Inc. JD.com, Inc. Kaisa Group Holdings Ltd. Kaisa Group Holdings Ltd. Metuan Melco Resorts Finance Ltd. MGM China Holdings Ltd.	USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 % 6,000 % 2,763 % 5,696 % 5,875 % 4,750 % 5,625 % 6,250 % 2,000 % 4,000 % 3,875 % 4,125 % 10,875 % 5,525 % 5,750 % 5,750 % 5,250 % 5,250 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028 Perp. 09/09/2030 16/09/2023 03/05/2027 17/09/2030 09/01/2023 26/09/2022 29/11/2026 29/11/2028 01/04/2025 15/12/2026 29/04/2026 14/01/2050 Perp. 28/10/2030 21/07/2028 18/06/2025 15/05/2026	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425 2.256.873 444.400 85.911 609.896 730.157 55.000 2.314.796 499.375 408.975 526.590 107.527 409.963 215.224 67.600 326.009 979.330 200.067 534.199	0,1 0,0 0,0 0,0 0,2 0,3 0,0 0,0 0,1 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
600.000 220.000 260.000 350.000 1.530.000 2.090.000 440.000 590.000 220.000 500.000 410.000 620.000 130.000 380.000 380.000 350.000 990.000 250.000 350.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd. DP World Salaam(°) Dubai DOF Sukuk Ltd. Embraer Overseas Ltd. Ennerguate Trust ENN Energy Holdings Ltd. Fantasia Holdings Group Co., Ltd. Grupo Aval Ltd. IHS Holding Ltd. IHS Holding Ltd. IGIYI, Inc. IJD.com, Inc. JD.com, Inc. Kaisa Group Holdings Ltd. Kaisa Group Holdings Ltd. MGM China Holdings Ltd. MGM China Holdings Ltd.	USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 % 6,000 % 2,763 % 5,696 % 5,875 % 4,750 % 6,250 % 2,000 % 4,000 % 3,875 % 4,125 % 10,875 % 5,550 % 5,750 % 5,250 % 5,875 % 4,750 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028 Perp. 09/09/2030 16/09/2023 03/05/2027 17/09/2030 09/01/2023 26/09/2022 29/11/2026 29/11/2028 01/04/2025 15/12/2026 29/04/2026 14/01/2050 Perp. 28/10/2030 21/07/2028 18/06/2025 15/05/2026 01/02/2027	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425 2.256.873 444.400 85.911 609.896 730.157 55.000 2.314.796 499.375 408.975 526.590 107.527 409.963 215.224 67.600 326.009 979.330 200.067 534.199 358.745	0.1 0.0 0.0 0.0 0.2 0.3 0.0 0.0 0.1 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0
600.000 220.000 260.000 350.000 1.530.000 440.000 82.000 290.000 220.000 2.270.000 500.000 410.000 380.000 260.000 350.000 990.000 200.000 350.000 370.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd. DP World Salaam(°) Dubai DOF Sukuk Ltd. Embraer Overseas Ltd. Ennerguate Trust ENN Energy Holdings Ltd. Fantasia Holdings Group Co., Ltd. Grupo Aval Ltd. IHS Holding Ltd. IHS Holding Ltd. IHS Holding Ltd. IGIYI, Inc. JD.com, Inc. JD.com, Inc. Kaisa Group Holdings Ltd. MGM China Holdings Ltd.	USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 % 6,000 % 2,763 % 5,696 % 5,875 % 2,625 % 6,250 % 6,250 % 4,000 % 4,000 % 3,875 % 4,125 % 10,875 % 10,875 % 4,750 % 5,625 % 6,250 % 5,750 % 5,250 % 5,250 % 5,875 % 4,750 % 1,950 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028 Perp. 09/09/2030 16/09/2023 03/05/2027 17/09/2030 09/01/2023 26/09/2022 29/11/2026 29/11/2028 01/04/2025 15/12/2026 29/04/2026 14/01/2050 Perp. 28/10/2030 21/07/2028 18/06/2025 15/05/2026 01/02/2027 04/03/2024	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425 2.256.873 444.400 85.911 609.896 730.157 55.000 2.314.796 499.375 408.975 526.590 107.527 409.963 215.224 67.600 326.009 979.330 200.067 534.199 358.745 156.600	0,1 0,0 0,0 0,0 0,2 0,3 0,0 0,0 0,1 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
600.000 220.000 260.000 250.000 1.530.000 440.000 82.000 590.000 220.000 410.000 620.000 380.000 260.000 350.000 290.000 530.000 530.000 540.000	China Aoyuan Group Ltd. China SCE Group Holdings Ltd. Country Garden Holdings Co., Ltd. DP World Crescent Ltd. DP World Salaam(°) Dubai DOF Sukuk Ltd. Embraer Overseas Ltd. Ennerguate Trust ENN Energy Holdings Ltd. Fantasia Holdings Group Co., Ltd. Grupo Aval Ltd. IHS Holding Ltd. IHS Holding Ltd. IGIYI, Inc. IJD.com, Inc. JD.com, Inc. Kaisa Group Holdings Ltd. Kaisa Group Holdings Ltd. MGM China Holdings Ltd. MGM China Holdings Ltd.	USD	5,880 % 6,000 % 3,125 % 4,848 % 6,000 % 2,763 % 5,696 % 5,875 % 4,750 % 6,250 % 2,000 % 4,000 % 3,875 % 4,125 % 10,875 % 5,550 % 5,750 % 5,250 % 5,875 % 4,750 %	01/03/2027 04/02/2026 22/10/2025 26/09/2028 Perp. 09/09/2030 16/09/2023 03/05/2027 17/09/2030 09/01/2023 26/09/2022 29/11/2026 29/11/2028 01/04/2025 15/12/2026 29/04/2026 14/01/2050 Perp. 28/10/2030 21/07/2028 18/06/2025 15/05/2026 01/02/2027	646.965 53.900 202.800 313.250 1.717.425 2.256.873 444.400 85.911 609.896 730.157 55.000 2.314.796 499.375 408.975 526.590 107.527 409.963 215.224 67.600 326.009 979.330 200.067 534.199 358.745	0,1 0,0 0,0 0,0 0,2 0,3 0,0 0,1 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0

					Valor de mercado en	% de
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	USD	patrimonio
Bonos – (cont						
	(continuación)					
	Redsun Properties Group Ltd.	USD	7,300 %	13/01/2025	98.700	0,0
	Sharjah Sukuk Program Ltd.	USD	4,226 %	14/03/2028	1.362.164	0,2
	Sharjah Sukuk Program Ltd.	USD USD	3,234 %	23/10/2029	209.072	0,0
	Sunac China Holdings Ltd. VLL International, Inc.	USD	5,950 % 7,250 %	26/04/2024 20/07/2027	224.000 608.681	0,0
	Wynn Macau Ltd.	USD	5,500 %	15/01/2026	1.034.000	0,0
	Wynn Macau Ltd.	USD	5,625 %	26/08/2028	452.258	0,0
	Yuzhou Group Holdings Co., Ltd. <sup>(c)</sup>	USD	5,375 %	Perp.	131.150	0,0
	Zhenro Properties Group Ltd.(c)	USD	10,250 %	Perp.	232.400	0,0
		_			19.167.170	2,90
Chile						
980.000.000	Bonos de la Tesorería de la República en pesos	CLP	4,500 %	01/03/2026	1.142.004	0,1
3.270.000.000	Bonos de la Tesorería de la República en pesos	CLP	5,000 %	01/03/2035	3.686.446	0,5
2.440.000.000	Bonos de la Tesorería de la República en pesos 144A <sup>(e)</sup>	CLP	4,700 %	01/09/2030	2.758.773	0,4
540.000	CAP S.A.	USD	3,900 %	27/04/2031	509.625	0,0
360.000	Enel Americas S.A.	USD	4,000 %	25/10/2026	383.314	0,0
	GNL Quintero S.A.	USD	4,634 %	31/07/2029	2.353.437	0,3
500.000	Interchile S.A.	USD	4,500 %	30/06/2056	524.687	0,0
549.000	Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A.	USD _	4,375 %	28/01/2025	583.907	0,0
					11.942.193	1,8
China				.=		
	Agricultural Development Bank of China – Serie 2004	CNY	2,960 %	17/04/2030	17.574.964	2,60
	China Development Bank – Serie 2010	CNY	3,090 %	18/06/2030	5.543.255	0,8
	China Development Bank – Serie 2012	CNY	3,340 %	14/07/2025	25.722.950	3,9
86.710.000	Bonos del Estado de China	CNY _	2,850 %	04/06/2027	13.649.175	2,0
					62.490.344	9,47
Colombia 430,000	Banco Davivienda S.A. <sup>(c)</sup>	USD	6,650 %	Perp.	440.698	0,0
	Banco de Bogota S.A.	USD	5,375 %	19/02/2023	246.900	0,0
	Banco de Bogota S.A.	USD	6,250 %	12/05/2026	3.549.325	0,54
	Bonos internacionales del Estado de Colombia	COP	4,375 %	21/03/2023	145.542	0,0
	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	4,500 %	15/03/2029	511.116	0,0
	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	3,250 %	22/04/2032	1.014.175	0,1
	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	6,125 %	18/01/2041	488.301	0,0
	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	5,000 %	15/06/2045	1.386.670	0,2
	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	3,875 %	15/02/2061	213.044	0,0
	Colombian TES	COP	3,300 %	17/03/2027	724.456	0,1
	TES de Colombia – Serie B	COP	7,500 %	26/08/2026	1.056.149	0,16
	TES de Colombia – Serie B	COP	5.750 %	03/11/2027	2.693.792	0,4
	TES de Colombia – Serie B	COP	7,000 %	30/06/2032	1.199.833	0,18
	TES de Colombia – Serie B	COP	7,250 %	26/10/2050	1.930.639	0,29
	Empresas Publicas de Medellin ESP	USD	4,250 %	18/07/2029	882.305	0,1
		_			16.482.945	2,50
Chipre						
1.490.000	MHP S.E.	USD	7,750 %	10/05/2024	1.534.331	0,23
República Che	ca Bonos del Estado de la República Checa – Serie 103	CZV	2,000 %	13/10/2033	1.523.955	0.0
	Bonos del Estado de la República Checa – Serie 103  Bonos del Estado de la República Checa – Serie 120	CZK CZK	2,000 % 1,250 %	14/02/2025	8.929.086	0,23 1,39
	Bonos del Estado de la República Checa – Serie 120  Bonos del Estado de la República Checa – Serie 121	CZK	1,200 %	13/03/2031	2.433.762	0,3
	Bonos del Estado de la República Checa – Serie 121  Bonos del Estado de la República Checa – Serie 125	CZK	1,500 %	24/04/2040	650.828	0,3
	Bonos del Estado de la República Checa – Serie 125	CZK	4,200 %	04/12/2036	670.510	0,10
	Bonos del Estado de la República Checa – Serie 49	CZK	2,500 %	25/08/2028	2.203.825	0,10
	Bonos del Estado de la República Checa – Serie 94	CZK	0,950 %	15/05/2030	1.620.295	0,2
11.200.000	25.100 to 25.100 to 10 Nopulation Cities Cit	-	0,000 //	10/00/2000	18.032.261	2,7
República Dom	ninicana					-,/,
•	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI S.A.	USD	6,750 %	30/03/2029	3.019.419	0,4
	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	5,875 %	18/04/2024	341.250	0,0
	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	6,875 %	29/01/2026	1.584.600	0,0
	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	8,625 %	20/04/2027	178.411	0,0
	2000 atternationales de la republica Duffillitalia					
	Bonos internacionales de la República Dominicana	HISD	6 000 %	70/11/17/17/12	900 575	Λ 1
815.000	Bonos internacionales de la República Dominicana Ronos internacionales de la República Dominicana	USD	6,000 % 4 500 %	19/07/2028 30/01/2030	900.575 678.166	
815.000 680.000	Bonos internacionales de la República Dominicana Bonos internacionales de la República Dominicana Bonos internacionales de la República Dominicana	USD USD USD	6,000 % 4,500 % 5,875 %	30/01/2030 30/01/2060	900.575 678.166 775.791	0,1: 0,1: 0,1:

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con	· ·	Divisa	Tipo de litteres.	r echa de vencimiento		patimonic
Ecuador	inuacion)					
177.110	Bonos internacionales del Estado de Ecuador <sup>(d)</sup>	USD	5,000 %	31/07/2030	146.558	0,02
548.093	Bonos internacionales del Estado de Ecuador	USD	6,932 %	31/07/2030	305.562	0,05
	Bonos internacionales del Estado de Ecuador <sup>(d)</sup>	USD	10,174 %	31/07/2035	1.173.635	0,18
1.140.890	Bonos internacionales del Estado de Ecuador <sup>(d)</sup>	USD	0,500 %	31/07/2040	668.134	0,10
		_			2.293.889	0,35
Egipto						
	Bonos internacionales del Estado de Egipto	EUR	4,750 %	16/04/2026	290.707	0,05
560.000	Bonos internacionales del Estado de Egipto	USD	7,600 %	01/03/2029	536.200	0,08
585.000	Bonos internacionales del Estado de Egipto	EUR	5,625 %	16/04/2030	584.101	0,09
605.000	Bonos internacionales del Estado de Egipto	EUR	6,375 %	11/04/2031	614.397	0,09
970.000	Bonos internacionales del Estado de Egipto	USD	7,625 %	29/05/2032	877.850	0,13
	Bonos internacionales del Estado de Egipto <sup>(c)</sup>	USD	8,700 %	01/03/2049	582.250	0,09
440.000	Bonos internacionales del Estado de Egipto	USD _	8,875 %	29/05/2050	381.700	0,06
					3.867.205	0,59
El Salvador						
80.000	Bonos internacionales del Estado de El Salvador	USD	8,625 %	28/02/2029	55.169	0,01
390.000	Bonos internacionales del Estado de El Salvador	USD	8,250 %	10/04/2032	263.514	0,04
150.000	Bonos internacionales del Estado de El Salvador	USD	7,625 %	01/02/2041	94.227	0,02
1.050.000	Bonos internacionales del Estado de El Salvador	USD	9,500 %	15/07/2052	744.991	0,11
		-			1.157.901	0,18
Etiopía						
•	Bonos internacionales de Etiopía	USD	6,625 %	11/12/2024	238.500	0,04
Gabón						
	Bonos internacionales del Estado de Gabón	USD	6,625 %	06/02/2031	188.091	0,03
	Bonos internacionales del Estado de Gabón	USD	7,000 %	24/11/2031	481.950	0,07
		-			670.041	0,10
					070.041	0,10
Ghana	B		0.075.0/	44/00/0007	007.000	
	Bonos internacionales del Estado de Ghana	USD	6,375 %	11/02/2027	237.800	0,04
	Bonos internacionales del Estado de Ghana Bonos internacionales del Estado de Ghana	USD USD	7,750 % 7,625 %	07/04/2029 16/05/2029	685.650 432.612	0,10 0,06
	Bonos internacionales del Estado de Ghana	USD	8,125 %	26/03/2032	314.800	0,00
	Bonos internacionales del Estado de Ghana	USD	8,625 %	07/04/2034	158.250	0,03
	Bonos internacionales del Estado de Ghana	USD	8,875 %	07/05/2042	208.238	0,02
	Bonos internacionales del Estado de Ghana	USD	8,950 %	26/03/2051	253.688	0,04
	Bonos internacionales del Estado de Ghana	USD	8,750 %	11/03/2061	237.100	0,04
		-	•		2.528.138	0,38
0					2.020.100	0,00
Guatemala 1 920 000	Banco Industrial S.A. <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	29/01/2031	1.911.600	0,29
	Bonos del Estado de Guatemala	USD	4,500 %	03/05/2026	925.406	0,14
	Bonos del Estado de Guatemala  Bonos del Estado de Guatemala	USD	4,375 %	05/06/2027	1.796.716	0,14
	Bonos del Estado de Guatemala	USD	4,900 %	01/06/2030	440.078	0,07
	Bonos del Estado de Guatemala	USD	6,125 %	01/06/2050	234.477	0,03
		-	•		5.308.277	0,80
					3.300.277	0,00
Honduras 290 000	Bonos internacionales del Estado de Honduras	USD	5,625 %	24/06/2030	291.450	0,04
	20100 11101111101111101 101 201010 101 101		0,020 70	2 11 0 01 2 0 0 0	2011100	
Hong Kong	Airport Authority <sup>(c)</sup>	USD	2 100 0/	Do	310 501	0.05
	Airport Authority <sup>(c)</sup>	USD	2,100 %	Perp.	318.581 305.987	0,05
	Bank of East Asia Ltd. <sup>(c)</sup>	USD	2,400 % 5,825 %	Perp. Perp.	305.987	0,05 0,06
	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	USD	5,825 % 4,125 %	Регр. 19/07/2027	402.406	0,06
	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	USD	5,125 %	14/03/2028	857.861	0,00
	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	USD	3,875 %	19/06/2029	214.725	0,13
	Far East Horizon Ltd.(c)	USD	4,350 %	Perp.	201.000	0,03
	MTR Corp., Ltd.	USD	1,625 %	19/08/2030	635.952	0,10
	Wanda Group Overseas Ltd.	USD	8,875 %	21/03/2023	173.000	0,02
	•		-,			
					3.506.612	0,53
Hungría	Denne del Fetade de l'himanifa Conta CAS		0.000.01	00/00/000	2 705 00 1	^
	Bonos del Estado de Hungría – Serie 24/B	HUF	3,000 %	26/06/2024	3.735.624	0,57
∠0.000	Bonos del Estado de Hungría – Serie 27/A	HUF	3,000 %	27/10/2027	58	0,00

enencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de
onos – (cont		Divisa	ripo de interes.	recita de vencimiento.	030	patrinonic
ungría – (cont	· ·					
	Bonos del Estado de Hungría – Serie 30/A	HUF	3,000 %	21/08/2030	2.067.085	0,31
	OTP Bank Nyrt <sup>(c)</sup>	EUR	2,875 %	15/07/2029	2.389.113	0,36
		-			8.191.880	1,24
ıdia						· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·
	Adani Electricity Mumbai Ltd.	USD	3,949 %	12/02/2030	792.769	0,12
	Adani Green Energy Ltd.	USD	4,375 %	08/09/2024	201.250	0,03
330.000	Adani Green Energy UP Ltd. Via Prayatna Developers Pvt Ltd. Via					
	Parampujya Solar Energy Pvt Ltd.	USD	6,250 %	10/12/2024	356.321	0,06
	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	USD	4,200 %	04/08/2027	374.691	0,06
	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	USD USD	4,375 %	03/07/2029	379.128 184.792	0,06
	Adani Transmission Ltd. JSW Hydro Energy Ltd.	USD	4,250 % 4,125 %	21/05/2036 18/05/2031	353.926	0,03 0,05
	Reliance Industries Ltd.	USD	3,667 %	30/11/2027	865.238	0,03
	ReNew Power Synthetic	USD	6,670 %	12/03/2024	289.382	0,04
	Yes Bank Ifsc Banking Unit Branch	USD	3,750 %	06/02/2023	394.885	0,06
	•	-			4.192.382	0.64
					4.132.302	0,0
idonesia	ABM Investama Tbk PT	USD	7,125 %	01/08/2022	251.657	0,04
	Alam Sutera Realty Tbk PT	USD	8,250 %	02/11/2025	186.788	0,04
	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	USD	3,750 %	30/03/2026	254.375	0,04
	Cikarang Listrindo Tbk PT	USD	4,950 %	14/09/2026	409.250	0,06
	Delta Merlin Dunia Tekstil PT – Serie A <sup>(d)</sup>	USD	2,500 %	26/06/2028	31.969	0,00
375.000	Delta Merlin Dunia Tekstil PT – Serie B	USD	0,000 %	26/06/2032	21.141	0,00
	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	USD	3,398 %	09/06/2031	379.287	0,06
	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	USD	3,541 %	27/04/2032	369.306	0,06
	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	USD	4,745 %	09/06/2051	407.000	0,06
	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	USD	4,805 %	27/04/2052	367.200	0,06
	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	USD	5,450 %	15/05/2030	227.237 394.512	0,03
	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD USD	5,800 % 5,125 %	15/05/2050 15/01/2045	12.175	0,06
	Bonos del Tesoro de Indonesia – Serie FR73	IDR	8,750 %	15/05/2031	648	0,00
	Bonos del Tesoro de Indonesia – Serie FR82	IDR	7,000 %	15/09/2030	73	0.00
	Pakuwon Jati Tbk PT	USD	4,875 %	29/04/2028	244.075	0,04
400.000	Pertamina Persero PT	USD	2,300 %	09/02/2031	378.500	0,06
420.000	Pertamina Persero PT	USD	6,500 %	27/05/2041	541.816	0,08
	Pertamina Persero PT	USD	6,000 %	03/05/2042	292.565	0,04
	Pertamina Persero PT	USD	4,150 %	25/02/2060	197.504	0,03
	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III	USD	3,800 %	23/06/2050	277.425	0,04
	Sri Rejeki Isman Tbk PT Tower Bersama Infrastructure Tbk PT	USD USD	7,250 %	16/01/2025 21/01/2025	41.000 615.515	0,01 0,09
	Tower Bersama Infrastructure Tbk PT	USD	4,250 % 2,750 %	20/01/2026	460.669	0,08
400.000	Tower Beroama immadiated token	-	2,700 70	20/01/2020		
					6.361.687	0,96
landa	-: (5)	,				_
	Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance Plc.(c)	USD	5,950 %	15/04/2030	1.767.500	0,27
	Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc.(c)	USD	7,500 %	05/10/2027	1.683.671 381.900	0,25
	Eurotorg LLC Via Bonitron DAC Oilflow SPV 1 DAC	USD USD	9,000 % 12,000 %	22/10/2025 13/01/2022	89.541	0,06 0,01
	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC	USD	3,050 %	23/01/2025	1.371.825	0,01
	Tinkoff Bank JSC Via TCS Finance Ltd.(c)	USD	6,000 %	Perp.	516.750	0,08
		-	.,			
					5.811.187	0,88
la de Man	A LOUIS BU	,			.=	
	AngloGold Ashanti Holdings Plc. Gohl Capital Ltd.	USD	3,375 %	01/11/2028	455.400	0,07
1.510.000	Goni Capitai Ltd.	USD _	4,250 %	24/01/2027	1.577.067	0,24
					2.032.467	0,31
rael						
	Bank Leumi Le-Israel BM 144A <sup>(c)(e)</sup>	USD	3,275 %	29/01/2031	883.163	0,13
	Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 212	ILS	(0,260 %)	02/02/2022	3.609.051	0,55
	Letras del Banco de Israel - Makam - Serie 412	ILS	(0,140 %)	06/04/2022	691.499	0,11
	Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 622 ICL Group Ltd. 144A <sup>(e)</sup>	ILS USD	(0,120 %) 6,375 %	08/06/2022 31/05/2038	747.136 402.613	0,11 0,06
	IOL GIOUD LIU. 144A\**/	030	0,315 %	3 1/03/2036	402.013	0,00
	Leviathan Bond Ltd. 144A <sup>(e)</sup>	USD	5,750 %	30/06/2023	1.025.350	0,16

Tenencias	Descripción del celor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interes.	recha de vencimiento	030	patrimonio
Bonos – (contin						
•	Mizrahi Tefahot Bank Ltd. <sup>(c)</sup>	USD	3,077 %	07/04/2031	814.055	0,12
980.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	EUR	3,750 %	09/05/2027	1.099.716	0,17
		=			9.893.900	1,50
Costa de Marfi						,
	Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	EUR	5,250 %	22/03/2030	1.599.442	0,24
350.000	Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	EUR	4,875 %	30/01/2032	373.593	0,06
200.000	Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	USD	6,125 %	15/06/2033	205.279	0,03
440.000	Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	EUR _	6,625 %	22/03/2048	479.354	0,07
					2.657.668	0,40
Jamaica						
710.000	Bonos internacionales del Estado de Jamaica	USD	7,875 %	28/07/2045	978.069	0,15
Japón	SoftPank Croup Corn (C)	USD	6,000 %	Dorn	272 400	0.06
	SoftBank Group Corp.(c)	090	6,000 %	Perp.	372.400	0,06
<b>Jersey</b> 890.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,625 %	31/03/2036	869.975	0,13
Jordania	· · ·		, ,-			-,
	Bonos internacionales del Estado de Jordania	USD	5,850 %	07/07/2030	295.875	0,04
Kazajistán						
-	KazMunayGas National Co., JSC	USD	4,750 %	19/04/2027	1.011.931	0,15
260.000	KazMunayGas National Co., JSC	USD	3,500 %	14/04/2033	265.850	0,04
		_			1.277.781	0,19
Kenia						
450.000	Bonos internacionales del Estado de Kenia	USD	7,000 %	22/05/2027	468.000	0,07
1.090.000	Bonos internacionales del Estado de Kenia	USD _	8,000 %	22/05/2032	1.152.675	0,18
					1.620.675	0,25
Líbano						
	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,100 %	04/10/2022	6.900	0,00
	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,000 %	27/01/2023	9.200	0,00
	Bonos internacionales del Estado de Líbano Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD USD	6,650 % 6,200 %	22/04/2024 26/02/2025	25.300 154.100	0,00 0,02
	Bonos internacionales del Estado de Libano  Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,600 %	27/11/2026	21.850	0,02
	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,850 %	23/03/2027	31.050	0,00
	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,750 %	29/11/2027	33.350	0,01
	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	7,000 %	20/03/2028	4.600	0,00
	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,650 %	03/11/2028	10.350	0,00
1.395.000	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,850 %	25/05/2029	160.425	0,03
1.311.000	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,650 %	26/02/2030	150.765	0,02
20.000	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	7,150 %	20/11/2031	2.300	0,00
80.000	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	7,050 %	02/11/2035	9.200	0,00
350.000	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	8,250 %	12/04/2049	41.563	0,01
20.000	Bonos internacionales del Estado de Líbano – Serie 88	USD	8,200 %	17/05/2033	2.300	0,00
20.000	Bonos internacionales del Estado de Líbano – Serie 89	USD _	8,250 %	17/05/2034	2.300	0,00
					665.553	0,10
Luxemburgo	AN: 5:					
	Altice Financing S.A.	EUR	4,250 %	15/08/2029	1.371.003	0,21
	Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.	USD	6,000 %	27/11/2023	280.481	0,04
	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.	USD	8,625 %	28/04/2034	154.220	0,02
	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.	USD	7,288 %	16/08/2037	730.812	0,11
	GTC Aurora Luxembourg S.A. Guara Norte SARL	EUR	2,250 % 5 108 %	23/06/2026	168.811	0,03
	JSM Global SARL	USD USD	5,198 % 4,750 %	15/06/2034 20/10/2030	358.125 221.884	0,06 0,03
	Puma International Financing S.A.	USD				
	Rede D'or Finance SARL	USD	5,000 % 4,500 %	24/01/2026 22/01/2030	200.750 666.448	0,03 0,10
		_			4.152.534	0,63
Malasia						2,30
	Axiata Spv5 Labuan Ltd.	USD	3,064 %	19/08/2050	356.901	0,05
850.000	Genm Capital Labuan Ltd.	USD	3,882 %	19/04/2031	840.820	0,13
580.000	IOI Investment L Bhd	USD	3,375 %	02/11/2031	579.871	0,09

Description del vision   Description	_			(a)	(h)	Valor de mercado en	% de
Maissia	Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	USD	patrimoni
900.000   Petronais Capital Ltd   USD   4,500 %   2104/2006   1.132.575   77.000   Petronais Capital Ltd   USD   4,500 %   2104/2006   1.132.575   4.068.017   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000 %   4.000	•	·					
Mauricio	•	•	HeD	4 550 9/	21/04/2050	1 122 155	0.1
Mauricio		•					0,1° 0,1°
Maurico	070.000	r etionas Capitai Ltu.	- 03D	4,800 /8	21/04/2000		
420.00   Clean Renewable Power Mauntius Pie Ltd.						4.068.017	0,6
240.000   Greenko Investment Co.   USD   4,775 %   16/08/2023   243,045		Olean Barranda Barranda Marriana Barranda	LIOD	4.050.0/	05/00/0007	400.000	0.0
B80.000 HTA Group Ltd.							0,0 0,0
280.000   India Apport Infrastructure							0,0
660.000   Incila Criven Prover Holdings   USD   4,765 %   20/02/2027   683.300   720.000   ITM Mauritas Investments Lid.   USD   4,765 %   1011/2024   743.393   200.000   UPL Corp., Ltd.   USD   4,600 %   6003/2028   552.2419   460.000   UPL Corp., Ltd.   USD   4,600 %   6003/2028   552.2419   460.000   UPL Corp., Ltd.   USD   4,600 %   6003/2028   552.2419   460.000   UPL Corp., Ltd.   USD   4,625 %   1606/2029   777.791   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.991   777.99		•					0,0
200.00   Network iz List List   S.   50.00   H.   Corp., Ltd.   USD   4.50.00   H.   6009/2028   552.419   450.000   UPL. Corp., Ltd.   USD   4.50.5   10009/2028   552.419   450.000   UPL. Corp., Ltd.   USD   4.50.5   10009/2028   552.419   450.000   UPL. Corp., Ltd.   USD   4.50.5   10009/2028   552.419   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.731   477.73		•			22/02/2027		0,1
SEQUIDO UPL Corp., Ltd.   USD				4,755 %	11/11/2024	743.393	0,1
Mexico							0,0
Mexico							0,0
Maxiso		• • • • • • • • • • • • • • • • • • • •					0,0
Mode	540.000	UPL Corp., Ltd.(4)	080	5,250 %	Perp.		0,0
420,000 Banco Mercantil del Norte S.A. <sup>(c)</sup>   USD   5,750 %   Perp.   245,583     1,860,000 Banco Mercantil del Norte S.A. <sup>(c)</sup>   USD   6,750 %   Perp.   1,923,881     1,860,000 BBWA Bancomer S.A. <sup>(c)</sup>   USD   5,75 %   1801/2033     500,000 BBWA Bancomer S.A. <sup>(c)</sup>   USD   5,675 %   1301/2034     500,000 Cemex SAB de CV   USD   5,675 %   1709/2030     840,000 Cemex SAB de CV   USD   5,200 %   1709/2030     840,000 Cemex SAB de CV   USD   5,200 %   1709/2030     840,000 Cemex SAB de CV   USD   5,200 %   1709/2030     885,213     770,000 Cemex SAB de CV   USD   5,200 %   1709/2030     1,330,000 CIBANCO S.A. Institucion de Banca Multiple Trust CIB   USD   4,375 %   22017/2031   1,276,400     1,300,000 Gruma SAB de CV   USD   4,75 %   22016/2024   892,2811     1,030,000 Gruma SAB de CV   USD   4,75 %   0109/2049   222,926     2,000,000 Gruma SAB de CV   USD   4,75 %   0109/2049   222,926     2,000,000 Gruma SAB de CV   USD   4,75 %   0109/2049   222,926     2,000,000 Gruma SAB de CV   USD   4,75 %   0109/2049   222,926     2,000,000 Gruma SAB de CV   USD   4,75 %   0109/2049   222,926     2,000,000 Gruma SAB de CV   USD   4,75 %   0109/2049   222,926     2,000,000 Gruma SAB de CV   USD   4,75 %   0109/2049   222,926     2,000,000 Gruma SAB de CV   USD   4,75 %   0109/2049   222,926     2,000,000 Gruma SAB de CV   USD   4,75 %   0109/2049   222,926     2,000,000 Gruma SAB de CV   USD   4,75 %   0109/2049   222,926     2,000,000 Gruma SAB de CV   USD   4,75 %   0109/2040   33,31804     6,684,100 Bonos mexicanos - Serie M   MXN   8,000 %   07/11/2047   33,31804     6,684,100 Bonos mexicanos - Serie M   30   MXN   8,500 %   13/11/2038   3,010,344     6,684,100 Bonos mexicanos - Serie M   30   MXN   8,500 %   13/11/2038   3,010,344     6,684,100 Bonos mexicanos - Serie M   30   MXN   8,500 %   13/11/2038   3,010,344     6,684,100 Bonos mexicanos   Serie M   30   MXN   8,500 %   13/11/2038   3,010,344     6,684,100 Bonos mexicanos   Serie M   30   MXN   8,500 %   13/11/2038   3,010,344     6,684,100 Bonos mexicanos   Se						4.781.138	0,72
280.000 Banco Mercantil del Norte S.A. (©)  1.860.000 BBVA Bancomer S.A. (©)  80.000 Cemex S.A.B. te C.V  80.000 Cerv. S.A.B. te C.V  80.0000 Cerv. S.A.B. te C.V  80.0000 Cerv. S.A.B. te C.V  80.0000 Cerv. S.A.B		Banco Mercantil del Norte S A (c)	Hen	5 750 0/	04/40/2024	443 070	0,0
1.880.000 Banco Mercantil del Norte S.A. A.□ USD 5,750 % Perp. 1.923.881 880.000 BBWA Bancomer S.A.□ USD 5,125 % 1801/2033 906.465 590.000 BBWA Bancomer S.A.□ USD 5,575 % 1300/2034 6383.37 200.000 Cemex SAB de CV USD 5,560 % 1701/2020 211.660 840.000 Cemex SAB de CV USD 5,560 % 1701/2020 885.213 1770.000 Cemex SAB de CV□ USD 5,200 % 1709/2030 885.213 1700.000 Cemex SAB de CV□ USD 5,200 % 1709/2030 885.213 1.278.000 1.330.000 CIBANCO S.A. Institucion de Banca Multiple Trust CIB USD 4,375 % 22/07/2031 1.278.000 870.000 CCC SAB de CV USD 4,375 % 22/07/2031 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.0000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.0000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.278.000 1.2							0,0
B80.000 BBVA Bancomer S.A.(**) USD 5.125 % 18(01/2033 906.485 5.90.000 BBVA Bancomer S.A.(**) USD 5.875 % 13(00/2034 638.337 20.000 Cenner S.A.B de CV USD 5.469 % 1911/2029 211.660 R40.000 Cenner S.A.B de CV USD 5.406 % 1911/2029 211.660 R40.000 Cenner S.A.B de CV USD 5.200 % 17(00/2030 885.213 77.000 Cenner S.A.B de CV USD 5.200 % 12(00/2031 12.72 6.040 R70.000 Cenner S.A.B de CV USD 5.200 % 22(00/2031 12.72 6.040 R70.000 Cenner S.A.B de CV USD 5.200 % 22(00/2031 12.72 6.040 R70.000 CGC S.A.B de CV USD 5.200 % 22(00/2031 12.72 6.040 R70.000 CGC S.A.B de CV USD 4.875 % 22(00/2031 12.72 6.040 R70.000 CGC S.A.B de CV USD 4.875 % 20(00/2034 892.811 12.000 R92.81					•		0,2
200.000   Cemex SAB de CV						906.465	0,1
R40,000 Cemex SAB de CV	590.000	BBVA Bancomer S.A. (c)	USD	5,875 %	13/09/2034	638.337	0,1
133 000 Clambax SAB de CV			USD	5,450 %	19/11/2029	211.660	0,0
133 0.00 CIBANCO S.A. Institucion de Banca Multiple Trust CIB USD 4,375 % 22007/2031 1278,040 870 0.00 GCC SAB act CV USD 4,875 % 011/12/2024 1.126,434 1.030 0.00 Gruma SAB de CV USD 4,875 % 011/12/2024 1.126,434 1.030 0.00 Gruma SAB de CV USD 4,000 % 06/09/2049 222.926 270 0.00 Industrias Penoles SAB de CV USD 4,750 % 06/08/2050 289,407 72.104,800 Bonos mexicanos – Serie M MXN 8,000 % 07/11/2047 3.331,804 16.684,100 Bonos mexicanos – Serie M MXN 8,000 % 07/11/2047 3.331,804 16.684,100 Bonos mexicanos – Serie M MXN 8,000 % 07/11/2047 3.331,804 15.94							0,1
870.000 GCC SAB de CV USD 4,575 % 011/12/2024 1.126 434 1.103 0.000 Gruma SAB de CV USD 4,000 % 06/09/2049 222.926 270.000 Industrias Penoles SAB de CV USD 4,750 % 06/08/2050 289,407 72.14 8.00 Bnors mexicanos – Serie M MXN 8,000 % 071/11/2047 3,331.804 61.684.100 Bnors mexicanos – Serie M MXN 8,000 % 071/11/2047 3,331.804 61.684.100 Bnors mexicanos – Serie M 30 MXN 8,500 % 181/11/2038 3,010.344 5590.000 Mexico City Airport Trust USD 3,875 % 3004/2028 606,586 200.000 Mexico City Airport Trust USD 5,500 % 31/10/2046 193,540 579.000 Mexico City Airport Trust USD 5,500 % 31/10/2046 193,540 579.000 Mexico City Airport Trust USD 5,500 % 31/10/2046 193,540 579.000 Mexico City Airport Trust 1444/e) USD 5,500 % 31/10/2046 759,314 1,130,000 Mexico City Airport Trust 1444/e) USD 3,875 % 3004/2028 1,161,767 790.000 Mexico City Airport Trust 1444/e) USD 5,500 % 31/10/2046 764,483 700.000 Bnors internacionales del Estado de México USD 3,750 % 11/01/2028 752,563 440.000 Bnors internacionales del Estado de México USD 3,750 % 11/01/2028 752,563 440.000 Bnors internacionales del Estado de México USD 2,659 % 24/05/2031 477,720 340.000 Bnors internacionales del Estado de México USD 2,659 % 24/05/2031 777,720 340.000 Bnors internacionales del Estado de México USD 3,750 % 11/01/2028 759,858 360.000 Bnors internacionales del Estado de México USD 3,750 % 10/04/2032 379,858 360.000 Bnors internacionales del Estado de México USD 3,770 % 27/04/2032 379,858 360.000 Bnors internacionales del Estado de México USD 3,771 % 24/05/2051 859,013 952.000 Bnors internacionales del Estado de México USD 3,775 % 10/04/2032 379,858 360.000 Bnors internacionales del Estado de México USD 3,775 % 10/04/2032 379,858 360.000 Bnors internacionales del Estado de México USD 3,775 % 10/04/2032 379,858 360.000 Bnors internacionales del Estado de México USD 3,775 % 10/04/2032 389,913 952.000 Bnors internacionales del Estado de México USD 3,775 % 10/04/2032 270,000 Bnors internacionales del Estado de México USD 3,750 % 20/04/2020 270,000 Bnors internacionales del							0,1
1030.000 Gruma SAB de CV 200.000 Grupo Bimbo SAB de CV USD 4,750 % 0608/2039 222.926 270.000 Industrias Penoles SAB de CV USD 4,750 % 0608/2039 222.926 270.000 Industrias Penoles SAB de CV USD 4,750 % 0608/2030 229.9407 72.104.800 Bonos mexicanos — Serie M MXN 8,000 % 10711/2037 3.331.804 61.894.100 Bonos mexicanos — Serie M MXN 8,000 % 10711/2038 3.010.344 590.000 Mexico City Airport Trust USD 3,875 % 3004/2028 606.586 200.000 Mexico City Airport Trust USD 5,500 % 31/10/2046 193.540 579.000 Mexico City Airport Trust 144A(**) USD 5,500 % 31/10/2046 193.540 700.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 110/10/2038 752.653 440.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,250 % 110/10/2038 777.20 340.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,250 % 120/10/2030 448.103 910.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,250 % 120/10/2030 448.103 910.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 110/10/2038 777.20 340.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 120/10/2032 379.858 380.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 120/10/2032 379.858 380.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,771 % 240/5/2031 389.913 952.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,771 % 240/5/2031 389.913 952.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 110/10/2028 75.858 270/10/2032 379.858 830.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 120/10/2032 379.858 830.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 120/10/2032 379.858 830.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 120/10/2032 379.858 830.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 120/10/2032 379.858 830.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 120/10/2032 379.858 830.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 120/10/2020 379.8588 830.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 120/10/2020 379.8788 830.000 Bonos internacionales del Estado de México USD							0,1
200.000 Grupo Bimbo SAB de CV 270.000 Industrias Penoles SAB de CV USD 4,750 % 06/09/2059 289.407 72.104.800 Bonos mexicanos - Serie M MXN 8,000 % 07/11/2047 3.331.804 61.684.100 Bonos mexicanos - Serie M MXN 8,000 % 18/11/2038 3.010.344 61.684.100 Bonos mexicanos - Serie M 30 MXN 8,500 % 18/11/2038 3.010.344 61.684.100 Bonos mexicanos - Serie M 30 MXN 8,500 % 18/11/2038 3.010.344 61.684.100 Bonos mexicanos - Serie M 30 MXN 8,500 % 18/11/2038 3.010.344 61.684.100 Mexico City Airport Trust USD 3,675 % 30/04/2028 606.586 200.000 Mexico City Airport Trust USD 5,500 % 31/10/2046 193.540 11.30.000 Mexico City Airport Trust 1.30.000 Mexico City Airport Trust 1444.401 USD 3,675 % 30/04/2028 1.161.767 790.000 Mexico City Airport Trust 1444.401 USD 3,675 % 30/04/2028 1.161.767 790.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 11/10/2028 752.563 440.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 11/10/2028 752.563 440.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,250 % 16/04/2030 448.103 910.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 2,659 % 24/05/2031 877.720 340.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 4,750 % 27/04/2032 379.858 300.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 19/04/2071 525.311 200.000 Minera Mexico S.A. de CV USD 3,750 % 19/04/2071 525.311 200.000 Minera Mexico S.A. de CV USD 3,750 % 19/04/2071 525.311 200.000 Minera Mexico S.A. de CV USD 3,750 % 19/04/2071 525.311 200.000 Minera Mexico S.A. de CV USD 4,500 % 26/01/2050 215.650 40,000 Petroleos Mexicanos USD 6,500 % 23/01/2050 215.650 330.000 Petroleos Mexicanos USD 6,500 % 23/01/2050 215.650 330.000 Petroleos Mexicanos USD 6,500 % 23/01/2050 215.650 330.000 Petroleos Mexicanos USD 6,500 % 23/01/2050 389.979 30.000 Petroleos Mexicanos USD 6,500 % 23/01/2050 275.558 375.000 Bonos internacionales del Estado de Móxico USD 7,375 % 21/02/2024 725.358 380.000 Bonos internacionales del Estado de Móxico USD 7,375 % 23/01/2050 315.560 330.000 Petroleos Mexicanos USD 6,500 % 23/01/2050 32.98.713 3							0,1 0,1
270.000 Industrias Penoles SAB de CV 72.104.800 Bonos mexicanos – Serie M MXN 8,000 % 7711/2047 3, 331.804 61.684.100 Bonos mexicanos – Serie M 30 MXN 8,500 % 818/11/2038 3, 3/10, 3/44 659.000 Mexico City Airport Trust USD 3,875 % 3004/2028 606.586 200.000 Mexico City Airport Trust USD 5,500 % 31/10/2046 193.540 579.000 Mexico City Airport Trust USD 5,500 % 31/10/2046 193.540 579.000 Mexico City Airport Trust USD 5,500 % 31/10/2047 559.314 1.130.000 Mexico City Airport Trust USD 5,500 % 31/10/2047 559.314 1.130.000 Mexico City Airport Trust 1444A** USD 5,500 % 31/10/2046 764.483 70.0000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 11/10/2046 764.483 40.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 11/10/2046 764.483 40.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 11/10/2046 764.483 40.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 11/10/2046 764.483 31/10/2040 762.683 340.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 11/10/2030 448.103 91.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 4,760 % 27/10/4/2032 379.585 360.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 4,760 % 27/10/4/2032 379.585 360.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 4,760 % 27/10/4/2032 399.913 360.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 4,760 % 27/10/4/2032 399.913 360.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,771 % 24/05/2061 859.013 600.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 19/04/2071 525.311 600.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 19/04/2071 525.311 600.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 19/04/2071 525.311 600.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 4,760 % 2,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,250 % 1,25							0,0
Test		•					0,0
Sept							0,5
200.000 Mexico City Airport Trust 579.000 Mexico City Airport Trust 1.130.000 Mexico City Airport Trust 1.130.000 Mexico City Airport Trust 144A(e) 1.150.000 Mexico City Airport Trust 144A(e) 1.150.	61.684.100	Bonos mexicanos – Serie M 30	MXN	8,500 %	18/11/2038	3.010.344	0,4
F59.000   Mexico City Airport Trust   144A(*)   USD   5,500 %   31/07/2047   559.314							0,0
1.130.000   Mexico City Airport Trust 144A e0   USD   3,875 %   30,042028   1.161.767   790.000   Mexico City Airport Trust 144A e0   USD   5,500 %   31/10/2046   764.483   700.000   Bonos internacionales del Estado de México   USD   3,750 %   11/01/2028   752.563   440.000   Bonos internacionales del Estado de México   USD   3,260 %   16/04/2030   448.103   410.000   Bonos internacionales del Estado de México   USD   3,260 %   24/05/2031   877.720   340.000   Bonos internacionales del Estado de México   USD   4,750 %   27/04/2032   379.858   360.000   Bonos internacionales del Estado de México   USD   4,750 %   27/04/2032   379.858   360.000   Bonos internacionales del Estado de México   USD   3,771 %   24/05/2031   859.013   600.000   Bonos internacionales del Estado de México   USD   3,771 %   24/05/2031   859.013   600.000   Bonos internacionales del Estado de México   USD   3,770 %   19/04/2071   525.311   200.000   Minera Mexico S.A. de CV   USD   3,750 %   19/04/2071   525.311   200.000   Minera Mexico S.A. de CV   USD   3,750 %   26/01/2050   215.650   400.000   Petroleos Mexicanos   EUR   5,125 %   15/03/2023   469.477   630.000   Petroleos Mexicanos   EUR   3,750 %   21/02/2024   725.358   220.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,500 %   23/01/2027   389.979   30.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,500 %   13/03/2027   389.979   30.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,505 %   23/01/2045   24.075   20.0000   Petroleos Mexicanos   USD   6,750 %   21/09/2047   269.778   361.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,750 %   21/09/2047   269.778   361.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,505 %   23/01/2050   1,179.845   178.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,505 %   23/01/2050   1,179.845   178.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,505 %   23/01/2050   1,179.845   178.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,505 %   27/01/2028   164.468   282.66.564   200.000   Bonos internacionales del Estado de Mongolia   USD   5,625 %   07/04/2026   276.750   07/07/2027   189.000   1755.463   200.000   Bonos internacionales del Esta		• •					0,0
790,000 Mexico City Airport Trust 144A(**) 700,000 Bonos internacionales del Estado de México 700,000 Bonos internacionales del Estado de México 910,000 Petroleos Mexicanos 910,000 Petroleos Mexicano							0,0
700.000 Bonos internacionales del Estado de México 440.000 Bonos internacionales del Estado de México 440.000 Bonos internacionales del Estado de México 480.000 Bonos internacionales del Estado de México 481.000 Bonos internacionales del Estado de México 481.000 Bonos internacionales del Estado de México 482.000 Bonos internacionales del Estado de México 483.000 Bonos internacionales del Estado de México 483.000 Bonos internacionales del Estado de México 483.000 Bonos internacionales del Estado de México 485.000 Petroles Méxicanos 485.00							0,1 0,1
440.000 Bonos internacionales del Estado de México 910.000 Betroleos Méxicanos 910.000 Petroleos Méxicanos 910.000 Petroleos Méxicanos 910.000 Petroleos Méxicanos 910.000 Betroleos Méxicanos 910.000 Petroleos Méxicanos 910.000 Petro							0,1
910,000 Bonos internacionales del Estado de México 340,000 Bonos internacionales del Estado de México 340,000 Bonos internacionales del Estado de México 360,000 Bonos internacionales del Estado de México EUR 2,250 % 12/08/2036 389,913 952,000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,771 % 24/05/2061 859,013 600,000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 19/04/2071 525,311 200,000 Minera Mexico S.A. de CV USD 4,500 % 26/01/2050 215,650 400,000 Petroleos Mexicanos EUR 5,125 % 15/03/2023 469,477 630,000 Petroleos Mexicanos EUR 5,125 % 15/03/2023 469,477 630,000 Petroleos Mexicanos USD 6,490 % 23/01/2027 225,918 380,000 Petroleos Mexicanos USD 6,500 % 13/03/2027 389,979 30,000 Petroleos Mexicanos USD 6,500 % 13/03/2027 389,979 30,000 Petroleos Mexicanos USD 6,505 % 23/01/2045 24,075 200,000 Petroleos Mexicanos USD 6,525 % 23/01/2046 151,750 330,000 Petroleos Mexicanos USD 6,750 % 21/09/2047 269,778 361,000 Petroleos Mexicanos USD 6,750 % 21/09/2047 269,778 361,000 Petroleos Mexicanos USD 6,500 % 12/02/2048 283,214 1.319,000 Petroleos Mexicanos USD 6,950 % 23/01/2060 145,248 379,000 Unifin Financiera SAB de CV USD 7,375 % 12/02/206 315,560 200,000 Unifin Financiera SAB de CV USD 7,375 % 12/02/206 315,560 200,000 Bonos internacionales del Estado de Mongolia USD 5,125 % 07/04/2026 276,750 200,000 Bonos internacionales del Estado de Mongolia USD 5,125 % 07/04/2027 189,000  Marruecos 370,000 Bonos internacionales del Estado de Mongolia USD 5,125 % 07/07/2027 189,000							0,0
360.00 Bonos internacionales del Estado de México EUR 2,250 % 12/08/2036 389,913 952.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,770 % 24/05/2061 859,013 600.000 Bonos internacionales del Estado de México USD 3,750 % 19/04/2071 525,311 200.000 Minera Mexico S.A. de CV USD 4,500 % 26/01/2050 215,650 400.000 Petroleos Mexicanos EUR 5,125 % 15/03/2023 469,477 630.000 Petroleos Mexicanos EUR 3,750 % 21/02/2024 725,358 220.000 Petroleos Mexicanos USD 6,490 % 23/01/2027 225,918 380.000 Petroleos Mexicanos USD 6,500 % 13/03/2027 389,979 30.000 Petroleos Mexicanos USD 6,500 % 13/03/2027 389,979 30.000 Petroleos Mexicanos USD 6,505 % 23/01/2045 24,075 200.000 Petroleos Mexicanos USD 5,625 % 23/01/2046 151,750 330,000 Petroleos Mexicanos USD 5,625 % 23/01/2046 151,750 330,000 Petroleos Mexicanos USD 6,350 % 12/02/2048 283,214 1.319.000 Petroleos Mexicanos USD 6,350 % 12/02/2048 283,214 1.319.000 Petroleos Mexicanos USD 7,690 % 23/01/2050 1.179,845 178,000 Petroleos Mexicanos USD 7,690 % 23/01/2050 1.179,845 179,000 Unifin Financiera SAB de CV USD 8,375 % 10/05/2023 289,713 270,000 Bonos internacionales del Estado de Mongolia USD 5,625 % 07/04/2026 276,750 170,000 Bonos internacionales del Estado de Mongolia USD 3,500 % 07/07/2027 189,000 T755,463 170,000 Bonos internacionales del Estado de Mongolia USD 3,500 % 07/07/2027 189,000 Marruecos 370,000 Bonos internacionales del Estado de Mongolia USD 3,500 % 07/07/2027 358,669	910.000	Bonos internacionales del Estado de México				877.720	0,1
952.000 Bonos internacionales del Estado de México  800.000 Petroleos Mexicanos  800.000 Petroleos	340.000	Bonos internacionales del Estado de México	USD	4,750 %	27/04/2032	379.858	0,0
600.000   Bonos internacionales del Estado de México   USD   3,750 %   19/04/2071   525.311     200.000   Minera Mexico S.A. de CV   USD   4,500 %   26/01/2050   215.650     400.000   Petroleos Mexicanos   EUR   5,125 %   15/03/2023   469.477     630.000   Petroleos Mexicanos   EUR   3,750 %   21/02/2024   725.358     220.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,490 %   23/01/2027   225.918     380.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,500 %   13/03/2027   389.979     30.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,375 %   23/01/2045   24.075     200.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,550 %   23/01/2045   24.075     200.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,750 %   21/09/2047   269.778     361.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,350 %   21/09/2047   269.778     361.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,350 %   21/09/2048   283.214     1.319.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,950 %   23/01/2050   1.179.845     178.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,950 %   23/01/2050   1.179.845     178.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,950 %   28/01/2060   145.248     379.000   Unifin Financiera SAB de CV   USD   8,375 %   27/01/2028   164.468      Mongolia   280.000   Bonos internacionales del Estado de Mongolia   USD   5,625 %   07/04/2026   276.750     200.000   Bonos internacionales del Estado de Mongolia   USD   5,125 %   07/04/2026   276.750     200.000   Bonos internacionales del Estado de Mongolia   USD   3,500 %   07/07/2027   189.000      Marruecos   370.000   Bonos internacionales del Estado de Mongolia   USD   3,500 %   15/12/2027   358.669							0,0
200.000   Minera Mexico S.A. de CV							0,1
400.000   Petroleos Mexicanos   EUR   5,125 %   15/03/2023   469.477							0,0
630.000   Petroleos Mexicanos   EUR   3,750 %   21/02/2024   725.358   220.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,490 %   23/01/2027   225.918   380.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,500 %   13/03/2027   389.979   30.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,500 %   13/03/2027   389.979   30.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,375 %   23/01/2045   24.075   200.000   Petroleos Mexicanos   USD   5,625 %   23/01/2046   151.750   330.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,750 %   21/09/2047   269.778   361.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,350 %   12/02/2048   283.214   1.319.000   Petroleos Mexicanos   USD   7,690 %   23/01/2050   1.179.845   178.000   Petroleos Mexicanos   USD   7,690 %   23/01/2050   1.179.845   178.000   Petroleos Mexicanos   USD   7,375 %   12/02/2060   145.248   379.000   Unifin Financiera SAB de CV   USD   7,375 %   12/02/2026   315.560   200.000   Unifin Financiera SAB de CV   USD   8,375 %   27/01/2028   164.468   280.000   Respectively   28							0,0
220.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,490 %   23/01/2027   225.918   380.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,500 %   13/03/2027   389.979   30.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,375 %   23/01/2045   24.075   200.000   Petroleos Mexicanos   USD   5,625 %   23/01/2046   151.750   330.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,750 %   21/09/2047   269.778   361.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,350 %   12/02/2048   283.214   1.319.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,950 %   23/01/2050   1.179.845   178.000   Petroleos Mexicanos   USD   7,690 %   23/01/2050   1.179.845   178.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,950 %   28/01/2060   145.248   379.000   Unifin Financiera SAB de CV   USD   7,375 %   12/02/2026   315.560   200.000   Unifin Financiera SAB de CV   USD   8,375 %   27/01/2028   164.468   280.000   80nos internacionales del Estado de Mongolia   USD   5,625 %   07/04/2026   276.750   200.000   Bonos internacionales del Estado de Mongolia   USD   3,500 %   07/07/2027   189.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.000   180.0000   180.0000   180.0000   180.0000   180.0000   180.0000   180.0000   180.0000   180.0000   18							0,0
380.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,500 %   13/03/2027   389.979   30.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,375 %   23/01/2045   24.075   200.000   Petroleos Mexicanos   USD   5,625 %   23/01/2046   151.750   330.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,750 %   21/09/2047   269.778   361.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,350 %   12/02/2048   283.214   1.319.000   Petroleos Mexicanos   USD   7,690 %   23/01/2050   1.179.845   178.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,950 %   28/01/2060   145.248   379.000   Unifin Financiera SAB de CV   USD   7,375 %   12/02/2026   315.560   200.000   Unifin Financiera SAB de CV   USD   8,375 %   27/01/2028   164.468   280.000   Bonos internacionales del Estado de Mongolia   USD   5,625 %   07/04/2026   276.750   200.000   Bonos internacionales del Estado de Mongolia   USD   3,500 %   07/07/2027   189.000   Marruecos   370.000   Bonos internacionales del Estado de Mongolia   USD   3,500 %   07/07/2027   358.669   Marruecos   370.000   Bonos internacionales del Estado de Marruecos   USD   2,375 %   15/12/2027   358.669				.,			0,0
200.000   Petroleos Mexicanos   USD   5,625 %   23/01/2046   151.750							0,0
330.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,750 %   21/09/2047   269.778   361.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,350 %   12/02/2048   283.214   1.319.000   Petroleos Mexicanos   USD   7,690 %   23/01/2050   1.179.845   178.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,950 %   28/01/2060   145.248   178.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,950 %   28/01/2060   145.248   178.000   Unifin Financiera SAB de CV   USD   7,375 %   12/02/2026   315.560   12/02/2026   315.560   12/02/2026   315.560   12/02/2026   164.468   12/02/2026   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.468   164.							0,0
361.000 Petroleos Mexicanos USD 6,350 % 12/02/2048 283.214 1.319.000 Petroleos Mexicanos USD 7,690 % 23/01/2050 1.179.845 178.000 Petroleos Mexicanos USD 6,950 % 28/01/2060 145.248 379.000 Unifin Financiera SAB de CV USD 7,375 % 12/02/2026 315.560 200.000 Unifin Financiera SAB de CV USD 8,375 % 27/01/2028 164.468   Mongolia  280.000 Bonos internacionales del Estado de Mongolia USD 5,625 % 01/05/2023 289.713 270.000 Bonos internacionales del Estado de Mongolia USD 5,125 % 07/04/2026 276.750 200.000 Bonos internacionales del Estado de Mongolia USD 3,500 % 07/07/2027 189.000  Marruecos  370.000 Bonos internacionales del Estado de Marruecos USD 2,375 % 15/12/2027 358.669							0,0
1.319.000   Petroleos Mexicanos   USD   7,690 %   23/01/2050   1.179.845     178.000   Petroleos Mexicanos   USD   6,950 %   28/01/2060   145.248     379.000   Unifin Financiera SAB de CV   USD   7,375 %   12/02/2026   315.560     200.000   Unifin Financiera SAB de CV   USD   8,375 %   27/01/2028   164.468     28.265.564							0,0
178.000       Petroleos Mexicanos       USD       6,950 %       28/01/2060       145.248         379.000       Unifin Financiera SAB de CV       USD       7,375 %       12/02/2026       315.560         200.000       Unifin Financiera SAB de CV       USD       8,375 %       27/01/2028       164.468         **Mongolia***         280.000       Bonos internacionales del Estado de Mongolia       USD       5,625 %       01/05/2023       289.713         270.000       Bonos internacionales del Estado de Mongolia       USD       5,125 %       07/04/2026       276.750         200.000       Bonos internacionales del Estado de Mongolia       USD       3,500 %       07/07/2027       189.000         **Marruecos***         370.000       Bonos internacionales del Estado de Marruecos       USD       2,375 %       15/12/2027       358.669							0,0
379.000 Unifin Financiera SAB de CV 200.000 Unifin Financiera SAB de CV 200.000 Unifin Financiera SAB de CV USD 8,375 % 27/01/2028 164.468  28.265.564   Mongolia 280.000 Bonos internacionales del Estado de Mongolia 270.000 Bonos internacionales del Estado de Mongolia 200.000 Bonos internacionales del Estado de Marruecos 200.0							0,1
200.000 Unifin Financiera SAB de CV							0,0: 0,0:
Mongolia   280.000   Bonos internacionales del Estado de Mongolia   USD   5,625 %   01/05/2023   289.713   270.000   Bonos internacionales del Estado de Mongolia   USD   5,125 %   07/04/2026   276.750   200.000   Bonos internacionales del Estado de Mongolia   USD   3,500 %   07/07/2027   189.000     755.463							0,0
Mongolia   280.000   Bonos internacionales del Estado de Mongolia   USD   5,625 %   01/05/2023   289.713   270.000   Bonos internacionales del Estado de Mongolia   USD   5,125 %   07/04/2026   276.750   200.000   Bonos internacionales del Estado de Mongolia   USD   3,500 %   07/07/2027   189.000   755.463        Marruecos   370.000   Bonos internacionales del Estado de Marruecos   USD   2,375 %   15/12/2027   358.669			_				4,28
280.000 Bonos internacionales del Estado de Mongolia 270.000 Bonos internacionales del Estado de Mongolia 270.000 Bonos internacionales del Estado de Mongolia 200.000 Bonos internacionales del Estado de Mongolia USD 3,500 % 07/04/2026 276.750 07/04/2027 189.000 755.463  Marruecos 370.000 Bonos internacionales del Estado de Marruecos USD 2,375 % 15/12/2027 358.669	Mongolia						-,-
270.000 Bonos internacionales del Estado de Mongolia 200.000 Bonos internacionales del Estado de Mongolia USD 3,500 % 07/04/2026 276.750 189.000 755.463  Marruecos 370.000 Bonos internacionales del Estado de Marruecos USD 2,375 % 15/12/2027 358.669	-	Bonos internacionales del Estado de Mongolia	USD	5,625 %	01/05/2023	289.713	0,0
755.463  Marruecos  370.000 Bonos internacionales del Estado de Marruecos  USD 2,375 % 15/12/2027 358.669							0,0
Marruecos         370.000 Bonos internacionales del Estado de Marruecos         USD         2,375 %         15/12/2027         358.669	200.000	Bonos internacionales del Estado de Mongolia	USD	3,500 %	07/07/2027	189.000	0,0
370.000 Bonos internacionales del Estado de Marruecos USD 2,375 % 15/12/2027 358.669						755.463	0,1
•							
							0,0 0,1
640.000 Bonos internacionales del Estado de Marruecos USD 4,000 % 15/12/2050 561.600							0,0

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del
Bonos – (cont		Divisa	ripo de interes	r echa de vencimento		patimonic
Marruecos – (con	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					
	OCP S.A.	USD	3,750 %	23/06/2031	474.075	0,07
620.000	OCP S.A.	USD	5,125 %	23/06/2051	585.683	0,09
600.000	OCP S.A. 144A <sup>(e)</sup>	USD	3,750 %	23/06/2031	580.500	0,09
270.000	OCP S.A. 144A <sup>(e)</sup>	USD	5,125 %	23/06/2051	255.055	0,04
					3.674.632	0,56
Mozambique	Bonos internacionales de Mozambique <sup>(d)</sup>	USD	5,000 %	15/09/2031	322.239	0,05
Países Bajos	Donos internacionales de Mozambique		0,000 70	10/00/2001	022.200	0,00
-	First Bank of Nigeria Ltd. Via FBN Finance Co., BV	USD	8,625 %	27/10/2025	416.325	0,06
	Greenko Dutch BV	USD	3,850 %	29/03/2026	358.146	0,06
1.070.000	Lukoil International Finance BV	USD	4,750 %	02/11/2026	1.161.731	0,18
830.000	Lukoil Securities BV	USD	3,875 %	06/05/2030	851.373	0,13
1.483.000	Metinvest BV	USD	7,750 %	23/04/2023	1.515.937	0,23
1.090.000	Minejesa Capital BV	USD	4,625 %	10/08/2030	1.121.337	0,17
840.000	Mong Duong Finance Holdings BV	USD	5,125 %	07/05/2029	818.960	0,12
831.055	MV24 Capital BV	USD	6,748 %	01/06/2034	852.351	0,13
780.000	NE Property BV	EUR	1,750 %	23/11/2024	912.346	0,14
	NE Property BV	EUR	1,875 %	09/10/2026	851.758	0,13
	Prosus NV	USD	3,680 %	21/01/2030	989.849	0,15
	Prosus NV	USD	4,027 %	03/08/2050	748.000	0,11
	Royal Capital BV <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	Perp.	212.041	0,03
	Syngenta Finance NV	EUR	1,250 %	10/09/2027	345.226	0,05
	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	USD	2,800 %	21/07/2023	1.037.725	0,16
	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	USD	6,000 %	15/04/2024	679.250	0,10
	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	USD	4,750 %	09/05/2027	759.050	0,12
	VEON Holdings BV	USD	3,375 %	25/11/2027	333.200	0,05
320.000	Vivo Energy Investments BV	USD _	5,125 %	24/09/2027	336.261	0,05
Nigeria					14.300.866	2,17
-	Access Bank Plc.	USD	6,125 %	21/09/2026	914.250	0,14
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	6,500 %	28/11/2027	1.815.824	0.27
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	6,125 %	28/09/2028	188.374	0,03
312.000	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	8,747 %	21/01/2031	317.850	0,05
402.000	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	7,625 %	28/11/2047	344.213	0,05
750.000	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	8,250 %	28/09/2051	674.062	0,10
1.100.000	SEPLAT Energy Plc.	USD	7,750 %	01/04/2026	1.105.500	0,17
200.000	United Bank for Africa Plc.	USD _	7,750 %	08/06/2022	205.238	0,03
					5.565.311	0,84
Noruega 1.240.000	DNO ASA 144A <sup>(e)</sup>	USD	8,375 %	29/05/2024	1.289.414	0,20
	DNO ASA 144A <sup>(e)</sup>	USD _	7,875 %	09/09/2026	197.360	0,03
					1.486.774	0,23
Omán 840 000	Ronos internacionales del Estado de Omés	USD	5.625 %	17/01/2028	864.150	0.43
	Bonos internacionales del Estado de Omán Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	5,625 % 6,250 %	25/01/2031	1.122.162	0,13 0,17
	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD		28/10/2032	402.300	0,17
	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	7,375 % 6,500 %	08/03/2047	349.188	0,00
	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	6,750 %	17/01/2048	1.379.950	0,03
	Oman Sovereign Sukuk Co.	USD	4,875 %	15/06/2030	432.037	0,07
		_			4.549.787	0,69
Pakistán						
	Bonos internacionales del Estado de Pakistán	USD	6,000 %	08/04/2026	326.700	0,05
	Bonos internacionales del Estado de Pakistán	USD	6,875 %	05/12/2027	209.029	0,03
	Bonos internacionales del Estado de Pakistán Bonos internacionales del Estado de Pakistán	USD USD	7,375 %	08/04/2031	1.205.900	0,18
	Pakistan Water & Power Development Authority	USD	8,875 % 7,500 %	08/04/2051 04/06/2031	389.000 348.300	0,06 0,06
000.000	Takistan Water & Fewer Development Authority	_	7,000 70	04/00/2001	2.478.929	0,38
Panamá						
	Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.	USD	4,000 %	11/08/2041	345.015	0,05
	Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.	USD	5,125 %	11/08/2061	974.211	0,15
	AES Panama Generation Holdings SRL	USD	4,375 %	31/05/2030	1.614.721	0,24
	Banco Latinoamericano de Comercio Exterior S.A.	USD	2,375 %	14/09/2025	1.073.600	0,16
1.000.000	Danco Latinoamencano de Comercio Exterior C.A.	000	2,010 /0	1-1/00/2020	1.075.000	0,10

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del
Bonos – (cont	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					
Panamá – (con	,					
900.000	Cable Onda S.A.	USD	4,500 %	30/01/2030	925.540	0,14
420.000	Bonos internacionales del Estado de Panamá	USD	3,870 %	23/07/2060	405.678	0,06
495.000	Panamá Notas del Tesoro 144A <sup>(e)</sup>	USD -	3,750 %	17/04/2026	525.253	0,08
					6.163.858	0,93
Papúa Nueva G 520.000	Bunea Bonos internacionales del Estado de Papúa Nueva Guinea	USD	8,375 %	04/10/2028	525.200	0,08
Paraguay						
	Banco Continental SAECA	USD	2,750 %	10/12/2025	1.181.075	0,18
	Bonos internacionales del Estado de Paraguay	USD	4,950 %	28/04/2031	1.267.544	0,19
1.373.000	Bonos internacionales del Estado de Paraguay	USD	2,739 %	29/01/2033	1.292.769	0,20
1.360.000	Telefonica Celular del Paraguay S.A.	USD _	5,875 %	15/04/2027	1.410.415	0,21
					5.151.803	0,78
Perú 2.417.779	ABY Transmision Sur S.A.	USD	6,875 %	30/04/2043	3.168.802	0,48
	Consorcio Transmantaro S.A.	USD	4,700 %	16/04/2034	1.114.787	0,17
	Corp. Lindley S.A.	USD	4,625 %	12/04/2023	1.286.399	0,19
	Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	USD	6,375 %	01/06/2028	646.030	0,10
	InRetail Consumer	USD	3,250 %	22/03/2028	1.671.100	0,25
	Bonos del Estado de Perú	PEN	5,400 %	12/08/2034	2.219.387	0,33
	Bonos del Estado de Perú	PEN	5,350 %	12/08/2040	775.964	0,12
	Bonos internacionales del Estado de Perú	PEN	6,350 %	12/08/2028	654.288	0,10
	Bonos internacionales del Estado de Perú	PEN	6,950 %	12/08/2031	1.898.737	0,29
	Bonos internacionales del Estado de Perú	EUR	1,250 %	11/03/2033	2.691.586	0,41
	SAN Miguel Industrias Pet S.A. Via NG PET R&P Latin America S.A.	USD	3,500 %	02/08/2028	1.301.408	0,20
1.330.000	SAN MIGUEL INCUSTRAS FELS.A. VIA NO FET RAF LAUTAMENCA S.A.	030 -	3,300 %	02/06/2026	17.428.488	· ·
Filinings					17.420.400	2,64
Filipinas 340 000	Globe Telecom, Inc.(c)	USD	4,200 %	Perp.	347.082	0,05
	International Container Terminal Services, Inc.	USD	4,750 %	17/06/2030	449.938	0,07
	Bonos del Estado de Filipinas – Serie 1064	PHP	6,875 %	10/01/2029	423.190	0,06
	Bonos internacionales del Estado de Filipinas	PHP	6,250 %	14/01/2036	453.993	0,07
	Bonos internacionales del Estado de Filipinas	USD	2,950 %	05/05/2045	192.554	0,03
	Bonos internacionales del Estado de Filipinas	USD	2,650 %	10/12/2045	479.745	0,07
	PLDT, Inc.	USD	2,500 %	23/01/2031	296.099	0,05
	SMC Global Power Holdings Corp.(c)	USD	7,000 %	Perp.	826.610	0,13
		_			3.469.211	0,53
Polonia						
7.225.000	Bonos del Estado de Polonia – Serie 1030	PLN	1,250 %	25/10/2030	1.521.664	0,23
51.550.000	Bonos del Estado de Polonia – Serie 425	PLN	0,750 %	25/04/2025	11.682.942	1,77
	Bonos del Estado de Polonia – Serie 428	PLN	2,750 %	25/04/2028	3.870.835	0,59
20.190.000	Bonos del Estado de Polonia – Serie 727	PLN -	2,500 %	25/07/2027	4.761.244	0,72
					21.836.685	3,31
2 660 000	Qatar Energy	USD	3,125 %	12/07/2041	2.671.970	0,41
	Qatar Energy	USD	3,300 %	12/07/2051	349.138	0,05
	Bonos internacionales del Estado de Catar	USD	5,103 %	23/04/2048	3.018.512	0,46
		_			6.039.620	0,92
Rumanía						
	Bonos del Estado de Rumanía – Serie 15 a	RON	3,650 %	24/09/2031	785.651	0,12
	Bonos del Estado de Rumanía – Serie 8 a	RON	4,150 %	26/01/2028	1.449.403	0,22
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	USD	3,000 %	14/02/2031	325.875	0,05
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,124 %	16/07/2031	98.182	0,02
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,000 %	28/01/2032	464.983	0,07
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,625 %	02/12/2040	171.794	0,03
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,750 %	14/04/2041	81.698	0,01
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	4,625 %	03/04/2049	12.772	0,00
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	3,375 %	28/01/2050	491.025	0,07
1.270.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	USD _	4,000 %	14/02/2051	1.239.044	0,19
					5.120.427	0,78
Rusia	Ronos foderales de Rusia, Ronos CEZ, Sorio 6224	RUB	7 700 0/	22/02/2022	577 101	0,09
	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6221		7,700 %	23/03/2033	577.191 5.641.526	
430.380.000	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ – Serie 6223	RUB	6,500 %	28/02/2024	5.641.526	0,8

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de
	· · · ·	Divisa	ripo de interes.	recha de vencimiento	090	patrimonic
Bonos – (cont Rusia – (contin	·					
•	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ – Serie 6224	RUB	6.900 %	23/05/2029	64.399	0,0
	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ – Serie 6226	RUB	7,950 %	07/10/2026	6.942.148	1,0
408.740.000	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6228	RUB	7,650 %	10/04/2030	5.309.322	0,80
137.580.000	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6230	RUB	7,700 %	16/03/2039	1.782.345	0,2
85.335.000	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6235	RUB	5,900 %	12/03/2031	979.075	0,1
92.830.000	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6237	RUB	6,700 %	14/03/2029	1.141.291	0,1
	Bonos extranjeros rusos – Eurobono	EUR	1,850 %	20/11/2032	901.633	0,14
1.300.000	Bonos extranjeros rusos – Eurobono	EUR _	2,650 %	27/05/2036	1.491.779	0,2
					24.830.709	3,70
Arabia Saudí 1.320.000	Bonos internacionales del Estado saudí	USD	3,250 %	17/11/2051	1.286.340	0,19
	Bonos internacionales del Estado saudí	USD	3,750 %	21/01/2055	591.220	0,0
	Bonos internacionales del Estado saudí	USD	4,500 %	22/04/2060	3.206.500	0,49
		_			5.084.060	0,77
Senegal						
750.000	Bonos internacionales del Estado de Senegal	EUR	4,750 %	13/03/2028	856.588	0,13
460.000	Bonos internacionales del Estado de Senegal	EUR _	5,375 %	08/06/2037	483.501	0,07
					1.340.089	0,20
Serbia 700 000	Dance internacionales de Carbio(f)	EUD	1 000 %	22/00/2020	004.040	0.44
	Bonos internacionales de Serbia <sup>(c)</sup>	EUR	1,000 %	23/09/2028	824.842	0,12
1 000 000	ABJA Investment Co., Pte Ltd.	USD	5,450 %	24/01/2028	1.078.750	0,16
	Global Prime Capital Pte Ltd.	USD	5,950 %	23/01/2025	286.300	0,04
	Indika Energy Capital IV Pte Ltd.	USD	8,250 %	22/10/2025	258.750	0,0
	Innovate Capital Pte Ltd. – Serie MCB <sup>(c)</sup>	USD	6,000 %	11/12/2024	120.333	0,0
	Jollibee Worldwide Pte Ltd. (c)	USD	3,900 %	Perp.	202.337	0,0
	LLPL Capital Pte Ltd.	USD	6,875 %	04/02/2039	1.241.552	0,19
	Modernland Overseas Pte Ltd.	USD	6,950 %	13/04/2024	92.619	0,0
	Parkway Pantai Ltd.(c)	USD	4,250 %	Perp.	832.114	0,13
	Tiger Holdco Pte Ltd. 144A <sup>(e)</sup>	USD	13,000 %	10/06/2023	418.521	0,06
	TML Holdings Pte Ltd.	USD	5,500 %	03/06/2024	365.312	0,00
200.000	TML Holdings Pte Ltd.	USD _	4,350 %	09/06/2026	202.500	0,03
					5.099.088	0,77
Sudáfrica	(1)					
	Absa Group Ltd. (c)	USD	6,375 %	Perp.	468.050	0,0
	Bidvest Group Ltd.	USD	3,625 %	23/09/2026	398.000	0,06
	Growthpoint Properties International Pty Ltd.	USD	5,872 %	02/05/2023	518.638	0,08
	Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2030	ZAR	8,000 %	31/01/2030	4.381.996	0,66
	Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2032	ZAR	8,250 %	31/03/2032	7.095.189	1,07
	Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2035 Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2037	ZAR ZAR	8,875 %	28/02/2035 31/01/2037	1.752.117 8.122.017	0,2 <sup>-</sup> 1,2 <sup>-</sup>
	Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2037  Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2044	ZAR	8,500 % 8,750 %	31/01/2044	2.674.364	0,4
	Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2048	ZAR	8.750 %	28/02/2048	1.180.501	0,4
	Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie R186	ZAR	10,500 %	21/12/2026	5.480.694	0,83
	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	4,875 %	14/04/2026	433.619	0,0
	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	4,850 %	30/09/2029	1.049.633	0,1
	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	5,650 %	27/09/2047	397.682	0,06
	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	5,750 %	30/09/2049	194.978	0,03
					34.147.478	5,18
Corea del Sur						
	Shinhan Financial Group Co., Ltd.(c)	USD	2,875 %	Perp.	591.750	0,09
España 622.696	International Airport Finance S.A.	USD	12,000 %	15/03/2033	676.999	0,10
Sri Lanka			.2,555 /6		2.0.000	0,10
	Bonos internacionales del Estado de Sri Lanka	USD	6,350 %	28/06/2024	232.652	0,0
	Bonos internacionales del Estado de Sri Lanka	USD	6,125 %	03/06/2025	161.241	0,02
	Bonos internacionales del Estado de Sri Lanka	USD	6,850 %	03/11/2025	660.995	0,1
1.160.000					369.977	0,0
	Bonos internacionales del Estado de Sri Lanka	USD	6,200 %	11/05/2027	309.911	0.0
670.000		USD USD	6,200 % 6,750 %	18/04/2028	433.958	
670.000 780.000	Bonos internacionales del Estado de Sri Lanka Bonos internacionales del Estado de Sri Lanka Bonos internacionales del Estado de Sri Lanka					0,00

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (cont			·			•
Supranacional	•					
•	African Export-Import Bank	USD	2,634 %	17/05/2026	260.796	0,04
480.000	African Export-Import Bank	USD	3,798 %	17/05/2031	487.771	0,07
200.000	African Export-Import Bank 144A <sup>(e)</sup>	USD	2,634 %	17/05/2026	200.612	0,03
710.000	ATP Tower Holdings LLC Via Andean Tower Partners Colombia SAS Via					
	Andean Telecom Partners	USD	4,050 %	27/04/2026	703.404	0,11
	Eastern & Southern African Trade & Development Bank	USD	5,375 %	14/03/2022	1.044.514	0,16
	Eastern & Southern African Trade & Development Bank	USD	4,875 %	23/05/2024	3.104.213	0,47
660.000	Promigas S.A. ESP Via Gases del Pacifico SAC	USD _	3,750 %	16/10/2029	6.445.714	0,10
Tavilliatés					0.443.714	0,90
Tayikistán 220.000	Bonos internacionales de Tayikistán	USD	7,125 %	14/09/2027	193.540	0,03
Tailandia						
650.000	GC Treasury Center Co., Ltd.	USD	2,980 %	18/03/2031	664.032	0,10
	GC Treasury Center Co., Ltd.	USD	4,300 %	18/03/2051	362.216	0,06
	Krung Thai Bank PCL <sup>(c)</sup>	USD	4,400 %	Perp.	250.000	0,04
	Minor International PCL <sup>(c)</sup>	USD	2,700 %	Perp.	538.129	0,08
	PTT Treasury Center Co., Ltd.	USD	3,700 %	16/07/2070	1.209.511	0,18
	PTTEP Treasury Center Co., Ltd.	USD	2,587 %	10/06/2027	524.316	0,08
	PTTEP Treasury Center Co., Ltd.	USD	2,993 %	15/01/2030	441.100	0,07
	Bonos del Estado de Tailandia	THB	3,850 %	12/12/2025	241.333	0,04
	Bonos del Estado de Tailandia	THB	1,250 %	12/03/2028	6.122.450	0,93
	Bonos del Estado de Tailandia	THB	3,775 %	25/06/2032	6.540.496	0,99
	Bonos del Estado de Tailandia	THB	1,600 %	17/06/2035	30.379	0,00
	Bonos del Estado de Tailandia	THB	1,585 %	17/12/2035 17/06/2036	1.475.812	0,22
	Bonos del Estado de Tailandia Bonos del Estado de Tailandia	THB	3,400 %		991.914	0,15
	Bonos del Estado de Tailandia	THB THB	3,300 %	17/06/2038 17/06/2067	5.029.425 206.455	0,76
		USD	3,600 % 4,625 %	20/11/2028	253.696	0,03 0,04
230.000	Thaioil Treasury Center Co., Ltd.	- 030	4,025 %	20/11/2026	24.881.264	3,77
Trinidad y Toba	200				24.001.204	3,77
-	Bonos internacionales del Estado de Trinidad y Tobago	USD	4,500 %	26/06/2030	303.980	0,05
Túnez 180.000	Bonos internacionales del Banco Central de Túnez	EUR	6,375 %	15/07/2026	155.146	0,02
Turquía						
	Akbank TAS	USD	6,800 %	06/02/2026	240.000	0,04
	Akbank TAS <sup>(c)</sup>	USD	6,797 %	27/04/2028	874.425	0,13
	Akbank TAS <sup>(c)</sup>	USD	6,800 %	22/06/2031	531.525	0,08
	Anadolu Efes Biracilik ve Malt Sanayii AS	USD	3,375 %	29/06/2028	1.792.700	0,27
	Coca-Cola Icecek AS	USD	4,215 %	19/09/2024	2.067.799	0,32
	Limak Iskenderun Uluslararasi Liman Isletmeciligi AS	USD	9,500 %	10/07/2036	518.349	0,08
	Mersin Uluslararasi Liman Isletmeciligi AS	USD	5,375 %	15/11/2024	1.333.416	0,20
	TC Ziraat Bankasi AS	USD	5,125 %	03/05/2022	200.962	0,03
	Bonos del Estado de Turquía	TRY	12,200 %	18/01/2023	2.440.998	0,37
	Bonos del Estado de Turquía	TRY	10,600 %	11/02/2026	346.992	0,05
	Bonos del Estado de Turquía	TRY TRY	11,000 % 11,700 %	24/02/2027 13/11/2030	829.578 376.576	0,13 0,06
	Bonos del Estado de Turquía		•			
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	4,875 %	09/10/2026	1.524.691	0,23
	Bonos internacionales del Estado de Turquía Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD USD	6,125 % 5,250 %	24/10/2028 13/03/2030	1.256.300 625.629	0,19 0,09
	·					
	Bonos internacionales del Estado de Turquía Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD USD	5,950 % 5,875 %	15/01/2031 26/06/2031	362.500 441.000	0,05 0,07
	Bonos internacionales del Estado de Turquía  Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	5,875 % 6 500 %	20/09/2033	322.437	0,07
	Bonos internacionales del Estado de Turquía  Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	6,500 % 6,750 %	30/05/2040	262.099	0,05
	Bonos internacionales del Estado de Turquía  Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	6,000 %	14/01/2041	566.433	0,04
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	6,625 %	17/02/2045	342.516	0,09
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	5,750 %	11/05/2047	161.051	0,03
	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO	USD	5,250 %	05/02/2025	2.601.857	0,02
	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO  Turkiye Vakiflar Bankasi TAO	USD	6,500 %	08/01/2026	243.125	0,04
	Yapi ve Kredi Bankasi AS	USD	7,875 %	22/01/2031	2.098.050	0,04
	Yapi ve Kredi Bankasi AS <sup>(c)</sup>	USD	13,875 %	Perp.	2.442.000	0,37
		_			24.803.008	3,76
Ucrania						
520.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	8,994 %	01/02/2024	535.080	0,08
1.730.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD USD	7,750 % 9,750 %	01/09/2024 01/11/2028	1.733.706 215.200	0,26 0,03

Tananaiaa	Descripción del velo	Diviso	Tino do interác(a)	Eacha da vanaimianta(b)	Valor de mercado en USD	% del	
	Descripción del valor	Divisa Tipo de interés <sup>(a)</sup> Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup> US					
Bonos – (conti Ucrania – (conti	·						
•	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	6,876 %	21/05/2029	885.875	0.14	
	Bonos internacionales del Estado de Octania	EUR	4,375 %	27/01/2030	545.759	0,14	
	Bonos internacionales del Estado de Octania	USD	7,253 %	15/03/2033	252.450	0,04	
	Bonos internacionales del Estado de Ociania  Bonos internacionales del Estado de Ucrania <sup>(c)</sup>	USD	0,000 %	31/05/2040	692.179	0,04	
767.000	bollos internacionales del Estado de Ociania.	030_	0,000 %	31/05/2040	4.860,249	0,71	
Emiratos Árabe	es Unidos				4.000.240	0,14	
	Bonos internacionales del Estado del Emirato de Dubái	USD	3,900 %	09/09/2050	518.375	0,08	
1.640.000	National Central Cooling Co., PJSC	USD	2,500 %	21/10/2027	1.613.350	0,24	
2.030.000	NBK Tier 1 Financing 2 Ltd.(c)	USD	4,500 %	Perp.	2.081.684	0,32	
					4.213.409	0,64	
Reino Unido	Fadance Mining Dia	1100	5.000.0/	4.440/0000	000 000	0.04	
	Endeavour Mining Plc.	USD	5,000 %	14/10/2026	238.800	0,04	
	Gazprom PJSC Via Gaz Finance Plc.(c)	USD	4,599 %	Perp.	1.439.962	0,22	
	Vedanta Resources Finance II Plc.	USD	8,000 %	23/04/2023	191.858	0,03	
	Vedanta Resources Finance II Plc.	USD	8,950 %	11/03/2025	599.019	0,09	
	Vedanta Resources Finance II Plc.	USD	9,250 %	23/04/2026	185.000	0,03	
	Vedanta Resources Ltd.	USD	7,125 %	31/05/2023	188.851	0,03	
200.000	Vedanta Resources Ltd.	USD _	6,125 %	09/08/2024	172.634	0,02	
					3.016.124	0,46	
Estados Unidos		Heb	7.405.0/	15/12/2028	266 475	0.04	
	Austin BidCo, Inc.	USD	7,125 %		266.175	0,04	
	Azul Investments LLP	USD	5,875 %	26/10/2024	183.445	0,03	
	Azul Investments LLP	USD	7,250 %	15/06/2026	205.523	0,03	
100.165	Brazil Loan Trust 1	USD	5,477 %	24/07/2023	103.295	0,02	
	Kosmos Energy Ltd.	USD	7,125 %	04/04/2026	592.100	0,09	
	Kosmos Energy Ltd.	USD	7,750 %	01/05/2027	442.388	0,07	
440.000	Kosmos Energy Ltd. 144A <sup>(e)</sup>	USD	7,125 %	04/04/2026	420.200	0,06	
430.000	MercadoLibre, Inc.	USD	2,375 %	14/01/2026	414.950	0,06	
400.000	Resorts World Las Vegas LLC Via RWLV Capital, Inc.	USD	4,625 %	06/04/2031	401.972	0,06	
2.505.000	Sasol Financing USA LLC	USD	5,875 %	27/03/2024	2.595.806	0,39	
970.000	SK Battery America, Inc.	USD	2,125 %	26/01/2026	954.238	0,15	
					6.580.092	1,00	
Uruguay							
	Bonos internacionales del Estado de Uruguay	UYU	8,500 %	15/03/2028	286.919	0,04	
	Bonos internacionales del Estado de Uruguay	UYU	4,375 %	15/12/2028	244.215	0,04	
8.798.531	Bonos internacionales del Estado de Uruguay	UYU _	3,875 %	02/07/2040	225.115	0,03	
					756.249	0,11	
Uzbekistán 320 000	Bonos internacionales de Uzbekistán	USD	4.750 %	20/02/2024	332.400	0,05	
	Bonos internacionales de Uzbekistán	USD	3,700 %	25/11/2030	187.500	0,03	
		-			519.900	0,08	
Venezuela							
	Petroleos de Venezuela S.A.	USD	6,000 %	28/10/2022	435.200	0,06	
	Petroleos de Venezuela S.A.	USD	6,000 %	16/05/2024	122.075	0,02	
	Petroleos de Venezuela S.A.	USD	6,000 %	15/11/2026	192.060	0,02	
	Bonos internacionales del Estado de Venezuela	USD	8,250 %	13/10/2024	8.000	0,00	
		_			757.335	0,11	
					740 400	0,11	
780.000	Viet Nam Debt & Asset Trading Corp.	USD	1,000 %	10/10/2025	713.439	0,11	
780.000 <b>Zambia</b>	<u> </u>		·				
780.000 <b>Zambia</b> 360.000	Bonos internacionales del Estado de Zambia	USD	5,375 %	20/09/2022	268.200	0,04	
780.000 Zambia 360.000 210.000	Bonos internacionales del Estado de Zambia Bonos internacionales del Estado de Zambia	USD USD	5,375 % 8,500 %	20/09/2022 14/04/2024	268.200 160.125	0,04 0,02	
Zambia 360.000 210.000	Bonos internacionales del Estado de Zambia	USD	5,375 %	20/09/2022	268.200 160.125 717.513	0,04 0,02 0,11	
780.000 Zambia 360.000 210.000	Bonos internacionales del Estado de Zambia Bonos internacionales del Estado de Zambia Bonos internacionales del Estado de Zambia	USD USD	5,375 % 8,500 %	20/09/2022 14/04/2024	268.200 160.125	0,04 0,02	

Tenencias	Descripción del valor				Valor de mercado en USD	% del
Acciones ordina	· ·					patimonic
Mongolia						
187.560	Mongolian Mining Corp.				44.270	0,01
TOTAL DE ACCIO (coste USD 44.75	DNES ORDINARIAS 3)				44.270	0,01
Fondos de inver	rsión – 3,58 %					
Irlanda	Coldman Scales LISS Transpury Liquid Bosonyos Fund (Class de assigna	a da diatrih	vuoión VV(f)(g)		23.609.196	2 50
	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones	s de distric	Jucion X)(*/\ear		23.009.190	3,58
(coste USD 23.60	OS DE INVERSIÓN 9.196)				23.609.196	3,58
TOTAL DE VALOR (coste USD 616.1	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE V. 37.969)	ALORES (	OFICIAL		576.149.293	87,32
					Valor de mercado en	% del
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	USD	patrimonio
Valores mobilia Bonos – 6,93 % Bermudas	rios negociados en otro mercado regulado					
80.328	Digicel Group Holdings Ltd. 144A <sup>(e)</sup>	USD	8,000 %	01/04/2025	76.126	0,01
Canadá						
1.270.000	First Quantum Minerals Ltd. 144A <sup>(e)</sup>	USD	7,250 %	01/04/2023	1.286.669	0,19
Islas Caimán						
	NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD USD	2,802 % 0,500 %	01/02/2026 01/02/2027	338.699 404.780	0,05 0,06
	Vnet Group, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	5,674 %	01/02/2027	923.474	0,00
1.170.000	viict Group, iiid. 1447.	-	0,014 70	0 170272020	1.666.953	0,25
Alemania						
129.700.000.000	Bonos del Tesoro de Indonesia—Deutsche Bank AG 144A <sup>(e)</sup>	IDR	7,500 %	19/08/2032	9.680.524	1,47
Guatemala						
150.000	Banco Industrial S.A. Via Guatemala 144A <sup>(c)(e)</sup>	USD	4,875 %	29/01/2031	149.344	0,02
Supranacionales						
200.000	ATP Tower Holdings LLC Via Andean Tower Partners Colombia SAS Via	HOD	4.050.0/	07/04/0000	400.440	0.00
174 071	Andean Telecom Partners 144A <sup>(e)</sup> Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd.	USD	4,050 %	27/04/2026	198.142	0,03
174.971	144A <sup>(e)</sup>	USD	13,000 %	31/12/2025	179.470	0,03
150.773	Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd.		•			•
	144A <sup>(e)</sup>	USD	8,000 %	31/12/2026	147.098	0,02
					524.710	0,08
Reino Unido						
62.225.000	Bonos internacionales del Estado de Egipto—HSBC Bank Plc. 144A <sup>(e)</sup>	EGP	0,000 %	23/12/2021	3.934.335	0,60
	Bonos del Tesoro de Indonesia—Standard Chartered Bank 144A <sup>(e)</sup>	IDR	8,375 %	17/09/2026	3.660.550	0,55
	Bonos del Tesoro de Indonesia—Standard Chartered Bank 144A <sup>(e)</sup>	IDR	9,000 %	20/03/2029	1.183.698	0,18
	Bonos del Tesoro de Indonesia—Standard Chartered Bank 144A <sup>(e)</sup> Bonos del Tesoro de Indonesia—Standard Chartered Bank 144A <sup>(e)</sup>	IDR IDR	8,750 % 7,500 %	19/05/2031	1.780.192 295.566	0,27 0,05
3.900.000.000	Bollos del Tesoro de Indonesia—Standard Chartered Bank 144A	- IDIX	7,500 76	19/08/2032	10.854.341	1,65
Estados Unidos						1,00
	Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(e)</sup>	IDR	8,375 %	15/03/2024	11.978.633	1,81
	Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(e)</sup>	IDR	8,375 %	17/09/2026	4.226.896	0,64
	Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(c)</sup>	IDR	7,500 %	17/06/2035	5.315.357	0,81
					21.520.886	3,26
TOTAL DE BONO (coste USD 44.48					45.759.553	6,93
TOTAL DE VALOR (coste USD 44.48	RES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO (7.173)				45.759.553	6,93
<u> </u>	CADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS					-,
(coste USD 660.6					621.908.846	94,25

Contratos de	futuros –	0,13 %
--------------	-----------	--------

Número de contratos	Descripción del valor		Valor de mercado de la asignación USD	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
	USD				
59	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022	Larga	9.556.156	232.661	0,04
45	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022	Larga	5.897.812	82.312	0,01
60	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022	Larga	13.141.406	37.451	0,01
95	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022	Larga	11.561.055	117.053	0,02
49	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022	Larga	9.787.750	282.894	0,04
28	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022	Larga	4.115.563	85.000	0,01
		•	54.059.742	837.371	0,13
PLUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS			837.371	0,13
Contratos a p	olazo sobre bonos no entregables – 0,00 %				
	COP				
13.218.500.000	Contratos a plazo sobre bonos en COP de BFS Finance 04/01/2022	Larga	12.709	12.709	0,00
PLUSVALÍA L	ATENTE DE CONTRATOS A PLAZO SOBRE BONOS NO ENTREGABLES			12.709	0,00

#### Contratos de divisas a plazo – (0,16 %)

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
BRL	39.136.710	USD	6.981.829	02/12/2021	6.370	0,00
EUR	1.760.878	PLN	8.118.806	06/12/2021	26.819	0,00
USD	10.748.939	INR	803.325.099	07/12/2021	50.775	0,00
USD	421.385	TRY	5.351.552	10/12/2021	14.468	0,00
USD	429.000	ZAR	6.537.231	13/12/2021	19.694	0,00
USD	2.206.000	TRY	20.886.408	14/12/2021	620.808	0,09
CAD	8.281.616	EUR	5.563.203	15/12/2021	153.240	0,03
CHF	16.803.287	EUR	15.679.074	15/12/2021	504.966	0,08
CHF	6.784.082	USD	7.403.181	15/12/2021	6.717	0,00
CNH	155.059.366	USD	23.977.323	15/12/2021	346.757	0,05
EUR	915.673	CAD	1.319.141	15/12/2021	9.213	0,00
EUR	2.772.551	PLN	12.749.271	15/12/2021	53.378	0,00
EUR	2.772.739	SEK	27.981.905	15/12/2021	51.392	0,00
GBP	4.729.547	EUR	5.539.519	15/12/2021	13.762	0,00
ILS	3.324.455	EUR	915.859	15/12/2021	14.801	0,00
JPY	478.647.521	EUR	3.718.482	15/12/2021	18.759	0,00
USD	2.144.339	AUD	2.919.573	15/12/2021	53.067	0,01
USD	15.560.676	CAD	19.693.706	15/12/2021	136.587	0,02
USD	3.074.933	CZK	67.631.876	15/12/2021	63.828	0,00
USD	57.333.997	EUR	49.713.002	15/12/2021	742.846	0,15
USD	13.972.338	GBP	10.194.650	15/12/2021	350.048	0,06
USD	1.047.423	HUF	327.560.695	15/12/2021	28.948	0,00
USD	16.854.404	JPY	1.882.807.755	15/12/2021	129.846	0,02
USD	9.193.122	MXN	187.184.637	15/12/2021	437.462	0,06
USD	5.941.724	NOK	51.505.641	15/12/2021	249.176	0,04
USD	6.541.189	NZD	9.323.071	15/12/2021	166.503	0,02
USD	3.750.679	PLN	14.923.423	15/12/2021	118.782	0,02
USD	6.348.421	SEK	55.023.216	15/12/2021	242.840	0,04
USD	2.134.997	SGD	2.904.130	15/12/2021	5.609	0,00
USD	5.092.380	THB	170.340.630	15/12/2021	37.438	0,01
USD	9.567.803	TRY	87.540.028	15/12/2021	2.926.964	0,45
USD	19.603.719	ZAR	292.935.152	15/12/2021	1.267.923	0,20
USD	699.881	TRY	8.382.870	20/12/2021	65.425	0,01
USD	274.496	ILS	841.055	21/12/2021	6.889	0,00
USD	1.297.136	ILS	4.069.897	22/12/2021	2.094	0,00
ILS	9.358.199	USD	2.954.000	24/12/2021	24.156	0,00
USD	256.201	ILS	790.765	24/12/2021	4.548	0,00
BRL	33.067.985	USD	5.854.502	04/01/2022	8.867	0,00
TWD	82.261.863	USD	2.962.150	19/01/2022	20.730	0,00
USD	1.468.315	ILS	4.525.561	26/01/2022	26.488	0,00
USD	3.663.774	ILS	11.351.702	02/02/2022	46.626	0,01
USD	5.733.076	CLP	4.724.684.894	07/02/2022	119.275	0,02
USD	3.508.062	IDR	50.502.065.867	10/02/2022	5.283	0,00
USD	8.128.939	KRW	9.633.585.927	10/02/2022	10.244	0,00
USD	3.167.668	RUB	237.870.913	10/02/2022	6.769	0,00
USD	1.682.900	TRY	16.353.581	23/02/2022	485.065	0,07

Contratos de divisas a p	lazo – (continuación)
--------------------------	-----------------------

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	latente en USD	% del patrimonio
USD	3.630.315	TRY	35.533.157	06/04/2022	1.089.608	0,17
USD	4.411.000	TRY	42.563.944	14/06/2022	1.488.325	0,23
PLUSVALÍA LATE PLAZO	NTE SOBRE CONTRA	TOS DE DIVISAS A			12.280.178	1,86

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% del patrimonio
USD	6.969.459	BRL	39.136.710	02/12/2021	(18.739)	(0,00)
PLN	1.687.023	EUR	366.800	06/12/2021	(6.601)	(0,00)
INR	811.344.798	USD	10.955.789	07/12/2021	(150.825)	(0,02)
USD	5.798.078	ZAR	92.615.424	09/12/2021	(4.094)	(0,00)
ZAR	108.822.686	USD	6.825.745	09/12/2021	(8.220)	(0,01)
ZAR	33.509.751	USD	2.186.035	13/12/2021	(87.937)	(0,01)
TRY	39.037.350	USD	4.411.000	14/12/2021	(1.448.227)	(0,22)
AUD	2.959.015	NZD	3.102.586	15/12/2021	(1.882)	(0,00)
AUD	8.900.608	USD	6.583.473	15/12/2021	(208.024)	(0,03)
CAD	14.639.236	USD	11.698.430	15/12/2021	(232.995)	(0,04)
CZK	70.071.671	EUR	2.760.554	15/12/2021	(22.766)	(0,00)
CZK	83.945.694	USD	3.812.800	15/12/2021	(75.369)	(0,01)
EUR	2.793.945	AUD	4.505.328	15/12/2021	(46.631)	(0,01)
EUR	1.859.588	CHF	2.012.148	15/12/2021	(80.890)	(0,01)
EUR	1.854.757	CZK	47.611.800	15/12/2021	(8.397)	(0,00)
EUR	920.840	GBP	790.283	15/12/2021	(7.747)	(0,00)
EUR	4.650.164	HUF	1.702.981.865	15/12/2021	(1.485)	(0,00)
EUR	3.711.931	JPY	487.586.866	15/12/2021	(105.622)	(0,01)
EUR	69.045.719	USD	79.158.758	15/12/2021	(560.069)	(0,10)
GBP	5.529.044	USD	7.490.606	15/12/2021	(102.590)	(0,02)
HUF	1.318.766.780	EUR	3.687.764	15/12/2021	(97.589)	(0,01)
HUF	2.680.690.867	USD	8.804.026	15/12/2021	(469.030)	(80,0)
JPY	1.682.542.148	USD	15.166.218	15/12/2021	(220.572)	(0,05)
MXN	628.557.161	USD	31.058.730	15/12/2021	(1.657.645)	(0,25)
NOK	57.029.146	EUR	5.568.517	15/12/2021	(35.940)	(0,00)
NOK	9.805.601	USD	1.135.059	15/12/2021	(51.316)	(0,01)
NZD	6.178.074	USD	4.397.146	15/12/2021	(172.864)	(0,03)
PLN	16.883.617	EUR	3.671.126	15/12/2021	(70.107)	(0,00)
PLN	35.698.003	USD	9.343.082	15/12/2021	(655.302)	(0,10)
RON	32.604.272	USD	7.743.195	15/12/2021	(254.501)	(0,04)
SEK	18.590.840	EUR	1.855.409	15/12/2021	(49.209)	(0,01)
SEK	37.605.963	USD	4.228.241	15/12/2021	(55.344)	(0,01)
SGD	2.874.230	USD	2.131.657	15/12/2021	(24.192)	(0,00)
THB	414.823.192	USD	12.568.083	15/12/2021	(258.002)	(0,03)
TRY	82.911.627	USD	8.533.980	15/12/2021	(2.244.256)	(0,34)
USD	13.621.274	CHF	12.515.971	15/12/2021	(49.267)	(0,00)
USD	45.436.154	CNH	295.002.767	15/12/2021	(840.772)	(0,12)
USD	1.711.491	ILS	5.482.846	15/12/2021	(32.382)	(0,01)
ZAR	227.392.872	USD	15.180.330	15/12/2021	(947.045)	(0,15)
ILS	7.091.754	USD	2.267.673	22/12/2021	(11.076)	(0,00)
INR	102.200.065	USD	1.359.906	27/12/2021	(967)	(0,00)
USD	12.947.420	TWD	358.479.491	19/01/2022	(51.329)	(0,00)
COP	23.745.519.012	USD	6.259.330	21/01/2022	(362.124)	(0,05)
CLP	1.719.214.686	USD	2.130.142	07/02/2022	(87.396)	(0,02)
MYR	108.263.640	USD	25.902.251	09/02/2022	(251.007)	(0,04)
PEN	10.443.275	USD	2.588.172	10/02/2022	(27.421)	(0,00)
RUB	263.201.677	USD	3.642.038	10/02/2022	(144.537)	(0,02)
TRY	16.910.525	USD	1.652.756	23/02/2022	(414.128)	(0,07)
TRY	23.125.498	USD	2.206.000	14/06/2022	(618.076)	(0,09)
MINUSVALÍA I	LATENTE SOBRE CONTR	ATOS DE	DIVISAS A PLAZO		(13.332.506)	(2,02)

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones – (0,94 %)

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalia latente USD	% del patrimonio
EUR	30.512.039	USD	34.485.316	10/02/2022	311.871	0,05
PLUSVALÍA LAT	ENTE SOBRE CONTRA	TOS DE DIVIS	SAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA		311.871	0,05

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase	e de acciones – (continuación)
-------------------------------------------------------	--------------------------------

Divisa	Compra Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% del patrimonio
GBP	162.044.594 USD	223.182.237		21/01/2022	(6.511.799)	(0,99)
MINUSVALÍA LATE	ENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISA	AS A PLAZO CELEBRADOS CON	FINES DE COBERTURA		(6.511.799)	(0,99)
Opciones - 0,02	%					
Tenencias	Descripción del valor			Plusvalía /(minusvalía) latente USD	Valor de mercado en USD	% del
Tenencias	Opciones adquiridas					patimonio
	EUR					
3.668.000	Put EUR / Call PLN	Vence 02/12/2021	Precio de ejercicio 4,56	(9.579)	4	0,00
3.668.000	Put EUR / Call PLN	Vence 02/12/2021	Precio de ejercicio 4,56	(11.077)	4	0,00
29.891.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,12	(52.194)	43.127	0,01
32.630.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,12	(100.452)	33.601	0,00
29.706.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	(17.448)	107.656	0,02
29.651.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,14	53.648	167.950	0,02
				(137.102)	352.342	0,05
	USD					
	Call USD / Put ILS	Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 3,11	143.118	174.049	0,03
	Call USD / Put ILS	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 3,13	87.119	120.412	0,02
	Call USD / Put ILS	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 3,14	81.388	115.068	0,02
	Call USD / Put INR	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 75,26	34.786	80.667	0,01
	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 15,90	18.852	72.769	0,01
12.661.000	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 16,15	(29.462)	61.558	0,01
				335.801	624.523	0,10
TOTAL DE OPCION (coste USD 778.16					976.865	0,15
	Opciones suscritas					
	EUR					
(14.946.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	38.871	(54.165)	(0,01)
,	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	87.136	(54.056)	(0,01)
(14.853.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,14	3.716	(84.131)	(0,01)
, ,			•	129.723	(192.352)	(0,03)
	USD					
(4.225.000)	Call USD / Put ILS	Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 3,06	(104.666)	(139.446)	(0,02)
,	Call USD / Put ILS	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 3,08	(76.806)	(114.578)	(0,02)
	Call USD / Put ILS	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 3,09	(73.647)	(113.020)	(0,02)
, ,	Call USD / Put INR	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 74,72	(30.382)	(73.526)	(0,01)
, ,	Call USD / Put TRY	Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 12,30	(150.600)	(174.285)	(0,02)
, ,	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 15,90	8.190	(71.604)	(0,01)
				(427.911)	(686.459)	(0,10)
TOTAL DE OPCION (coste USD (580.62					(878.811)	(0,13)
TOTAL DE OPCION					98.054	0,02
<u> </u>	mutas financieras – 0,43 %					
Sommatos de per					Plusvalía	
Importe teórico	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	latente	% del

Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
	Permutas de tipos de interés					
76.030.000	Fijo 5,800 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2023	603.882	0,09
22.010.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,400 %	BRL	02/01/2023	32.738	0,01
72.990.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,300 %	BRL	02/01/2024	125.213	0,02
23.450.000	Fijo 8,495 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	04/01/2027	332.728	0,05
54.130.000	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 11,230 %	BRL	04/01/2027	79.745	0,01
21.251.660.000	Fijo 4,300 %	Variable (CLOIS a 6 meses en CLP)	CLP	15/12/2023	416.016	0,06
93.980.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,500 %	CNY	15/09/2023	41.320	0,01
55.106.510.000	Fijo 4,900 %	Variable (LIBOR a 3 meses en COP)	COP	15/12/2023	238.714	0,04
6.256.860.000	Fijo 6,400 %	Variable (LIBOR a 3 meses en COP)	COP	15/12/2031	8.273	0,00
1.898.978.671	Fijo 2,700 %	Variable (PRIBOR a 6 meses en CZK)	CZK	15/12/2023	947.203	0,14
692.600.000	Variable (PRIBOR a 6 meses en CZK)	Fijo 3,600 %	CZK	15/12/2023	150.300	0,02
136.366.273	Fijo 2,200 %	Variable (PRIBOR a 6 meses en CZK)	CZK	15/12/2031	210.685	0,03
47.375.000	Fijo 2,600 %	Variable (PRIBOR a 6 meses en CZK)	CZK	15/12/2031	15.063	0,00

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

#### Contratos de permutas financieras – (continuación)

Importe teórico					latente	% del
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	USD	patrimonio
	Permutas de tipos de interés – (continuación)					
1 420 000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2024	6.965	0,00
	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2025	30.833	0,01
	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2026	74.378	0,01
	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2031	68.306	0,01
680.000	,	Variable (EURIBOR a 6 meses en	LOIX	10/12/2001	00.500	0,01
000.000	Fijo 0,250 %	EUR)	EUR	15/12/2036	5.223	0,00
28 013 099	Variable (TELBOR a 3 meses en ILS)	Fijo 1,300 %	ILS	15/12/2031	219.160	0,03
	Variable (LIBOR a 6 meses en INR)	Fijo 5,500 %	INR	15/09/2026	149.143	0,02
52.621.060.000	,	Variable (LIBOR a 3 meses en KRW)	KRW	16/03/2024	140.357	0,02
	Fijo 6,200 %	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN		156.694	0,02
		,		13/12/2023		
	Fijo 6,700 %	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	09/12/2026	84.556	0,01
	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	Fijo 7,150 %	MXN	03/12/2031	10.903	0,00
	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,250 %	MYR	17/06/2022	9.916	0,00
	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,250 %	MYR	17/06/2022	5.549	0,00
	Variable (LIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,250 %	MYR	17/06/2022	10.279	0,00
25.960.000	Variable (LIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,250 %	MYR	17/06/2022	3.987	0,00
47.630.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,650 %	MYR	27/02/2024	293.854	0,05
32.270.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,693 %	MYR	01/03/2024	206.706	0,03
22.780.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,605 %	MYR	06/03/2024	135.871	0,02
	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,330 %	MYR	31/05/2024	26.242	0,01
	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,250 %	MYR	18/12/2024	38.146	0,01
	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,000 %	MYR	18/03/2025	17.401	0,00
	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,250 %	MYR	15/12/2031	36.989	0,01
	,	•				
1.400.000	Fijo 1,700 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2026	18.653	0,00
PLUSVALÍA LATEI	NTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTERÉS				4.951.991	0,75
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)					
4.650.000	Variable (Bonos internacionales del Estado	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2023	67.591	0,01
	de Filipinas)	,				-,-
460 000	Variable (Bonos internacionales del Estado	Fijo 5,000 %	USD	20/12/2023	17.461	0,00
400.000	de Ucrania)	1 130 0,000 70	OOD	20/12/2020	17.401	0,00
1 100 000	•	Fiie 1 000 0/	USD	20/06/2024	10.000	0.00
1.160.000	Variable (Bonos internacionales	Fijo 1,000 %	บอบ	20/06/2024	10.088	0,00
	del Estado de Catar)					
3.120.000	Variable (Bonos internacionales	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2024	48.562	0,01
	del Estado saudí)					
2.460.000	Variable (Bonos internacionales del	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	36.497	0,01
	del Estado de Abu Dabi)					
1.000.000	Variable (Bonos internacionales del Estado					
	de Filipinas)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	21.913	0,00
2.670.000	Variable (Bonos internacionales	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	20.176	0,00
	del Estado de Catar)	•				
2 230 000	Variable (Bonos internacionales	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	29.928	0,00
2.200.000	del Estado saudí)	. 1,0 1,000 %	002	20, 12,202 :	20.020	0,00
7 200 000	•					
7.360.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Indonesia)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	69.844	0,01
4 210 000	Variable (Bonos extranjeros rusos – Eurobono)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	47.171	0,01
	NTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMIENTO	1 10 1,000 /6	030	20/12/2023	47.171	0,01
CREDITICIO (CDS)					369.231	0,05
TOTAL DE PLUSVA	ALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE				1	
PERMUTAS FINAN	ICIERAS				5.321.222	0,80
					Minusvalía	
Importe teórico					latente	% del
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	USD	patrimonio
	Permutas de tipos de interés					
12.320.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 10,565 %	BRL	02/01/2023	(18.035)	(0,00)
112.710.000	Variable (LIBOR a 1 mes en BRL)	Fijo 7,200 %	BRL	02/01/2023	(763.278)	(0,12)
5.350.000	Fijo 11,814 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(4.011)	(0,00)
	Fijo 11,905 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(4.570)	(0,00)
	Fijo 12,185 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(12.035)	(0,00)
		,				,
	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 9,200 %	BRL	02/01/2024	(179.468)	(0,03)
	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 9,900 %	BRL	04/01/2027	(12.634)	(0,00)
	Variable (LIBOR a 6 meses en CLP)	Fijo 5,100 %	CLP	15/12/2031	(27.442)	(0,01)
	Fijo 2,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	CNY	15/12/2026	(12.317)	(0,00)
	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2023	(5.086)	(0,00)
290.000	Fijo 0,500 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2041	(681)	(0,00)
67.390.000	Variable (HIBOR a 3 meses en HKD)	Fijo 1,500 %	HKD	15/09/2031	(33.915)	(0,01)
10.764.173.320	,	Variable (BUBOR a 6 meses en HUF)	HUF	16/03/2024	(9.392)	(0,00)
1.247.249.495	•	Variable (BUBOR a 6 meses en HUF)	HUF	16/03/2032	(45.883)	(0,01)
	Fijo 0,400 %	Variable (TELBOR a 3 meses en ILS)	ILS	15/12/2023	(10.465)	(0,00)
1.440.020.000	•	Variable (LIBOR a 6 meses en INR)	INR	16/03/2024	(123.695)	(0,02)
1.445.020.000	. 10 .1.00 /0	.aabio (Elbort a o Illosos ell livit)	ANIX	10/03/2024	(120.000)	(0,02)
		Las notas	adjuntas fo	rman parte integrante de	estos estados	financieros.

Plusvalía

#### Contratos de permutas financieras – (continuación)

Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% del patrimonio
	Permutas de tipos de interés – (continuación)					
13.351.530.000		Variable (KWCDC a 3 meses en KRW)	KRW	15/09/2031	(129.146)	(0,02)
5.800.000	Variable (LIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,250 %	MYR	17/06/2025	(23.575)	(0,00)
10.490.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,000 %	MYR	16/06/2026	(74.623)	(0,01)
25.970.000	Variable (LIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,000 %	MYR	16/06/2026	(12.907)	(0,00)
256.330.000	Fijo 0,250 %	Variable (WIBOR a 3 meses en PLN)	PLN	16/12/2021	(117.685)	(0,02)
14.456.910	Fijo 1,750 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2023	(10.917)	(0,00)
27.434.309	Fijo 2,000 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2031	(2.967)	(0,00)
507.460.000	Variable (LIBOR a 6 meses en THB)	Fijo 1,000 %	THB	15/09/2026	(15.694)	(0,00)
196.860.000	Variable (LIBOR a 6 meses en THB)	Fijo 1,000 %	THB	16/03/2027	(19.936)	(0,00)
4.340.000	Fijo 1,750 %	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD	15/12/2031	(47.317)	(0,01)
344.830.086	Fijo 5,500 %	Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	ZAR	15/12/2023	(61.783)	(0,01)
27.854.100	Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	Fijo 7,400 %	ZAR	15/12/2031	(18.685)	(0,00)
MINUSVALÍA LATE INTERÉS	ENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE				(1.798.142)	(0,27)
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)					
1 600 000	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2021	(229)	(0,00)
	Variable (Bonos internacionales del Estado de	1 130 1,000 /0	000	20/12/2021	(223)	(0,00)
200.000	Chile)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2024	(1.276)	(0,00)
3.120.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de	•			, ,	, ,
	Chile)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	(11.841)	(0,00)
5.710.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Colombia)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	(126.502)	(0,02)
1.000.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Argentina)	Fijo 5,000 %	USD	20/12/2025	(359.520)	(0,05)
4.820.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de					
	Chile)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	(43.524)	(0,01)
3.760.000	Variable (iTraxx Asia ex-Japan IG Serie 36 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(2.603)	(0,00)
3.070.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de México)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(34.286)	(0,01)
690.000	Variable (Bonos extranjeros rusos – Eurobono)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(9.992)	(0,00)
4.380.000	Variable (The Markit CDX Emerging Markets 36 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(66.493)	(0,01)
MINUSVALÍA LATE CREDITICIO (CDS)	NTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMIENTO				(656.266)	(0,10)
TOTAL DE MINUSV DE PERMUTAS FIN	/ALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS				(2.454.408)	(0,37)
VALOR DE MERCA	ADO DE LAS INVERSIONES					. , ,
(coste USD 660.82					618.471.538	93,73
OTROS ACTIVOS	YPASIVOS				41.354.732	6,27
PATRIMONIO					659.826.270	100,00
					Valor de mercado en	% del
TOTAL DE INVERS	SIONES				USD	patrimonio
	cluyendo derivados (coste USD 660.625.142) bre contratos de futuros			6	821.908.846 837.371	94,25 0,13
	contratos de lutalos contratos a plazo sobre bonos no entregables				12.709	0,13
	bre contratos de divisas a plazo				12.280.178	1,86
	obre contratos de divisas a plazo			(	13.332.506)	(2,02)
	bre contratos de divisas a plazo celebrados con fine	es de cobertura		,	311.871	0,05
	obre contratos de divisas a plazo celebrados con fi				(6.511.799)	(0,99)
	e opciones compradas (coste USD 778.166)				976.865	0,15
	e opciones suscritas (coste USD (580.623))				(878.811)	(0,13)
Plusvalía latente sol	bre contratos de permutas financieras				5.321.222	0,80
Minusvalía latente s	obre contratos de permutas financieras				(2.454.408)	(0,37)
Otros activos y pasi	vos				41.354.732	6,27
Patrimonio			_		559.826.270	100,00

El Comisionista de futuros fue Morgan Stanley & Co., Inc.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Credit Suisse International, Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Natwest Markets Plc., Standard Chartered Bank, State Street Bank & Trust y UBS AG. Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Barclays Bank Plc., HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc. y UBS AG. Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Bank of America N.A., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, Morgan Stanley, Morgan Stanley & Co. International Plc.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,98 %.

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (d) Este tífulo tiene un cupón escalonado que pasará al segundo tipo en una fecha determinada del futuro.
- (e) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (f) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

y Morgan Stanley & Co. LLC.

(g) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Valores mobilia	arios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial					
Bonos - 81,24	%					
Argentina						
	Bonos internacionales del Estado de Argentina <sup>(c)</sup>	USD	0,500 %	09/07/2030	24.095	0,00
1.221.303	Bonos internacionales del Estado de Argentina <sup>(c)</sup>	USD _	1,125 %	09/07/2035	347.461	0,02
					371.556	0,02
Benín		5115	4.075.0/	10/01/0000	070.070	0.00
	Bonos internacionales del Estado de Benín Bonos internacionales del Estado de Benín	EUR EUR	4,875 % 4,950 %	19/01/2032 22/01/2035	272.373 3.046.561	0,02 0,19
	Bonos internacionales del Estado de Benín	EUR	4,950 % 6,875 %	19/01/2052	122.347	0,19
110.000	Bollos Internacionales del Estado de Bellin		0,010 /0	10/01/2002	3.441.281	0,22
Bermudas					3.441.201	0,22
	Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	USD	2,625 %	15/08/2025	261.885	0,02
300.000	Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	USD	3,250 %	15/08/2030	296.700	0,02
		_			558.585	0,04
Brasil						·
	Banco do Brasil S.A. <sup>(d)</sup>	USD	6,250 %	Perp.	1.491.798	0,10
496.618.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional	BRL	8,791 %	01/01/2022	87.969.101	5,59
17.546.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional	BRL	10,038 %	01/04/2022	3.034.595	0,19
	Brazil Notas do Tesouro Nacional – Serie F	BRL	10,000 %	01/01/2027	17.669.868	1,12
	Brazil Notas do Tesouro Nacional – Serie F	BRL	10,000 %	01/01/2029	15.411.693	0,98
	BRF S.A.	USD	4,875 %	24/01/2030	203.591	0,01
400.000	BRF S.A.	USD _	5,750 %	21/09/2050	377.023	0,02
	with find a second seco				126.157.669	8,01
Islas Vírgenes B	FPC Resources Ltd.	USD	4,375 %	11/09/2027	212.000	0,01
	Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	USD	3,375 %	24/02/2030	261.100	0,02
	Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	USD	3,625 %	30/09/2030	292.175	0,02
	Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	4,875 %	22/11/2026	244.200	0,02
200.000	Kunzhi Ltd.	USD _	6,250 %	17/10/2020	30.000	0,00
					1.039.475	0,07
Camerún						
	Bonos internacionales de Camerún	EUR	5,950 %	07/07/2032	1.491.061	0,09
Islas Caimán	China Aoyuan Group Ltd.	USD	5,880 %	01/03/2027	51.450	0,00
	DP World Salaam <sup>(d)</sup>	USD	6,000 %	Perp.	2.008.510	0,00
	IHS Holding Ltd.	USD	5,625 %	29/11/2026	199.750	0,01
	IHS Holding Ltd.	USD	6,250 %	29/11/2028	199.500	0,01
	KWG Group Holdings Ltd.	USD	6,000 %	14/08/2026	147.000	0,01
	Meituan	USD	2,125 %	28/10/2025	328.625	0,02
360.000	Sunac China Holdings Ltd.	USD	6,650 %	03/08/2024	250.200	0,02
300.000	Zhenro Properties Group Ltd. (d)	USD _	10,250 %	Perp.	249.000	0,02
					3.434.035	0,22
Chile						
	Bonos de la Tesorería de la República en pesos	CLP	4,500 %	01/03/2026	12.026.001	0,76
	Bonos de la Tesorería de la República en pesos	CLP	5,000 %	01/03/2035	18.009.473	1,15
	Bonos de la Tesorería de la República en pesos 144A(e)	CLP	4,000 %	01/03/2023	15.882.025	1,01
	Bonos de la Tesorería de la República en pesos 144A <sup>(e)</sup> Bonos del Banco Central de Chile en UF – Serie a 10 años	CLP CLP	4,700 %	01/09/2030	910.169 2.694.157	0,06
	Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A.	USD	3,000 % 4,250 %	01/03/2022 22/01/2050	2.694.157	0,17 0,01
200.000	oboledad Quimica y Minera de Offic O.A.		4,230 /0	22/01/2000		
China					49.735.913	3,16
China 394.010.000	Agricultural Development Bank of China – Serie 2004	CNY	2,960 %	17/04/2030	60.615.472	3,85
	China Development Bank – Serie 2010	CNY	3,090 %	18/06/2030	53.954.345	3,43
	China Development Bank – Serie 2012	CNY	3,340 %	14/07/2025	54.689.216	3,47
	Bonos del Estado de China	CNY	2,850 %	04/06/2027	43.377.962	2,75
93.540.000	Bonos del Estado de China	CNY	3,280 %	03/12/2027	15.092.573	0,96
		_			227.729.568	14,46
Colombia						
	Banco de Bogota S.A.	USD	6,250 %	12/05/2026	1.633.125	0,10
13.044.000.000	Bonos internacionales del Estado de Colombia	COP	4,375 %	21/03/2023	3.245.222	0,21

Bonos   Constitutación   Colombia - Icomationate del Estado de Colombia   USD   5,000 %   1506/2015   182,456   200,000   182 de Colombia - Serie B   COP   7,500 %   2006/2026   5,358,716   420,300.000   TES de Colombia - Serie B   COP   7,500 %   2006/2026   5,358,716   420,300.000   TES de Colombia - Serie B   COP   6,000 %   2004/2026   10,300,2026   2004/2026   10,300,2026   2004/2026   10,300,2026   2004/2026   10,300,2026   2004/2026   10,300,2026   2004/2026   10,300,2026   2004/2026   10,300,2026   2004/2026   10,300,2026   2004/2026   10,300,2026   2004/2026   10,300,2026   2004/2026   10,300,2026   2004/2026   10,300,2026   2004/2026   10,300,2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/2026   2004/202				Tipo de	(6)	Valor de mercado en	% de
Colombia   Continuación   Continuación   Colombia   C	Tenencias	Descripción del valor	Divisa	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	USD	patrimonio
200.000   Bornes intermacionales del Estatol de Colombia   USD   5,000 %   150800245   145   21,552 (200.0000   TES de Colombia – Serie B   COP   7,500 %   200802038   3,385,718   43,240,0000   TES de Colombia – Serie B   COP   7,500 %   200802038   3,385,718   43,241,000   200,000   TES de Colombia – Serie B   COP   6,000 %   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,000   200,0	•	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					
Section   Company   Comp	•	•	HED	5 000 %	15/06/2045	182 456	0,01
21,552,000.000   TES de Colombia - Serie B							0,00
44.203.00.00 TES de Calomiba - Serie B							0,34
46.381 200.000 TES de Colombia — Serie B COP 6,000 % 2004-2028 0.039,0029 2.39,000,000 TES de Colombia — Serie B COP 7,000 % 2010-200 5.572,775 2.39,000,000 TES de Colombia — Serie B COP 7,250 % 2010-200 5.572,775 2.39,000,000 TES de Colombia — Serie B COP 7,250 % 2010-200 5.572,775 2.39,000,000 TES de Colombia — Serie B COP 7,250 % 2010-200 5.572,775 2.39,000,000 TES de Colombia — Serie 100 C2K 0,250 % 11002-2027 16.823.498 2.41,000,000 Bonce del Estado de la República Checa — Serie 100 C2K 0,250 % 11002-2027 16.823.498 2.40,000,000 Bonce del Estado de la República Checa — Serie 120 C2K 1,200 % 11002-2027 16.823.498 2.40,000 Bonce del Estado de la República Checa — Serie 120 C2K 1,200 % 11002-2027 16.824.31 17.40,000 Bonce del Estado de la República Checa — Serie 120 C2K 1,200 % 1002-2021 17.40,000 Bonce del Estado de la República Checa — Serie 120 C2K 1,200 % 1002-2021 17.40,000 Bonce del Estado de la República Checa — Serie 120 C2K 1,200 % 1002-2021 17.40,000 Bonce del Estado de la República Checa — Serie 120 C2K 1,200 % 1002-2021 17.40,000 Bonce del Estado de la República Checa — Serie 120 C2K 1,200 % 1002-2021 17.40,000 Bonce del Estado de Est							0,63
28.003.000.000   TES de Colombia - Serie B   CoP   7.250 %   2610.0006   5.972.775			COP				0,66
República Checa	18.206.300.000	TES de Colombia – Serie B	COP	7,000 %	30/06/2032	4.066.367	0,26
Republic Checa	28.903.000.000	TES de Colombia – Serie B	COP	7,250 %	26/10/2050	5.972.775	0,38
421,00.000 Bonos del Estado de la República Checa – Serie 100 CZK 0.260 % 110022027 16.823.498 120.808.000 Bonos del Estado de la República Checa – Serie 120 CZK 1.260 % 14022025 22.564.342 52.860.000 Bonos del Estado de la República Checa – Serie 120 CZK 1.200 % 14022033 13.15.094 53.700.000 Bonos del Estado de la República Checa – Serie 125 CZK 1.200 % 24.004/2040 1997.111 117.430.000 Bonos del Estado de la República Checa – Serie 126 CZK 1.200 % 24.004/2040 1997.111 117.430.000 Bonos del Estado de la República Checa – Serie 126 CZK 1.200 % 24.004/2040 1997.111 117.430.000 Bonos del Estado de la República Checa – Serie 49 CZK 4.200 % 24.004/2040 1997.111 117.430.000 Bonos internacionales del Estado de Estado de Estado de Serie 49 CZK 4.200 % 24.004/2030 60.759.902 117.4050 190.325 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 117.4050 1			_			40.774.375	2,59
240.08.000 Bonos del Estado de la Regolubica Checa – Serie 103 CZK 2,000 % 13/10/2033 10 12:0 914 528.860.000 Bonos del Estado de la Regolubica Checa – Serie 121 CZK 1,200 % 13/03/2031 3175.094 117 117 117 117 117 117 117 117 117 11	República Checa	1					
\$28.86.000 Brons del Estado de la República Checa – Serie 120 CZK 1.260 % 130.2031 3.175.094 53.700.000 Brons del Estado de la República Checa – Serie 125 CZK 1.200 % 130.2031 3.175.094 53.700.000 Brons del Estado de la República Checa – Serie 125 CZK 1.200 % 24.04/2040 1.997.111 17.430.000 Brons del Estado de la República Checa – Serie 125 CZK 1.200 % 24.04/2040 1.997.111 17.430.000 Brons del Estado de la República Checa – Serie 125 CZK 1.200 % 24.04/2030 6.278.43	421.500.000	Bonos del Estado de la República Checa – Serie 100	CZK	0,250 %	10/02/2027	16.623.498	1,06
Tysical Denois Denois del Estato de la República Checa - Serie 121   CZK   1,200 %   1303/3203   3,175,094   117,430,000   Bonos del Estato de la República Checa - Serie 125   CZK   4,200 %   04/12/2036   6,278,943	240.080.000	Bonos del Estado de la República Checa – Serie 103		2,000 %	13/10/2033	10.120.914	0,64
STROUGHO   Brones del Estado de la Republica Checa - Serie 125   CZK   4,200 %   A4/12/2036   6,276 943		•					1,43
117.430.000   Bonos del Estado de la República Checa - Serie 49   CZK   4.200 %   0.41722036   6.278.943   6.0759.902   CZE		•					0,20
Ecuador   230,000   Bonos internacionales del Estado de Ecuador       USD   5,000 %   31,077,2030   190,325		•					0,13
Ecuador	117.430.000	Bonos del Estado de la República Checa – Serie 49	CZK _	4,200 %	04/12/2036	6.278.943	0,40
Septo						60.759.902	3,86
Egipto   640,000   Bonos internacionales del Estado de Egipto   USD   6,588 %   21/02/2023   602,400   800,000   Bonos internacionales del Estado de Egipto   USD   7,500 %   16/02/2061   71/41.50   75,000 %   16/02/2061   71/41.50   75,000 %   16/02/2061   71/41.50   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,000 %   75,00		Ronos internacionales del Estado de Equador(C)	Hen	5 000 %	31/07/2020	100 325	0,01
Add   Add   Bones internacionales del Estado de Egipto   USD   6.588 %   2011/2026   602 400		Bollos Internacionales del Estado de Ecdadoro	035	3,000 /6	31/0//2030	190.323	0,01
Second   S		Bonos internacionales del Estado de Egipto	USD	6,588 %	21/02/2028	602.400	0,04
Hong Kong	860.000	Bonos internacionales del Estado de Egipto	USD	8,150 %	20/11/2059	696.600	0,04
Hong Kong   280.00   CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	920.000	Bonos internacionales del Estado de Egipto	USD	7,500 %	16/02/2061	714.150	0,05
## 14			-			2.013.150	0,13
Hungria   7.764,850,000   Bonos del Estado de Hungría - Serie 26/D	Hong Kong						
7.784.850.000 Bonos del Estado de Hungría – Serie 26/D 2.508.410.000 Bonos del Estado de Hungría – Serie 27/A 3.978.240.000 Bonos del Estado de Hungría – Serie 30/A HUF 3,000 % 27/10/2027 7.302.583 3.978.240.000 Bonos del Estado de Hungría – Serie 30/A HUF 3,000 % 21/08/2030 11.203.183  41.139.847  India  200.000 Adani Ports & Special Economic Zone Ltd. USD 4,200 % 04/08/2027 208.162 200.000 Adani Ports & Special Economic Zone Ltd. USD 4,375 % 03/07/2029 210.626  418.788  Indonesia  400.000 Bank Negara Indonesia Persero Tbk PTI* USD 4,300 % Perp. 400.500 200.000 Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT USD 3,541 % 27/04/2032 319.400 200.000 Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT USD 4,745 % 09/06/2051 203.500 200.000 Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT USD 4,745 % 09/06/2051 203.500 200.000 Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT USD 4,805 % 27/04/2052 326.400 11.000.000 Bonos del Tesoro de Indonesia – Serie FR64 IDR 6,125 % 15/05/2028 784 107.345.000.000 Bonos del Tesoro de Indonesia – Serie FR70 IDR 8,375 % 15/03/2024 8.203.114  87.375.000 Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 1112 ILS (0,100 %) 02/11/2022 27.781.944 27.150.000 Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 912 ILS (0,500 %) 07/09/2022 16.669.167 710.000 Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 912 ILS (0,500 %) 07/09/2022 16.669.167 710.000 Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 912 ILS (0,500 %) 07/09/2022 16.669.167 710.000 Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 912 ILS (0,500 %) 07/09/2022 16.669.167 710.000 Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 912 ILS (0,500 %) 07/09/2022 16.669.167 710.000 Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 912 ILS (0,500 %) 07/09/2022 16.669.167 710.000 Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 912 ILS (0,500 %) 07/09/2022 16.669.167 710.000 Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 912 ILS (0,500 %) 07/09/2022 16.669.167 710.000 Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 912 ILS (0,500 %) 07/09/2022 16.669.167 710.000 Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 912 ILS (0,500 %) 07/09/2022 16.669.167 710.000 Lev	280.000	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	USD	5,125 %	14/03/2028	320.268	0,02
2.508.410.000   Bonos del Estado de Hungría - Serie 27/A   HUF   3,000 %   27/10/2027   7,302.583   21/03/2030   11,203.183   21/03/2030   11,203.183   21/03/2030   11,203.183   21/03/2030   11,203.183   21/03/2030   11,203.183   21/03/2030   11,203.183   21/03/2030   11,203.183   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2030   21/03/2	-						
August   Superior		•					1,44
India   200.000   Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.		•					0,46
India	3.978.240.000	Bonos del Estado de Hungria – Serie 30/A	HUF -	3,000 %	21/08/2030		0,71
200.000   Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.   USD   4,200 %   04/08/2027   208.162   200.000   Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.   USD   4,375 %   03/07/2029   210.626     418.788						41.139.847	2,61
Adam   Ports & Special Economic Zone Ltd.   USD		Adani Ports & Special Economic Zone I td	USD	4 200 %	04/08/2027	208 162	0,01
March   Marc		·					0,02
Name			_	,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,			0,03
A00.000   Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT(d)   USD   4,300 %   Perp.   400.500   320.000   Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT   USD   3,541 %   27/04/2032   319.400   320.000   Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT   USD   4,745 %   09/06/2051   203.500   320.000   Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT   USD   4,805 %   27/04/2052   326.400   11,000,000   Bonos del Tesoro de Indonesia – Serie FR64   IDR   6,125 %   15/05/2028   764   107.345,000,000   Bonos del Tesoro de Indonesia – Serie FR70   IDR   8,375 %   15/03/2024   8.203.114   9.453.698	Indonesia						-,,,,
320,000   Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT		Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT(d)	USD	4,300 %	Perp.	400.500	0,03
320,000   Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT		•	USD		·	319.400	0,02
11.000.000   Bonos del Tesoro de Indonesia - Serie FR64   IDR   6,125 %   15/05/2028   784   107.345.000.000   Bonos del Tesoro de Indonesia - Serie FR70   IDR   8,375 %   15/03/2024   8.203.114   9.453.698	200.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	USD	4,745 %	09/06/2051	203.500	0,01
107.345.000.00   Bonos del Tesoro de Indonesia – Serie FR70   IDR   8,375 %   15/03/2024   8.203.114   9.453.698	320.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	USD	4,805 %	27/04/2052	326.400	0,02
Strael   S	11.000.000	Bonos del Tesoro de Indonesia – Serie FR64	IDR	6,125 %	15/05/2028	784	0,00
Strate    87.375.000   Letras del Banco de Israel - Makam - Serie 1112   ILS (0,100 %) 02/11/2022 27.781.944     27.150.000   Letras del Banco de Israel - Makam - Serie 212   ILS (0,260 %) 02/02/2022 8.633.104     52.425.000   Letras del Banco de Israel - Makam - Serie 912   ILS (0,500 %) 07/09/2022 16.669.167     710.000   Leviathan Bond Ltd. 144A(e)   USD 5,750 % 30/06/2023 727.999     370.000   Leviathan Bond Ltd. 144A(e)   USD 6,750 % 30/06/2030 389.640	107.345.000.000	Bonos del Tesoro de Indonesia – Serie FR70	IDR _	8,375 %	15/03/2024	8.203.114	0,52
87.375.000 Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 1112 ILS (0,100 %) 02/11/2022 27.781.944 27.150.000 Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 212 ILS (0,260 %) 02/02/2022 8.633.104 52.425.000 Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 912 ILS (0,500 %) 07/09/2022 16.669.167 710.000 Leviathan Bond Ltd. 144A(e) USD 5,750 % 30/06/2023 727.999 370.000 Leviathan Bond Ltd. 144A(e) USD 6,750 % 30/06/2030 389.640  Costa de Marfil 4.400.000 Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil EUR 5,250 % 22/03/2030 5.026.819  Japón 290.000 SoftBank Group Corp. USD 5,125 % 19/09/2027 288.912  Luxemburgo 420.000 Altice Financing S.A. EUR 4,250 % 15/08/2029 460.657						9.453.698	0,60
27.150.000 Letras del Banco de Israel - Makam - Serie 212 ILS (0,260 %) 02/02/2022 8.633.104 52.425.000 Letras del Banco de Israel - Makam - Serie 912 ILS (0,500 %) 07/09/2022 16.669.167 710.000 Leviathan Bond Ltd. 144A(e) USD 5,750 % 30/06/2023 727.999 370.000 Leviathan Bond Ltd. 144A(e) USD 6,750 % 30/06/2030 389.640  Costa de Marfil 4.400.000 Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil EUR 5,250 % 22/03/2030 5.026.819  Japón 290.000 SoftBank Group Corp. USD 5,125 % 19/09/2027 288.912  Luxemburgo 420.000 Altice Financing S.A. EUR 4,250 % 15/08/2029 460.657							
52.425.000   Letras del Banco de Israel - Makam - Serie 912   ILS (0,500 %)   07/09/2022   16.669.167   710.000   Leviathan Bond Ltd. 144A(e)   USD   5,750 %   30/06/2023   727.999   370.000   Leviathan Bond Ltd. 144A(e)   USD   6,750 %   30/06/2030   389.640							1,76
710.000 Leviathan Bond Ltd. 144A <sup>(e)</sup> 370.000 Leviathan Bond Ltd. 144A <sup>(e)</sup> USD 5,750 % 30/06/2023 727.999 370.000 Leviathan Bond Ltd. 144A <sup>(e)</sup> USD 6,750 % 30/06/2030 389.640 54.201.854  Costa de Marfil 4.400.000 Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil EUR 5,250 % 22/03/2030 5.026.819  Japón 290.000 SoftBank Group Corp. USD 5,125 % 19/09/2027 288.912  Luxemburgo 420.000 Altice Financing S.A. EUR 4,250 % 15/08/2029 460.657							0,55
370.000 Leviathan Bond Ltd. 144A <sup>(e)</sup> Bush and a series of the series o							1,06
Second							0,05
Costa de Marfil 4.400.000 Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil  EUR 5,250 % 22/03/2030 5.026.819  Japón 290.000 SoftBank Group Corp.  USD 5,125 % 19/09/2027 288.912  Luxemburgo 420.000 Altice Financing S.A.  EUR 4,250 % 15/08/2029 460.657	370.000	Leviatrian DUNU Ltd. 144A/-7	090	0,730 %	30/06/2030		0,02
4.400.000     Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil     EUR     5,250 %     22/03/2030     5.026.819       Japón       290.000     SoftBank Group Corp.     USD     5,125 %     19/09/2027     288.912       Luxemburgo       420.000     Altice Financing S.A.     EUR     4,250 %     15/08/2029     460.657	04- 4 ** **					54.201.854	3,44
290.000     SoftBank Group Corp.     USD     5,125 %     19/09/2027     288.912       Luxemburgo     420.000     Altice Financing S.A.     EUR     4,250 %     15/08/2029     460.657		Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	EUR	5,250 %	22/03/2030	5.026.819	0,32
Luxemburgo         420.000 Altice Financing S.A.         EUR         4,250 %         15/08/2029         460.657	Japón						
420.000 Altice Financing S.A. EUR 4,250 % 15/08/2029 460.657		SoftBank Group Corp.	USD	5,125 %	19/09/2027	288.912	0,02
	•						_
Malasia		Altice Financing S.A.	EUR	4,250 %	15/08/2029	460.657	0,03
790.000 Genm Capital Labuan Ltd. USD 3,882 % 19/04/2031 781.468		Genm Capital Labuan Ltd.	USD	3.882 %	19/04/2031	781.468	0,05

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de
Bonos – (contir	•	Divisu	meres	T cond de venemiento		patimon
Bonos – (contil Mauricio	iuacioni					
	India Green Power Holdings	USD	4,000 %	22/02/2027	331.650	0,0
	MTN Mauritius Investments Ltd.	USD	4,755 %	11/11/2024	1.486.786	0,1
		_	,		1.818.436	0,1
México						
	Banco Mercantil del Norte S.A.(d)	USD	5,875 %	Perp.	216.121	0,0
	Banco Mercantil del Norte S.A. <sup>(d)</sup>	USD	6,750 %	Perp.	910.228	0,0
	Banco Mercantil del Norte S.A.(d)	USD	7,625 %	Perp.	753.483	0,0
830.000	Banco Santander Mexico S.A. Institucion de Banca Multiple Grupo					
	Financiero Santander	USD	5,375 %	17/04/2025	905.737	0,0
	BBVA Bancomer S.A. (d)	USD	5,125 %	18/01/2033	499.065	0,0
	Cemex SAB de CV	USD	5,200 %	17/09/2030	684.986	0,0
	Bonos mexicanos – Serie M	MXN	5,750 %	05/03/2026	4.212.954	0,2
	Bonos mexicanos – Serie M	MXN	7,750 %	29/05/2031	4.515.756	0,2
	Bonos mexicanos – Serie M	MXN	7,750 %	23/11/2034	2.656.438	0,1
	Bonos mexicanos – Serie M	MXN	8,000 %	07/11/2047	7.044.822	0,4
	Bonos mexicanos – Serie M 20	MXN	8,500 %	31/05/2029	29.251.457	1,8
	Bonos mexicanos – Serie M 30	MXN	10,000 %	20/11/2036	12.213.761	0,7
	Bonos mexicanos – Serie M 30	MXN USD	8,500 %	18/11/2038 30/04/2028	15.339.287	0,9
	Mexico City Airport Trust	USD	3,875 %		2.796.466 1.151.563	0,1 0,0
	Mexico City Airport Trust  Bonos internacionales del Estado de México	EUR	5,500 % 2,250 %	31/10/2046		
	Petroleos Mexicanos	USD		12/08/2036 23/01/2027	400.744 390.222	0,0 0,0
	Petroleos Mexicanos	USD	6,490 % 6,500 %	13/03/2027	492.605	0,0
400.000	r eli dieds iviexicalios		0,300 /6	13/03/2021	84.435.695	5,3
Marruecos					04.400.000	0,0
	OCP S.A. 144A <sup>(e)</sup>	USD	3,750 %	23/06/2031	261.225	0,0
Países Bajos						
	Bharti Airtel International Netherlands BV	USD	5,125 %	11/03/2023	208.745	0,0
	Greenko Dutch BV	USD	3,850 %	29/03/2026	208.919	0,0
	Lukoil International Finance BV	USD	4,750 %	02/11/2026	575.437	0,0
	Lukoil Securities BV	USD	3,875 %	06/05/2030	461.587	0,0
	Metinvest BV	USD	8,500 %	23/04/2026	322.395	0,0
	Minejesa Capital BV	USD	4,625 %	10/08/2030	360.062	0,0
	Prosus NV	USD	3,680 %	21/01/2030	1.122.509	0,0
200.000	Prosus NV	USD _	4,027 %	03/08/2050	187.000	0,0
Nigeria					3.446.654	0,2
-	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	6,125 %	28/09/2028	3.823.982	0,2
Omán						
200.000	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	6,250 %	25/01/2031	209.750	0,0
470.000	Oman Sovereign Sukuk Co.	USD	4,875 %	15/06/2030	495.262	0,0
					705.012	0,0
Pakistán	Denne interne eigenber del Fatada da Delistán	LIOD	0.000.0/	00/04/0000	004.400	0.0
Panamá	Bonos internacionales del Estado de Pakistán	USD	6,000 %	08/04/2026	881.100	0,0
	Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.	USD	4,000 %	11/08/2041	395.752	0,0
860.000	Banco Latinoamericano de Comercio Exterior S.A.	USD _	2,375 %	14/09/2025	871.034	0,0
					1.266.786	0,0
Perú 22 150 000	Ronos del Estado de Parú	PEN	5 040 0/	12/02/2020	5 602 660	0,3
	Bonos del Estado de Perú		5,940 % 6.150 %	12/02/2029	5.602.669	
	Bonos del Estado de Perú Bonos del Estado de Perú	PEN PEN	6,150 % 5,400 %	12/08/2032 12/08/2034	2.613.282 11.512.017	0,1 0,7
	Bonos del Estado de Perú	PEN	5,400 % 5,350 %	12/08/2040	3.315.863	0,7
	Bonos internacionales del Estado de Perú	PEN	6,950 %	12/08/2031	1.314.612	0,2
	Bonos internacionales del Estado de Perú	PEN	6,850 %	12/02/2042	1.576.109	0,0
		_			25.934.552	1,6
Filipinas						
200.000	International Container Terminal Services, Inc.	USD	4,750 %	17/06/2030	219.482	0,0
	Bonos del Estado de Filipinas – Serie 1063 Bonos del Estado de Filipinas – Serie 1064	PHP PHP	6,250 % 6,875 %	22/03/2028 10/01/2029	788.709 1.737.687	0,0 0,1

Bonos - Continuación   Pripars - Continuación   Pripars - Continuación   10 00 00 00 Broso internacionales del Estado de Filipinas   Pripars - Continuación   37.99 881   0.0	Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Filiphose - (continuación) 13:000 00 Bross internacionales del Estado de Fisipinas 10:000 00 Bross del Estado de Priorina - Serie 10:00 18:25 00:000 Bross del Estado de Priorina - Serie 10:00 18:25 00:000 Bross del Estado de Priorina - Serie 10:00 18:25 00:000 Bross del Estado de Priorina - Serie 10:00 18:25 00:000 Bross del Estado de Priorina - Serie 10:00 18:25 00:000 Bross del Estado de Priorina - Serie 10:00 18:25 00:000 Bross del Estado de Priorina - Serie 10:00 18:25 00:000 Bross del Estado de Priorina - Serie 10:00 18:25 00:000 Bross del Estado de Priorina - Serie 10:00 19:25 00:000 Bross del Estado de Priorina - Serie 10:00 19:25 00:000 Bross del Estado de Priorina - Serie 10:00 19:25 00:000 Bross del Estado de Priorina - Serie 10:00 19:25 00:000 Bross del Estado de Rumania - Serie 13:000 Bross del Estado de Rumania - Serie 13		•	Divisa	interes.	recha de vencimiento.	030	patrillonio
1.00,0000 Bonos internacionales del Estado de Flipinas   PHP   3,000 %   28/11/2022   1905-15   0.0	•	·					
Polonia		•	PHP	3,900 %	26/11/2022	199.515	0,01
Policy   1,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,000   2,000,0	35.000.000	Bonos internacionales del Estado de Filipinas	PHP	6,250 %	14/01/2036	794.488	0,05
4 3075 000 Bonos del Estado de Polonia — Sene 1230 P.N. 0.750 % 25/04/2023 8 0072 085 0.0 18/95 0000 Bonos del Estado de Polonia — Sene 425 P.N. 0.750 % 25/04/2024 18.009.888 2 1, 90.60000 Bonos del Estado de Polonia — Sene 425 P.N. 0.750 % 25/04/2024 18.009.888 2 1, 90.60000 Bonos del Estado de Polonia — Sene 427 P.N. 0.250 % 25/04/2024 18.009.888 2 1, 90.60000 Bonos del Estado de Polonia — Sene 727 P.N. 0.250 % 25/04/2024 18.009.888 2 1, 90.5000 % 25/04/2024 18.009.888 2 1, 90.5000 % 25/04/2024 18.009.888 2 1, 90.5000 % 25/04/2024 18.009.888 2 1, 90.5000 % 25/04/2024 18.009.88 2 1, 90.5000 % 25/04/2024 18.009.89 2 1, 90.5000 % 25/04/2024 18.0000 % 25/04/2024 19.0000 % 25/04/2024 19.0000 % 25/04/2024 19.0000 % 25/04/2024 19.0000 % 25/04/2024 19.0000 % 25/04/2024 25/04/2024 19.0000 % 25/04/2024 25/04/2024 19.0000 % 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/2024 25/04/202			_			3.739.881	0,24
199500000   Bonce del Estado de Potoria - Serie 425   P.N   2,750 %   2204/2025 42,946.996   2,756.10000   Bonce del Estado de Potoria - Serie 428   P.N   2,500 %   2204/2027 22,234.862	Polonia						
Pas   1,000   Bonce del Estado de Polonia – Serie 727   PLN   2,500 %   2507/2027   22,84.632   1,							0,57
Post							2,73
Cater							1,19
Cater	90.030.000	Bollos del Estado de Polonia – Selle 727	PLIN —	2,500 %	25/07/2027		1,45
1.160.000 Clatar Energy 1.050 3,125 % 120772041 1.165,220 0.0 1.050.000 Clatar Energy 1.050 3,300 % 120772051 1.165,220 0.0 1.050.000 Clatar Energy 1.050 3,300 % 120772051 1.165,220 0.0 1.050.000 Clatar Energy 1.050 Clatar Ene	Catar					93.553.575	5,94
Rumain		Qatar Energy	USD	3,125 %	12/07/2041	1.165.220	0,07
Rumania	1.050.000	Qatar Energy	USD	3,300 %	12/07/2051	1.078.219	0,07
S0070.000   Bonos del Estado de Rumania - Serie 15 a   RON   4,156 %   2400/231   10,027,434   0,0			_			2.243.439	0,14
13,710,000   Bonce del Estado de Rumanía — Serie 9 a   RON   4,150 %   2,000 %   14,04/2033   2,957,042   0, 0	Rumanía						
Rusal							0,64
Rusia				,			0,19
Rusia	2.770.000	Bonos internacionales del Estado de Rumania	EUR _	2,000 %	14/04/2033		0,18
437.100.000   Bonos federales de Ruisia - Bonos OFZ - Serie 6221   RUB   7.700 %   23.032033   5.880.297   0.776.900.000   Bonos federales de Ruisia - Bonos OFZ - Serie 6224   RUB   6.900 %   23.045029   96.77.212   0.076.900.000   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900   0.076.900						15.856.596	1,01
776 900 000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6224 RUB 6,900 % 2015/2029 9,677-212 0,0 2,6315-40.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6226 RUB 7,950 % 1004/2030 14,060,403 0,0 1,082,445.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6228 RUB 7,650 % 1004/2030 14,060,403 0,0 275.070.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6230 RUB 7,700 % 1604/2030 14,060,403 0,0 275.070.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6230 RUB 7,700 % 1604/2037 3,304,214 0,0 275.070.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6235 RUB 6,000 % 06/10/2027 3,304,214 0,0 12,51,040.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6235 RUB 5,000 % 1203/2031 14,355,567 0,0 81,045.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6237 RUB 6,700 % 1403/2029 5,158,308 0, 81,045.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6239 RUB 6,800 % 2307/2031 987,559 0,0 81,045.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6239 RUB 6,800 % 2307/2031 987,559 0,0 81,045.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6239 RUB 6,800 % 2307/2031 1,870,939 0,0 82,118,895 5,5 840,000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6239 RUB 6,800 % 3101/2030 11,577,999 0,0 82,118,895 5,5 840,000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6239 RUB 6,800 % 3101/2030 11,577,999 0,0 82,118,895 5,5 840,000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 2030 ZAR 8,000 % 3101/2030 11,577,999 0,0 82,118,895 5,5 841,118,118,118,118,118,118,118,118,118,		Ronce foderales de Rusia, Ronce OE7, Serio 6224	DUD	7 700 %	22/02/2022	5 680 207	0,36
2.531.640.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6226 RUB 7.950 % 07/10/2028 33.480.965 2, 10.82.445.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6228 RUB 7.650 % 10.04/2030 14.060.403 0, 0, 417.320.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6230 RUB 7.700 % 16.032030 54.06.370 0, 275.070.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6232 RUB 6.000 % 06.000 % 12.0322031 14.353.567 0, 12.251.040.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6235 RUB 5.900 % 12.0322031 14.353.567 0, 14.19.565.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6235 RUB 5.900 % 14.03.2023 15.183.308 0, 419.565.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6237 RUB 6.070 % 14.03.2023 15.183.308 0, 14.195.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6239 RUB 5.900 % 14.03.2023 1997.559 0, 15.183.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6239 RUB 5.900 % 14.03.2023 1997.559 0, 15.183.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6239 RUB 5.900 % 14.03.2023 1997.559 0, 15.183.000 Rusia Rusia - Bonos OFZ - Serie 6239 RUB 5.900 % 14.03.2023 1997.559 0, 15.183.000 Rusia Rusia - Bonos OFZ - Serie 6239 RUB 5.900 % 14.03.2023 1997.559 0, 15.183.000 Rusia Rusia - Bonos OFZ - Serie 6239 RUB 5.900 % 14.03.2023 19.18.95 5, 15.183.000 Rusia Rusia - Serie 2030 ZAR 8.200 % 31.001.2030 11.577.999 0, 15.079.000 Rusia Rusia - Serie 2030 ZAR 8.200 % 31.001.2030 11.577.999 0, 15.079.000 Rusia Rusia - Serie 2030 ZAR 8.200 % 31.001.2030 11.577.999 0, 15.079.000 Rusia Rusia - Serie 2030 ZAR 8.200 % 31.001.2030 11.577.999 0, 15.079.000 Rusia Rusia - Serie 2030 ZAR 8.200 % 31.001.2030 11.577.999 0, 15.079.000 Rusia Rusia - Serie 2030 ZAR 8.200 % 31.001.2030 11.577.999 0, 15.079.000 Rusia Rusia - Serie 2030 ZAR 8.200 % 31.001.2030 11.0000 Rusia Rusia - Serie 2030 ZAR 8.200 % 31.001.2030 11.0000 Rusia Rusia Rusia - Serie 2030 ZAR 8.200 % 31.001.2030 11.0000 Rusia Rus				,			0,30
1.082.445.000   Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6220   RUB   7,650 %   10.04/2030   1.4060.403   0.0							2,13
275,070,000   Bonos federales de Ruisi - Bonos OFZ - Serie 0232   RUB   6,000 %   120,30231   14,33,567   0,125,104,000   Bonos federales de Ruisi - Bonos OFZ - Serie 6237   RUB   6,900 %   120,30231   14,33,567   0,141,5500   Bonos federales de Ruisia - Bonos OFZ - Serie 6237   RUB   6,900 %   120,30229   5,158,308   0,230772031   997,559   0,000   23,00772031   997,559   0,000   23,00772031   997,559   0,000   23,00772031   997,559   0,000   23,00772031   997,559   0,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000   23,000							0,89
1.251,040,000   Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6235   RUB   5,900 %   1203/2021   14,335,367   0,419,565,000   Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6239   RUB   6,700 %   14/03/2029   5,158,308   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,500   0,	417.320.000	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6230	RUB	7,700 %	16/03/2039	5.406.370	0,34
Alt   \$4,000   Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6237   RUB   6,700 %   14/03/2029   5,158.308   0,0	275.070.000	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6232	RUB	6,000 %	06/10/2027	3.304.214	0,21
Sanegal	1.251.040.000	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6235	RUB	5,900 %	12/03/2031	14.353.567	0,91
Senegal	419.565.000	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6237	RUB	6,700 %	14/03/2029	5.158.308	0,33
Senegal   1.780.000   Bonos internacionales del Estado de Senegal   EUR   5.375 %   08/06/2037   1.870.939   0.	81.045.000	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ – Serie 6239	RUB _	6,900 %	23/07/2031	997.559	0,06
Sudafrica   204.325.000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie 2030   ZAR   8,000 %   31/01/2030   11,577.989   0,						92.118.895	5,85
Sudafrica   204,325,000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie 2030   ZAR   8,000 %   31/01/2030   11,577,989   07, 421,595,000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie 2032   ZAR   8,250 %   31/03/2032   23,171,638   17, 310,624,000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie 2035   ZAR   8,875 %   28/02/2035   17,082,539   17, 409,910,000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie 2037   ZAR   8,500 %   31/01/2037   21,339,854   17, 210,222,300   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie 2040   ZAR   9,000 %   31/01/2040   11,262,270   07, 134,590,000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie 2044   ZAR   8,750 %   31/01/2044   6,950,042   07, 134,590,000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie 2044   ZAR   8,750 %   28/02/2048   9,927,292   07, 145,590,000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie 2048   ZAR   8,750 %   28/02/2048   9,927,292   07, 145,590,000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie R186   ZAR   10,500 %   21/12/206   30,108,055   17, 178,440,000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie R186   ZAR   10,500 %   21/12/206   30,108,055   17, 178,440,000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie R213   ZAR   7,000 %   28/02/2013   9,188,361   07, 178,440,000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie R213   ZAR   7,000 %   28/02/2013   9,188,361   07, 178,440,000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie R213   ZAR   7,000 %   28/02/2013   9,188,361   07, 178,440,000   ZAR   28/02/2013   9,188,361   07, 178,440,000   ZAR   28/02/2013   9,188,361   07, 178,440,000   ZAR   28/02/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/2013   28/03/201	-	Ronos internacionales del Estado de Senegal	FLID	5 375 %	08/06/2037	1 870 939	0,12
204.325.000 Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2030 ZAR 8,000 % 31/01/2030 11.577.989 0; 421.595.000 Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2032 ZAR 8,250 % 31/03/2032 23.171.638 1, 409.810.000 Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2035 ZAR 8,875 % 28/02/2035 17.082.539 1, 409.810.000 Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2037 ZAR 8,500 % 31/01/2037 21.339.854 1, 210.222.300 Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2040 ZAR 9,000 % 31/01/2037 21.339.854 1, 210.222.300 Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2040 ZAR 9,000 % 31/01/2040 11.262.270 0; 134.590.000 Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2044 ZAR 8,750 % 31/01/2044 6,950.042 0, 192.575.000 Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2048 ZAR 8,750 % 28/02/2048 9.927.292 0, 192.575.000 Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie R166 ZAR 10,500 % 21/12/2026 30.108.055 1, 178.440.000 Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie R186 ZAR 10,500 % 21/12/2026 30.108.055 1, 178.440.000 Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie R186 ZAR 10,500 % 21/12/2026 30.108.055 1, 178.440.000 Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie R186 ZAR 10,500 % 21/12/2026 30.108.055 1, 178.440.000 Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie R186 ZAR 10,500 % 21/12/2026 30.108.055 1, 178.440.000 Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie R186 ZAR 10,500 % 21/12/2026 932.846 0, 14.30.000 African Export-Import Bank USD 2,634 % 17/05/2026 932.846 0, 14.30.000 African Export-Import Bank USD 3,788 % 17/05/2031 1.453.151 0, 200.000 African Export-Import Bank 144A <sup>(e)</sup> USD 2,634 % 17/05/2026 200.612 0, 6.400.000 Eastern & Southern African Trade & Development Bank USD 4,875 % 23/05/2024 6.600.320 0,  70.000 GC Treasury Center Co., Ltd. USD 3,760 % 18/03/2031 551.657 0, 980.000 PTT Treasury Center Co., Ltd. USD 3,700 % 18/03/2031 551.657 0, 980.000 PTT Treasury Center Co., Ltd. USD 3,700 % 18/03/2031 551.657 0, 980.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,850 % 12/12/2025 29.987.414 1, 298.880.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,560 % 17/12/2027 6.993.916 0, 757.397.392 Bonos del Estado de Tailandia THB 1,500 % 17/12/2029 6.2		Bollos internacionales del Estado de Octrogal	LOIK	3,373 70	00/00/2007	1.070.333	0,12
421.595.000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie 2032   ZAR   8,250 %   31/03/2032   23.171.638   1,		Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2030	ZAR	8.000 %	31/01/2030	11.577.989	0,74
310,624,000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie 2035   ZAR   8,875 %   28/02/2035   17,082,539   1, 409,810,000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie 2037   ZAR   8,500 %   31/01/2037   21,333,854   1, 210,222,300   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie 2040   ZAR   9,000 %   31/01/2040   11,262,270   0, 134,590,000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie 2044   ZAR   8,750 %   31/01/2044   6,950,042   0, 192,575,000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie 2048   ZAR   8,750 %   28/02/2048   9,927,292   0, 1, 455,715,000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie R186   ZAR   10,500 %   21/12/2026   30,108,055   1, 178,440,000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie R213   ZAR   7,000 %   28/02/2031   9,188,361   0, 140,608,040   8, 178,440,000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie R213   ZAR   7,000 %   28/02/2031   9,188,361   0, 140,608,040   8, 140,608,040   8, 140,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,040   1, 40,608,0							1,47
409.810.000   Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2037   ZAR   8,500 %   31/01/2037   21.339.854   1,21.222.300   Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2040   ZAR   9,000 %   31/01/2040   11.262.270   0,134.590.000   Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2044   ZAR   8,750 %   31/01/2044   6.950.042   0,192.575.000   Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2048   ZAR   8,750 %   28/02/2048   9.927.292   0,145.715.000   Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie R186   ZAR   10,500 %   21/12/2026   30.108.055   1,178.440.000   Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie R186   ZAR   7,000 %   28/02/2031   9.188.361   0,178.440.000   Sonos del Estado de Sudáfrica – Serie R213   ZAR   7,000 %   28/02/2031   9.188.361   0,178.440.000   Supranacionales   Supranacionales   USD   2,634 %   17/05/2026   932.846   0,143.0000   African Export-Import Bank   USD   3,798 %   17/05/2031   1,453.151   0,145.151   0,145.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.0000   2,045.00000   2,045.00000   2,045.00000   2,045.000							1,08
134.590.000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie 2044   ZAR   8,750 %   31/01/2044   6.950.042   0.01/20575.000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie 2048   ZAR   8,750 %   28/02/2048   9.927.292   0.01/20575.000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie R186   ZAR   10,500 %   21/12/2026   30.108.055   1.1/20575.000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie R213   ZAR   7,000 %   28/02/2031   9.188.361   0.01/20575.000   28/02/2031   9.188.361   0.01/20575.000   28/02/2031   9.188.361   0.01/20575.000   28/02/2031   9.188.361   0.01/20575.000   28/02/2031   9.188.361   0.01/20575.000   28/02/2031   9.188.361   0.01/20575.000   28/02/2031   9.188.361   0.01/20575.000   28/02/2031   9.188.361   0.01/20575.000   28/02/2031   9.188.361   0.01/20575.000   28/02/2031   9.188.361   0.01/20575.000   28/02/2031   9.188.361   0.01/20575.000   28/02/2031   9.188.361   0.01/20575.000   28/02/2031   9.188.361   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.0000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20575.000   0.01/20							1,36
192.575.000   Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2048   ZAR   8,750 %   28/02/2048   9.927.292   0.0	210.222.300	Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2040	ZAR	9,000 %	31/01/2040	11.262.270	0,72
A35.715.000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie R186   ZAR   10,500 %   21/12/2026   30.108.055   13.178.440.000   Bonos del Estado de Sudáfrica - Serie R213   ZAR   7,000 %   28/02/2031   9.188.361   0.9	134.590.000	Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2044	ZAR	8,750 %	31/01/2044	6.950.042	0,44
178.440.000   Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie R213   ZAR   7,000 %   28/02/2031   9.188.361   0.1	192.575.000	Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2048	ZAR	8,750 %	28/02/2048	9.927.292	0,63
Supranacionales	435.715.000	Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie R186	ZAR	10,500 %	21/12/2026	30.108.055	1,91
Supranacionales	178.440.000	Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie R213	ZAR _	7,000 %	28/02/2031	9.188.361	0,58
930.000 African Export-Import Bank 1.430.000 African Export-Import Bank 200.000 African Export-Import Bank 200.000 African Export-Import Bank 200.000 African Export-Import Bank 144A(e) 4.875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2024 6.600.320 0,4875 % 23/05/2026 23/05/2026 23/05/2026 23/05/2026 23/05/2026 23/05/2026 23/05/2026 23/05/2026 23/05/2026 23/05/2026 23/05/2026 0,4875 % 23/05/2026 23/05/2026 23/05/2026 23/05/2026 23/05/2026 0,4875 % 24/05/2026 25/05/2026 24/05/2026 24/05/2027 1,583.696 0,4875 % 24/05/2020 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 80000 8						140.608.040	8,93
1.430.000 African Export-Import Bank 200.000 African Export-Import Bank 144A(e) USD 2,634 % 17/05/2026 200.612 0,6 6.400.000 Eastern & Southern African Trade & Development Bank USD 4,875 % 23/05/2024 6.600.320 0,7 9.186.929 0,7 17/05/2026 200.612 0,6 6.400.000 Eastern & Southern African Trade & Development Bank USD 4,875 % 23/05/2024 6.600.320 0,7 17/05/2026 200.612 0,7 17/05/2026 200.612 0,7 17/05/2026 200.612 0,7 17/05/2026 200.612 0,7 17/05/2026 200.612 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.020 0,7 17/05/2026 200.02	•		1100	0.004.0/	47/05/0000	000 040	0.00
200.000   African Export-Import Bank 144A(e)   USD   2,634 %   17/05/2026   200.612   0,1							0,06
6.400.000 Eastern & Southern African Trade & Development Bank  USD 4,875 % 23/05/2024 6.600.320 0,  9.186.929 0,  Tailandia  200.000 Bangkok Bank PCL <sup>(d)</sup> USD 3,466 % 23/09/2036 201.480 0, 540.000 GC Treasury Center Co., Ltd. USD 2,980 % 18/03/2031 551.657 0, 200.000 GC Treasury Center Co., Ltd. USD 4,300 % 18/03/2051 226.385 0, 980.000 PTT Treasury Center Co., Ltd. USD 3,700 % 16/07/2070 1.013.095 0, 636.580.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,850 % 12/12/2025 20.987.414 1, 298.880.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 2,125 % 17/12/2026 9.272.619 0, 206.270.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,580 % 17/12/2027 6.903.916 0, 757.397.302 Bonos del Estado de Tailandia THB 1,250 % 12/03/2028 22.545.139 1, 2.120.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 1,600 % 17/12/2029 62.626 0,1 46.150.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,650 % 20/06/2031 1.583.696 0, 716.220.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,650 % 20/06/2031 1.583.696 0,							0,09
Tailandia           200.000         Bangkok Bank PCL <sup>(d)</sup> USD         3,466 %         23/09/2036         201.480         0,4           540.000         GC Treasury Center Co., Ltd.         USD         2,980 %         18/03/2031         551.657         0,1           200.000         GC Treasury Center Co., Ltd.         USD         4,300 %         18/03/2051         226.385         0,1           980.000         PTT Treasury Center Co., Ltd.         USD         3,700 %         16/07/2070         1.013.095         0,1           636.580.000         Bonos del Estado de Tailandia         THB         3,850 %         12/12/2025         20.987.414         1,1           298.880.000         Bonos del Estado de Tailandia         THB         2,125 %         17/12/2026         9.272.619         0,4           206.270.000         Bonos del Estado de Tailandia         THB         3,580 %         17/12/2027         6.903.916         0,7           757.397.302         Bonos del Estado de Tailandia         THB         1,250 %         12/03/2028         22.545.139         1,2           2.120.000         Bonos del Estado de Tailandia         THB         3,650 %         20/06/2031         1.583.696         0,7           46.150.000         Bonos del Estado		·					0,01
200.000       Bangkok Bank PCL <sup>(d)</sup> USD       3,466 %       23/09/2036       201.480       0,1         540.000       GC Treasury Center Co., Ltd.       USD       2,980 %       18/03/2031       551.657       0,1         200.000       GC Treasury Center Co., Ltd.       USD       4,300 %       18/03/2051       226.385       0,1         980.000       PTT Treasury Center Co., Ltd.       USD       3,700 %       16/07/2070       1.013.095       0,1         636.580.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       3,850 %       12/12/2025       20,987.414       1,1         298.880.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       2,125 %       17/12/2026       9.272.619       0,3         206.270.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       3,580 %       17/12/2027       6.903.916       0,7         757.397.302       Bonos del Estado de Tailandia       THB       1,250 %       12/03/2028       22.545.139       1,4         2.120.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       1,600 %       17/12/2029       62.626       0,4         46.150.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       3,650 %       20/06/2031       1.583.696       0,4         716.220.000						9.186.929	0,58
540.000       GC Treasury Center Co., Ltd.       USD       2,980 %       18/03/2031       551.657       0,1         200.000       GC Treasury Center Co., Ltd.       USD       4,300 %       18/03/2051       226.385       0,1         980.000       PTT Treasury Center Co., Ltd.       USD       3,700 %       16/07/2070       1.013.095       0,1         636.580.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       3,850 %       12/12/2025       20.987.414       1,2         298.880.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       2,125 %       17/12/2026       9.272.619       0,3         206.270.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       3,580 %       17/12/2026       9.272.619       0,3         757.397.302       Bonos del Estado de Tailandia       THB       1,250 %       12/03/2028       22.545.139       1,4         2.120.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       1,600 %       17/12/2029       62.626       0,4         46.150.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       3,650 %       20/06/2031       1.583.696       0,7         716.220.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       3,775 %       25/06/2032       24.785.367       1,1	Tailandia						
200.000       GC Treasury Center Co., Ltd.       USD       4,300 %       18/03/2051       226.385       0,1         980.000       PTT Treasury Center Co., Ltd.       USD       3,700 %       16/07/2070       1.013.095       0,1         636.580.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       3,850 %       12/12/2025       20.987.414       1,         298.880.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       2,125 %       17/12/2026       9.272.619       0,         206.270.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       3,580 %       17/12/2027       6.903.916       0,         757.397.302       Bonos del Estado de Tailandia       THB       1,250 %       12/03/2028       22.545.139       1,         2.120.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       1,600 %       17/12/2029       62.626       0,         46.150.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       3,650 %       20/06/2031       1.583.696       0,         716.220.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       3,775 %       25/06/2032       24.785.367       1,		3					0,01
980.000 PTT Treasury Center Co., Ltd. USD 3,700 % 16/07/2070 1.013.095 0,1 636.580.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,850 % 12/12/2025 20.987.414 1,2 98.880.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 2,125 % 17/12/2026 9.272.619 0,2 206.270.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,580 % 17/12/2027 6.903.916 0,4 757.397.302 Bonos del Estado de Tailandia THB 1,250 % 12/03/2028 22.545.139 1,2 2.120.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 1,600 % 17/12/2029 62.626 0,4 6.150.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,650 % 20/06/2031 1.583.696 0,4 6.150.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,5 6.200 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,5 6.200 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,5 6.200 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,5 6.200 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,5 6.200 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,5 6.200 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,5 6.200 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,5 6.200 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,5 6.200 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,5 6.200 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,5 6.200 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,5 6.200 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,5 6.200 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,5 6.200 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,5 6.200 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,5 6.200 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,5 6.200 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,5 6.200 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,5 6.200 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,5 6.200 Bonos del Est							0,04
636.580.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,850 % 12/12/2025 20.987.414 1,298.880.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 2,125 % 17/12/2026 9.272.619 0,206.270.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,580 % 17/12/2027 6.903.916 0,275.397.302 Bonos del Estado de Tailandia THB 1,250 % 12/03/2028 22.545.139 1,2120.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 1,600 % 17/12/2029 6.903.916 0,276.500 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,650 % 20/06/2031 1.583.696 0,276.220.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,300.000 Bonos del Estado de Tai		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					0,02
298.880.000     Bonos del Estado de Tailandia     THB     2,125 %     17/12/2026     9,272.619     0,722.619       206.270.000     Bonos del Estado de Tailandia     THB     3,580 %     17/12/2027     6,903.916     0,757.397.309       757.397.302     Bonos del Estado de Tailandia     THB     1,250 %     12/03/2028     22.545.139     1,721.2000       8000     Bonos del Estado de Tailandia     THB     1,600 %     17/12/2029     62.626     0,172.2000       46.150.000     Bonos del Estado de Tailandia     THB     3,650 %     20/06/2031     1.583.696     0,176.220.000       716.220.000     Bonos del Estado de Tailandia     THB     3,775 %     25/06/2032     24.785.367     1,177.2000		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					0,07
206.270.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       3,580 %       17/12/2027       6.903.916       0,7         757.397.302       Bonos del Estado de Tailandia       THB       1,250 %       12/03/2028       22.545.139       1,7         2.120.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       1,600 %       17/12/2029       62.626       0,1         46.150.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       3,650 %       20/06/2031       1.583.696       0,7         716.220.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       3,775 %       25/06/2032       24.785.367       1,4							1,33
757.397.302       Bonos del Estado de Tailandia       THB       1,250 %       12/03/2028       22.545.139       1,4         2.120.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       1,600 %       17/12/2029       62.626       0,1         46.150.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       3,650 %       20/06/2031       1.583.696       0,         716.220.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       3,775 %       25/06/2032       24.785.367       1,							0,59
2.120.000     Bonos del Estado de Tailandia     THB     1,600 %     17/12/2029     62.626     0,0       46.150.000     Bonos del Estado de Tailandia     THB     3,650 %     20/06/2031     1.583.696     0,       716.220.000     Bonos del Estado de Tailandia     THB     3,775 %     25/06/2032     24.785.367     1,							0,44
46.150.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       3,650 %       20/06/2031       1.583.696       0,         716.220.000       Bonos del Estado de Tailandia       THB       3,775 %       25/06/2032       24.785.367       1,							1,43
716.220.000 Bonos del Estado de Tailandia THB 3,775 % 25/06/2032 24.785.367 1,							0,00
							0,10
100.200.000 Boilos del Estado de Taliandia ITB 1,303 % 1//12/2035 4.5/8.1/2 U,							1,57 0,29
	100.200.000	DOINGS GOL ESIAGO GO TAINATIGIA	INB	1,505 70	17/12/2035	4.510.112	0,29

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (contin		DIVIGU	meres	T cond de venemiento		patimonio
Tailandia – (cont	•					
267.190.000	Bonos del Estado de Tailandia	THB	3,400 %	17/06/2036	8.938.605	0,57
648.530.000	Bonos del Estado de Tailandia	THB	3,300 %	17/06/2038	21.238.006	1,35
19.670.000	Bonos del Estado de Tailandia	THB _	3,600 %	17/06/2067	657.115	0,04
					123.545.292	7,85
Turquía						
117.375.000	Bonos del Estado de Turquía	TRY	12,200 %	18/01/2023	8.293.882	0,53
15.460.000	Bonos del Estado de Turquía	TRY	10,600 %	11/02/2026	848.812	0,05
87.290.000	Bonos del Estado de Turquía	TRY	11,000 %	24/02/2027	4.586.060	0,29
	Bonos del Estado de Turquía	TRY	11,700 %	13/11/2030	5.030.582	0,32
	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO	USD	5,250 %	05/02/2025	1.683.554	0,11
2.080.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS(d)	USD _	7,875 %	22/01/2031	2.048.800	0,13
					22.491.690	1,43
Ucrania						
280.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	7,750 %	01/09/2027	278.600	0,02
2.530.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	EUR	4,375 %	27/01/2030	2.465.660	0,15
					2.744.260	0,17
Emiratos Árabes						
440.000	NBK Tier 1 Financing Ltd. (d)	USD	3,625 %	Perp.	435.875	0,03
Reino Unido	Opening DIOON (a. Opening Dis (d)	1100	4 500 0/	D	4.045.005	0.00
	Gazprom PJSC Via Gaz Finance Plc. (d)	USD	4,599 %	Perp.	1.245.925	0,08
	Vedanta Resources Finance II Plc. Vedanta Resources Ltd.	USD USD	8,950 % 6,125 %	11/03/2025 09/08/2024	289.848 457.479	0,02 0,03
550.000	vedanta Resources Ltd.	030 _	0,125 %	09/06/2024		
-					1.993.252	0,13
Estados Unidos	Colombia Citiana Inc	COD	44 000 0/	25/07/2024	1 170 070	0.07
	Colombia—Citigroup, Inc.	COP IDR	11,000 %	25/07/2024 19/08/2030	1.173.872 4.860.244	0,07
	JPMorgan Chase Bank NA Kosmos Energy Ltd.	USD	10,500 % 7,750 %	01/05/2027	282.375	0,31 0,02
	Sasol Financing USA LLC	USD	5,875 %	27/03/2024	1.378.212	0,02
1.000.000	50001aog 507 . 225	_	0,070 70	21700/2024	7.694.703	0,49
					7.094.703	0,49
88 975 000	Bonos internacionales del Estado de Uruguay	UYU	8,500 %	15/03/2028	1.998.324	0,13
	Bonos internacionales del Estado de Uruguay	UYU	4,375 %	15/12/2028	1.606.077	0,10
	Bonos internacionales del Estado de Uruguay	UYU	3,875 %	02/07/2040	1.463.517	0,09
07.200.000	Zonoc momado do Zonaco do Oragaa,		0,0.0 /0	02/01/2010	5.067.918	0,32
Uzbekistán					3.007.910	0,32
	National Bank of Uzbekistan	USD	4,850 %	21/10/2025	396.536	0,02
Venezuela						
74.110.000	Petroleos de Venezuela S.A.	USD	6,000 %	28/10/2022	2.964.400	0,19
20.000	Petroleos de Venezuela S.A.	USD _	6,000 %	15/11/2026	970	0,00
					2.965.370	0,19
Zambia						
TOTAL DE BONG	Bonos internacionales del Estado de Zambia	USD	5,375 %	20/09/2022	193.700	0,01
(coste USD 1.438					1.279.069.538	81,24
Tenencias D	Descripción del valor				Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Fondos de inve	ersión – 2,65 %					
	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase d	le acciones de distribuc	sión X) <sup>(f)(g)</sup>		41.785.351	2,65
TOTAL DE FOND (coste USD 41.78	OOS DE INVERSIÓN 85.351)				41.785.351	2,65
TOTAL DE VALO	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA E 0.568.670)	BOLSA DE VALORES	OFICIAL		1.320.854.889	83,89
,						30,0

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% d
/-1	·	Divisa	interes.	r echa de vencimiento	000	patimon
vaiores mobiliario Bonos – 10,49 % Alemania	os negociados en otro mercado regulado 6					
	Bonos del Tesoro de Indonesia—Deutsche Bank AG 144A <sup>(e)</sup>	IDR	8,375 %	19/03/2024	14.351.342	0,9
73.400.000.000	Bonos del Tesoro de Indonesia—Deutsche Bank AG 144A <sup>(e)</sup>	IDR	8,250 %	19/05/2036	5.744.905	0,3
		_			20.096.247	1,2
Reino Unido						
	Bonos internacionales del Estado de Egipto—HSBC Bank Plc. 144A <sup>(e)</sup>	EGP	0,000 %	23/12/2021	12.449.507	0,7
472.920.000.000	Bonos del Tesoro de Indonesia—Standard Chartered Bank 144A <sup>(e)</sup>	IDR	9,000 %	20/03/2029	38.566.630	2,4
124.000.000.000	Bonos del Tesoro de Indonesia—Standard Chartered Bank 144A <sup>(e)</sup>	IDR	7,500 %	19/08/2032	9.255.089	0,5
		_			60.271.226	3,8
Estados Unidos						
108.401.000.000	Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(e)</sup>	IDR	8,375 %	15/03/2024	8.283.812	0,5
124.530.000.000	Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(e)</sup>	IDR	8,375 %	17/09/2026	9.859.802	0,6
109.298.000.000	Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(e)</sup>	IDR	7,000 %	17/05/2027	8.195.919	0,5
84.680.000.000	Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(e)</sup>	IDR	7,000 %	18/09/2030	6.178.433	0,3
171.863.000.000	Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(e)</sup>	IDR	6,500 %	15/02/2031	12.191.503	0,7
207.584.000.000	Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(e)</sup>	IDR	8,750 %	17/05/2031	16.812.529	1,0
305.892.000.000	Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(d)(e)</sup>	IDR	7,500 %	17/06/2035	22.638.891	1,4
7.763.000.000	Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(e)</sup>	IDR _	8,250 %	19/05/2036	607.598	0,0
					84.768.487	5,3
OTAL DE BONO					165.135.960	10,4
	RES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO					
REGULADO coste USD 161.0	40.471)				165.135.960	10,
ALOR DE MERC	ADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS				1.485.990.849	94,
Contratos de fui	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·				1.400.000.040	
Contratos de lui	turos – (0.03 %)			Compromiso	Plusvalía	
Número de				Valor de mercado en	latente	
ontratos	Descripción del valor			USD	USD	% del patrimon
	USD					
247	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022					
16	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo		Larga	30.058.742	304.338	
	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10		Larga Larga	30.058.742 3.196.000	84.995	
	22/03/2022					0,0
146	22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022		Larga	3.196.000	84.995 443.212 832.545	0,0
146	22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10		Larga	3.196.000 21.459.719	84.995 443.212	0,0
146	22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022		Larga	3.196.000 21.459.719	84.995 443.212 832.545	0,0
146 PLUSVALÍA LATE	22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022  ENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS		Larga	3.196.000 21.459.719 54.714.461 Compromiso Valor de mercado en	84.995 443.212 832.545 832.545 Plusvalía latente	0,0 0,0 0,0
146 PLUSVALÍA LATE	22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022  ENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS  Descripción del valor		Larga	3.196.000 21.459.719 54.714.461 Compromiso	84.995 443.212 832.545 832.545 Plusvalía latente	0,0 0,0 0,0
146 PLUSVALÍA LATE Número de contratos	22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022  ENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS  Descripción del valor USD		Larga Larga	3.196.000 21.459.719 54.714.461 Compromiso Valor de mercado en USD	84.995 443.212 832.545 832.545 Plusvalia latente USD	0,0 0,0 0,0 0,0
146 PLUSVALÍA LATE liúmero de contratos (118)	22/03/2022  Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022  ENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS  Descripción del valor  USD  Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022		Larga Larga Corta	3.196.000 21.459.719 54.714.461 Compromiso Valor de mercado en USD	84.995 443.212 832.545 832.545 Plusvalia latente USD (462.968)	0,0 0,0 0,0 0,0 % del patrimon
146 PLUSVALÍA LATE lúmero de ontratos (118) (370)	22/03/2022  Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022  ENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS  Descripción del valor  USD  Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022  Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022		Larga Larga Corta	3.196.000 21.459.719 54.714.461 Compromiso Valor de mercado en USD (19.112.312) (48.493.125)	84.995 443.212 832.545 832.545 Plusvalia latente USD (462.968) (762.198)	0,0 0,0 0,0 0,0 % del patrimon
146 PLUSVALÍA LATE lúmero de contratos (118) (370)	22/03/2022  Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022  ENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS  Descripción del valor  USD  Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022		Larga Larga Corta	3.196.000 21.459.719 54.714.461 Compromiso Valor de mercado en USD (19.112.312) (48.493.125) (7.884.844)	84.995 443.212 832.545 832.545 Plusvalia latente USD (462.968) (762.198) (23.591)	0,0 0,0 0,0 0,0 % del patrimon (0,0 (0,0
146 PLUSVALÍA LATE  Júmero de contratos (118) (370) (36)	22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022  ENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS  Descripción del valor  USD Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022		Larga Larga Corta	3.196.000 21.459.719 54.714.461 Compromiso Valor de mercado en USD (19.112.312) (48.493.125)	84.995 443.212 832.545 832.545 Plusvalia latente USD (462.968) (762.198) (23.591) (1.248.757)	0,0 0,0 0,0 % del patrimon (0,0 (0,0 (0,0
146 PLUSVALÍA LATE Número de contratos (118) (370) (36) MINUSVALÍA LAT	22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022  ENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS  Descripción del valor USD Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022  ENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS		Larga Larga Corta	3.196.000 21.459.719 54.714.461 Compromiso Valor de mercado en USD (19.112.312) (48.493.125) (7.884.844)	84.995 443.212 832.545 832.545 Plusvalia latente USD (462.968) (762.198) (23.591)	0,0 0,0 0,0 0,0 % del patrimon (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
146 PLUSVALÍA LATE Número de contratos (118) (370) (36) MINUSVALÍA LAT	22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022  ENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS  Descripción del valor  USD Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022		Larga Larga Corta	3.196.000 21.459.719 54.714.461  Compromiso Valor de mercado en USD  (19.112.312) (48.493.125) (7.884.844) (75.490.281)  Compromiso	84.995 443.212 832.545 832.545 Plusvalia latente USD (462.968) (762.198) (23.591) (1.248.757)	0,0 0,0 0,0 0,0 % del patrimon (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
146 PLUSVALÍA LATE  Número de contratos  (118) (370) (36)  MINUSVALÍA LAT  Contratos a plaz  Número de	22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022  ENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS  Descripción del valor USD Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022  ENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS		Larga Larga Corta	3.196.000 21.459.719 54.714.461 Compromiso Valor de mercado en USD (19.112.312) (48.493.125) (7.884.844) (75.490.281)	84.995 443.212 832.545 832.545 Plusvalia latente USD (462.968) (762.198) (23.591) (1.248.757) Plusvalia latente latente	0,0 0,0 0,0 0,0 % del patrimon (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
146 PLUSVALÍA LATE Número de contratos (118) (370) (36) MINUSVALÍA LAT Contratos a plaz Número de contratos	22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022  ENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS  Descripción del valor USD Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022  ENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS  zo sobre bonos no entregables – 0.00 %  Descripción del valor  COP		Larga Larga Corta Corta Corta	3.196.000 21.459.719 54.714.461  Compromiso Valor de mercado en USD  (19.112.312) (48.493.125) (7.884.844) (75.490.281)  Compromiso Valor de mercado en USD	84.995 443.212 832.545 832.545 Plusvalia latente USD (462.968) (762.198) (23.591) (1.248.757) Plusvalia latente USD	0,0 0,0 0,0 % del patrimon (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
LUSVALÍA LATE  Lúmero de ontratos  (118) (370) (36)  MINUSVALÍA LAT  Contratos a plaz  lúmero de ontratos  41.473.500.000	22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022  ENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS  Descripción del valor USD Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022  ENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS zo sobre bonos no entregables – 0.00 %  Descripción del valor		Larga Larga Corta	3.196.000 21.459.719 54.714.461  Compromiso Valor de mercado en USD  (19.112.312) (48.493.125) (7.884.844) (75.490.281)  Compromiso Valor de mercado en	84.995 443.212 832.545 832.545 Plusvalia latente USD (462.968) (762.198) (23.591) (1.248.757) Plusvalia latente latente	0,0 0,0 0,0 % del patrimor (0,0 (0,0 (0,0 (0,0

Contratos de divisas a plazo - (0,76 %)

EUR

2.916.661 GBP

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
EUR	5.545.710	PLN	25.569.368	06/12/2021	84.465	0,00
USD	34.335.322		2.566.045.148	07/12/2021	162.394	0,00
USD	1.330.154		16.892.819	10/12/2021	45.671	0,00
USD	1.359.100		20.710.374	13/12/2021	62.391	0,00
USD	7.127.000		67.478.436	14/12/2021	2.005.667	0,13
CAD	26.689.398		17.928.663	15/12/2021	493.886	0,03
CHF	53.779.735		50.178.489	15/12/2021	1.619.757	0,10
CHF	21.414.666		23.367.923	15/12/2021	22.198	0,00
CNH	536.035.812		82.927.250	15/12/2021	1.160.402	0,06
EUR	2.874.973		4.141.758	15/12/2021	28.926	0,00
EUR	8.866.984		40.773.524	15/12/2021	170.791	0,01
EUR	8.886.403		89.684.126	15/12/2021	164.217	0,02
GBP	15.159.766		17.755.898	15/12/2021	44.222	0,00
ILS	10.470.039		2.884.408	15/12/2021	46.613	0,00
JPY	1.522.191.513		11.831.333	15/12/2021	53.004	0,00
USD	6.902.047		9.397.316	15/12/2021	170.808	0,01
USD	47.210.770		59.756.829	15/12/2021	409.287	0,03
USD	15.544.187		343.073.067	15/12/2021	269.889	0,01
USD	175.010.326		151.811.068	15/12/2021	2.195.109	0.16
USD	44.855.819		32.727.411	15/12/2021	1.124.815	0,07
USD	7.881.331		2.469.331.063	15/12/2021	203.510	0,02
USD	55.023.861		6.144.506.612	15/12/2021	443.585	0,04
USD	18.677.053		382.550.293	15/12/2021	783.066	0,04
USD	20.540.479		178.102.700	15/12/2021	856.068	0,05
USD	20.983.215		29.903.473	15/12/2021	536.600	0,04
USD	20.234.457		80.496.930	15/12/2021	644.015	0,04
USD	20.270.275		175.692.467	15/12/2021	774.786	0,04
USD	6.875.770		9.352.767	15/12/2021	18.064	0,00
USD	40.773.467		370.623.802	15/12/2021	12.657.728	0,81
USD	62.159.279		928.222.245	15/12/2021	4.058.717	0,26
USD	2.209.258		26.461.542	20/12/2021	206.521	0,20
USD	867.861		2.659.126	21/12/2021	21.780	0,00
USD	4.094.345		12.846.425	22/12/2021	6.611	0,00
ILS	29.480.542		9.305.800	24/12/2021	76.095	0,00
USD	807.095		2.491.097	24/12/2021	14.327	0,00
BRL	572.876.847		101.424.649	04/01/2022	153.612	0,00
TWD	120.110.598		4.325.037	19/01/2022	30.268	0,00
USD	11.190.709		43.632.574.391	21/01/2022	354.547	0,02
USD	8.764.006		27.154.073	02/02/2022	111.533	0,02
USD	8.381.793		26.250.000	03/02/2022	17.178	0,00
USD	27.871.745		87.361.894	04/02/2022	32.967	0,00
USD	25.196.843		20.764.970.642	07/02/2022	524.213	0,03
USD	3.537.141		50.920.675.160	10/02/2022	5.327	0,03
USD	18.444.997		21.854.972.151	10/02/2022	26.742	0,00
USD	10.001.281		750.983.435	10/02/2022	21.994	0,00
USD	7.009.067		68.110.607	23/02/2022	2.020.236	0,00
						-
USD	7.932.544		77.642.945	06/04/2022	2.380.885	0,15
USD	14.253.000	IKY	137.534.323	14/06/2022	4.809.134	0,31
PLUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRA	ATOS DE	DIVISAS A PLAZO		42.124.621	2,68

	USD	de vencimiento	Venta	Compra Divisa	Divisa
(0,00)	(4.780)	02/12/2021	105.714.569	592.017.106 USD	BRL
(0,01)	(157.591)	02/12/2021	592.017.106	105.552.199 BRL	USD
(0,00)	(20.789)	06/12/2021	1.155.200	5.313.111 EUR	PLN
(0,02)	(490.805)	07/12/2021	35.520.370	2.630.370.040 USD	INR
(0,00)	(13.070)	09/12/2021	293.122.388	18.350.463 ZAR	USD
(0.01)	(26.221)	00/12/2021	24 646 040	244 622 420 116D	740

344.633.430 USD 21.616.919 09/12/2021 (0,01) (26.321)ZAR 106.161.077 USD 6.925.501 13/12/2021 (278.589) (0,02) 126.139.050 USD 14.253.000 14/12/2021 (4.679.570) (0,30) AUD 9.545.821 NZD 10.008.985 15/12/2021 (6.070) (0,00) AUD 31.018.800 USD 22.936.757 15/12/2021 (718.184) (0,05) CAD 46.695.807 USD 37.313.744 15/12/2021 (741.638) (0,05) CZK 221.603.378 EUR 8.730.627 15/12/2021 (72.346) (0,00) CZK 764.543.640 USD 35.286.571 15/12/2021 (1.247.558) (0,09) EUR 9.001.607 AUD 14.515.287 15/12/2021 (150.166) (0,01) EUR 5.987.652 CHF 6.478.879 15/12/2021 (260.455)(0,02)5.922.151 CZK 152.016.285 15/12/2021 (26.546) (0,00)

15/12/2021 Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Plusvalía latente

(24.538)

Fecha

% del patrimonio

2.503.137

#### Contratos de divisas a plazo – (continuación)

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
EUR	14.755.032	HUF	5.402.932.945	15/12/2021	(2.690)	(0,01)
EUR	11.821.328		1.552.932.894	15/12/2021	(337.461)	(0,03)
EUR	270.130.864		311.861.159	15/12/2021	(4.355.758)	(0,29)
GBP	17.619.428		23.873.441	15/12/2021	(330.019)	(0,02)
HUF	4.240.555.088		11.858.568	15/12/2021	(314.247)	(0,01)
HUF	7.545.034.353		25.027.287	15/12/2021	(1.567.726)	(0,10)
JPY	5.404.442.775		48.722.864	15/12/2021	(716.411)	(0,03)
MXN	1.697.281.853		83.792.956	15/12/2021	(4.401.723)	(0,29)
NOK	184.095.951		17.975.431	15/12/2021	(115.658)	(0,01)
NOK	31.570.120		3.654.435	15/12/2021	(165.217)	(0,01)
NZD	22.610.801		16.087.228	15/12/2021	(627.006)	(0,04)
PLN	53.865.918		11.712.659	15/12/2021	(223.905)	(0,00)
PLN	210.655.066		55.133.831	15/12/2021	(3.866.959)	(0,25)
RON	150.806.253		35.815.008	15/12/2021	(1.177.159)	(0,07)
SEK	58.717.738		5.860.310	15/12/2021	(155.587)	(0,01)
SEK	119.770.281		13.469.601	15/12/2021	(179.447)	(0,01)
SGD	9.221.545		6.839.108	15/12/2021	(77.617)	(0,01)
THB	1.078.431.551		32.502.036	15/12/2021	(499.054)	(0,02)
TRY	259.029.488		26.664.201	15/12/2021	(7.014.072)	(0,44)
USD	42.845.693		39.369.277	15/12/2021	(155.313)	(0,01)
USD	124.215.537		806.105.272	15/12/2021	(2.237.766)	(0,15)
USD	4.884.590		15.648.024	15/12/2021	(92.419)	(0,01)
USD	11.562.122		390.176.276	15/12/2021	(16.549)	(0,00)
ZAR	689.505.252		46.080.676	15/12/2021	(2.922.214)	(0,18)
ILS	22.384.765		7.157.795	22/12/2021	(34.959)	(0,00)
INR	321.326.217		4.275.666	27/12/2021	(3.039)	(0,00)
USD	82.682.792		480.403.555	03/01/2022	(2.517.804)	(0,16)
USD	41.242.727		1.141.909.132	19/01/2022	(163.797)	(0,01)
COP	119.368.579.572		31.457.989	21/01/2022	(1.812.770)	(0,12)
CLP	5.457.686.668		6.762.279	07/02/2022	(277.536)	(0,02)
MYR	540.517.179		129.316.814	09/02/2022	(1.250.383)	(0,08)
PEN	37.710.699		9.345.898	10/02/2022	(99.016)	(0,01)
RUB	2.422.721.533		33.524.265	10/02/2022	(1.330.433)	(0,08)
TRY	65.975.775		6.429.988	23/02/2022	(1.597.526)	(0,10)
TRY	71.510.897		7.141.591	06/04/2022	(2.028.389)	(0,13)
TRY	74.712.341		7.127.000	14/06/2022	(1.996.838)	(0,13)
USD	8.138.701		26.174.346	07/09/2022	(243.435)	(0,13)
		-		51709/2022		
MINUSVALÍA	LATENTE SOBRE CONTR	RATOS DE DIVISAS	S A PLAZO		(53.826.918)	(3,44)

Opciones - 0,02 %

Tenencias	Descripción del valor			Plusvalía /(minusvalía) latente USD	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	Opciones adquiridas					
	EUR					
	Put EUR / Call PLN	Vence 02/12/2021	Precio de ejercicio 4,56	(30.169)	13	0,00
	Put EUR / Call PLN	Vence 02/12/2021	Precio de ejercicio 4,56	(34.885)	13	0,00
	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,12	(164.744)	136.124	0,01
	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,12	(316.405)	105.837	0,01
	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	(55.418)	341.937	0,02
94.095.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,14	170.248	532.975	0,03
				(431.373)	1.116.899	0,07
	USD					
26.715.000	Call USD / Put ILS	Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 3,11	452.525	550.329	0,04
26.672.000	Call USD / Put ILS	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 3,13	274.988	380.076	0,02
26.587.000	Call USD / Put ILS	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 3,14	256.352	362.434	0,02
52.457.000	Call USD / Put INR	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 75,26	109.373	253.630	0,02
20.417.000	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 15,90	59.822	230.916	0,02
39.881.000	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 16,15	(92.803)	193.901	0,01
				1.060.257	1.971.286	0,13
TOTAL DE OPCIOI (coste USD 2.459.3					3.088.185	0,20
·	Opciones suscritas EUR					
(47.174.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	122.688	(170.961)	(0,01)
(46.984.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	274.472	(170.273)	(0,01)
(47.176.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,14	11.802	(267.215)	(0,02)

				Plusvalía	Valor de mercado en	% del
Tenencias	Descripción del valor			/(minusvalía) latente USD	USD	patrimonio
	Opciones suscritas – (continuación) EUR – (continuación)					
				408.962	(608.449)	(0,04)
(13.358.000)	USD ) Call USD / Put ILS	Vence 17/12/2021 Pre	ecio de ejercicio 3,06	(330.918)	(440.881)	(0,03
	) Call USD / Put ILS		ecio de ejercicio 3,08	(242.435)	(361.659)	(0,02
	) Call USD / Put ILS	Vence 22/12/2021 Pre	ecio de ejercicio 3,09	(232.007)	(356.040)	(0,02
(26.228.000)	) Call USD / Put INR		ecio de ejercicio 74,72	(95.522)	(231.173)	(0,02
` '	) Call USD / Put TRY		ecio de ejercicio 12,30	(475.387)	(550.151)	(0,04)
(19.941.000)	) Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021 Pre	ecio de ejercicio 15,90	25.795	(225.533)	(0,01)
TOTAL DE OPCIO	NES SUSCRITAS			(1.350.474)	(2.165.437)	(0,14)
(coste USD (1.832					(2.773.886)	(0,18)
TOTAL DE OPCIO (coste USD 626.92					314.299	0,02
Contratos de per	rmutas financieras – 0,13 %					
Importe teórico			<b>5</b>		Plusvalía latente	% del
	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	USD	patrimonio
165.790.000	Permutas de tipos de interés	Variable (BRCDI a 1 mes en BRI	_) BRL	02/01/2023	1.317.152	0,08
	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,400 %	BRL	02/01/2023	117.528	0,00
	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,300 %	BRL	02/01/2024	445.937	0,03
42.760.000	,	Variable (BRCDI a 1 mes en BRI		04/01/2027	606.719	0,04
183.350.000	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 11,230 %	BRL	04/01/2027	265.264	0,02
75.536.913.334	Fijo 4,300 %	Variable (CLOIS a 6 meses en C		15/12/2023	1.445.745	0,09
	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,500 %	CNY	15/09/2023	147.612	0,01
138.915.420.000		Variable (LIBOR a 3 meses en C		15/12/2023	601.762	0,04
5.695.023.533		Variable (PRIBOR a 6 meses en	,	15/12/2023	2.828.235	0,18
2.192.755.000	Variable (PRIBOR a 6 meses en CZK)	Fijo 3,600 % Variable (PRIBOR a 6 meses en	CZK CZK) CZK	15/12/2023 15/12/2031	465.468 219.791	0,03 0,01
146.350.000	•	Variable (PRIBOR a 6 meses en	,	15/12/2031	46.511	0,00
	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en E	,	15/12/2026	49.829	0,00
	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2031	495.032	0,03
3.220.000		Variable (EURIBOR a 6 meses e				
	Fijo 0,250 %	EUR)	EUR	15/12/2036	24.705	0,00
	Variable (TELBOR a 3 meses en ILS)	Fijo 1,300 %	ILS	15/12/2031	674.426	0,04
	Variable (LIBOR a 6 meses en INR)	Fijo 5,500 %	INR DM/	15/09/2026	468.877	0,03
174.675.860.000 406.890.000	•	Variable (LIBOR a 3 meses en K Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	RW) KRW MXN	16/03/2024 13/12/2023	466.054 306.331	0,03 0,02
465.360.000	• •	Variable (TILE a 1 mes en MXN)	MXN	03/12/2031	595.532	0,02
	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,250 %	MYR	17/06/2022	10.407	0,00
	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,250 %	MYR	17/06/2022	11.040	0,00
	Variable (LIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,250 %	MYR	17/06/2022	14.633	0,00
	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,650 %	MYR	27/02/2024	782.973	0,05
	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,693 %	MYR	01/03/2024	1.227.552	0,08
	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,605 %	MYR	06/03/2024	1.206.917	0,08
	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR) Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,330 % Fijo 3,250 %	MYR MYR	31/05/2024 18/12/2024	142.971 47.714	0,01 0,00
	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,250 % Fijo 3,250 %	MYR	18/12/2024 18/12/2024	107.630	0,00
	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,000 %	MYR	18/03/2025	78.238	0,01
	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,250 %	MYR	15/12/2031	59.551	0,00
7.756.030	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	Fijo 1,750 %	PLN	15/12/2023	8.350	0,00
12.675.000	Fijo 1,700 %	Variable (WIBOR a 6 meses en F	PLN) PLN	15/12/2026	168.874	0,01
PLUSVALÍA LATE	NTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTER	RÉS			15.455.360	0,98
30.000	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS) Variable (Bonos internacionales del Estado	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	2.728	0,00
7.570.000	de Perú) Variable (Bonos internacionales del Estado	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	1.437	0,00
4.080.000	de Filipinas) Variable (Bonos internacionales del Estado	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	21.061	0,00
4.680.000	de Catar) Variable (Bonos internacionales del Estado de saudí)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	57.604	0,01
	Variable (Bonos extranieros rusos – Eurobono)	Fiio 1 000 %	LISD	20/06/2025	8 859	0.00

20/06/2025

8.859

0,00

USD

Fijo 1,000 %

1.570.000 Variable (Bonos extranjeros rusos – Eurobono)

mporte teórico ocal neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del patrimoni
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS) – (continuación)					
3.920.000	Variable (Bonos extranjeros rusos –					
	Eurobono)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	43.900	0,0
3.610.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de saudí)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	244	0,0
LUSVALÍA LATEN	ITE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLI	MIENTO CREDITICIO (CDS)			135.833	0,0
	Permutas de divisas					
	Fijo 21,400 % Fijo 23,680 %	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)  Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD USD	16/03/2023 16/03/2023	3.315.353 1.757.954	0,2 0,1
	ITE SOBRE PERMUTAS DE DIVISAS	valiable (Elbert a cilicoco cili cob)		10/00/2020	5.073.307	0,3
	LÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DI	PERMUTAS FINANCIERAS			20.664.500	1,3
OTAL DE TEGOVA	LIA LATENTE GODILE GONTIATION DI	- PERMISTAGE IMANGERAG			Plusvalía	
nporte teórico ocal neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	latente	% del patrimoni
Jour Heto	Permutas de tipos de interés	Alesian	Diviou	T cond de venemiento		70 dei patrimoni
37.750.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 10,565 %	BRL	02/01/2023	(55.262)	(0,00
	Variable (LIBOR a 1 mes en BRL)	Fijo 7,200 %	BRL	02/01/2023	(2.394.056)	(0,15
	Fijo 11,814 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(12.237)	(0,00
	Fijo 11,905 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(13.837)	(0,00
	Fijo 12,185 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(36.521)	(0,00
	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 4,930 %	BRL	02/01/2024	(7.178.195)	(0,46
	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 9,200 %	BRL	02/01/2024	(278.415)	(0,02
	Variable (LIBOR a 6 meses en CLP)	Fijo 5,100 %	CLP	15/12/2031	(137.573)	(0,01
	Fijo 2,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	CNY	15/12/2026	(40.658)	(0,00
		,	COP		, ,	• •
	Variable (LIBOR a 3 meses en COP)	Fijo 6,400 %		15/12/2031	(38.034)	(0,00
	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2023	(11.834)	(0,00
	Variable (HIBOR a 3 meses en HKD)	Fijo 1,500 %	HKD	15/09/2031	(102.720)	(0,01
31.782.987.946		Variable (BUBOR a 6 meses en HUF)	HUF	16/03/2024	(27.751)	(0,00
5.382.624.594		Variable (BUBOR a 6 meses en HUF)	HUF	16/03/2032	(198.061)	(0,01
	Fijo 0,400 %	Variable (TELBOR a 3 meses en ILS)	ILS	15/12/2023	(34.187)	(0,00
4.404.870.000		Variable (LIBOR a 6 meses en INR)	INR	16/03/2024	(378.382)	(0,03
41.127.420.000	Fijo 1,750 %	Variable (KWCDC a 3 meses en KRW)	KRW	15/09/2031	(348.256)	(0,02
19.680.000	Variable (LIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,250 %	MYR	17/06/2025	(79.994)	(0,01
43.720.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,131 %	MYR	02/02/2026	(268.944)	(0,02
54.770.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,000 %	MYR	16/06/2026	(389.617)	(0,03
79.810.000	Variable (LIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,000 %	MYR	16/06/2026	(39.665)	(0,00
72.530.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,000 %	MYR	15/12/2031	(329.803)	(0,02
599.410.000	Fijo 0,250 %	Variable (WIBOR a 3 meses en PLN)	PLN	16/12/2021	(275.224)	(0,02
79.147.355	Fijo 2,000 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2031	(9.923)	(0,00
1.373.630.000	Variable (LIBOR a 6 meses en THB)	Fijo 1,000 %	THB	15/09/2026	(42.480)	(0,00
	Variable (LIBOR a 6 meses en THB)	Fijo 1,000 %	THB	16/03/2027	(63.107)	(0,00
	Fijo 1,750 %	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD	15/12/2031	(140.537)	(0,01
1.064.285.042		Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	ZAR	15/12/2023	(190.578)	(0,01
	Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	Fijo 7,400 %	ZAR	15/12/2031	(56.808)	(0,00
MINUSVALÍA LATE	NTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE	INTERÉS			(13.172.659)	(0,83
<u> </u>	Permutas de incumplimiento					(-,
	crediticio (CDS)					
4.080.000	Fijo 0,000 %	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2021	(584)	(0,00
7.410.000	Fijo 1,000 %	Variable (Bonos internacionales del Estado de China)	HeD	20/06/2022	(27.776)	(0.00
2.210.000	Fijo 1,000 %	Variable (Bonos internacionales del Estado	USD	20/00/2022	(27.776)	(0,00
		de China)	USD	20/06/2022	(7.273)	(0,00
1.830.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Colombia)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	(50.822)	(0,01
590.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Ucrania)	Fijo 5,000 %	USD	20/12/2024	(36.728)	(0,00
6.440.000	Variable (Bonos internacionales del	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(43.511)	(0,00
8.480.000	Estado de Indonesia) Variable (The Markit CDX Emerging	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(125.130)	(0,01
	Markets 36 Version 1 Index) Variable (Bonos extranjeros rusos –	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(6.232)	(0,00
430.000						

#### Contratos de permutas financieras - (continuación)

Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
	Permutas de divisas					
12.094.612	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	Fijo 21,400 %	TRY	16/03/2023	(3.661.715)	(0,23)
10.346.223	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	Fijo 23,680 %	TRY	16/03/2023	(1.566.963)	(0,10)
MINUSVALÍA LATE	ENTE SOBRE PERMUTAS DE DIVISAS				(5.228.678)	(0,33)
TOTAL DE MINUS	VALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS	DE PERMUTAS FINANCIERAS			(18.699.393)	(1,18)
VALOR DE MERCA	ADO DE LAS INVERSIONES 236.068)				1.476.191.621	93,74
OTROS ACTIVOS					98.169.602	6,26
PATRIMONIO					1.574.361.223	100,00
TOTAL DE INVERS	SIONES				Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Total inversiones ex	ccluyendo derivados (coste USD 1.641.60	9.141)			1.485.990.849	94,38
Plusvalía latente so	bre contratos de futuros				832.545	0,05
Minusvalía latente s	sobre contratos de futuros				(1.248.757)	(0,08)
Plusvalía latente de	contratos a plazo sobre bonos no entreg	ables			39.875	0,00
Plusvalía latente so	bre contratos de divisas a plazo				42.124.621	2,68
Minusvalía latente s	sobre contratos de divisas a plazo				(53.826.918)	(3,44)
Valor de mercado d	e opciones compradas (coste USD 2.459	.301)			3.088.185	0,20
Valor de mercado d	e opciones suscritas (coste USD (1.832.3	374))			(2.773.886)	(0,18)
Plusvalía latente so	bre contratos de permutas financieras				20.664.500	1,31
Minusvalía latente s	sobre contratos de permutas financieras				(18.699.393)	(1,18)
Otros activos y pasi	ivos				98.169.602	6,26
Patrimonio					1.574.361.223	100,00

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Credit Suisse International, Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Natwest Markets Plc., Standard Chartered Bank, State Street Bank & Trust y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Barclays Bank Plc., HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc. y UBS AG. Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Bank of America N.A., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Credit Suisse, JP Morgan Chase Bank N.A., Merrill Lynch International, Morgan Stanley y Morgan Stanley & Co. International Plc.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 1,48 %

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.

  (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida
- para ese tipo de títulos.

  (c) Este título tiene un cupón escalonado que pasará al segundo tipo en una fecha determinada del futuro.
- (d) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021
- (e) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (f) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- $^{(g)}\,$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de
		Divisa	interes	Techa de vencimiento	035	patrillorit
Bonos - 92,78	liarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial 8 %					
Angola 16 580 000	Bonos internacionales del Estado de Angola	USD	8,250 %	09/05/2028	15.689.654	0,34
	Bonos internacionales del Estado de Angola	USD	8,000 %	26/11/2029	10.255.705	0,22
	Bonos internacionales del Estado de Angola	USD	9,375 %	08/05/2048	988.961	0,02
	Bonos internacionales del Estado de Angola	USD	9,125 %	26/11/2049	10.046.200	0,21
					36.980.520	0,79
Argentina 471 785	Bonos internacionales del Estado de Argentina	EUR	0,500 %	09/07/2029	186.948	0,00
	Bonos internacionales del Estado de Argentina	USD	1,000 %	09/07/2029	2.147.901	0,0
	Bonos internacionales del Estado de Argentina	EUR	0,125 %	09/07/2030	4.936.907	0,1
75.491.473	Bonos internacionales del Estado de Argentina <sup>(c)</sup>	USD	0,500 %	09/07/2030	23.779.814	0,5
56.775.914	Bonos internacionales del Estado de Argentina(c)	USD	1,125 %	09/07/2035	16.152.747	0,34
16.955.235	Bonos internacionales del Estado de Argentina(c)	USD	2,500 %	09/07/2041	5.290.033	0,11
425.475	Bonos internacionales del Estado de Argentina <sup>(c)</sup>	USD	1,125 %	09/07/2046	121.154	0,00
					52.615.504	1,12
Armenia 3.970.000	Bono internacional de Armenia	USD	3,950 %	26/09/2029	3.815.170	0,08
	Bono internacional de Armenia	USD	3,600 %	02/02/2031	7.328.991	0,16
					11.144.161	0,24
	Bonos internacionales de Azerbaiyán	USD	3,500 %	01/09/2032	28.431.866	0,61
3.470.000	State Oil Co. of the Azerbaijan Republic	USD	6,950 %	18/03/2030	4.158.309	0,09
					32.590.175	0,70
9 020 000	Bonos internacionales del Estado de Baréin	USD	4,250 %	25/01/2028	8.738.125	0,19
	Bonos internacionales del Estado de Baréin	USD	7,000 %	12/10/2028	6.034.475	0,13
	Bonos internacionales del Estado de Baréin	USD	6,750 %	20/09/2029	1.203.292	0,03
28.660.000	Bonos internacionales del Estado de Baréin	USD	7,375 %	14/05/2030	31.347.950	0,67
1.380.000	Bonos internacionales del Estado de Baréin	USD	5,625 %	30/09/2031	1.341.277	0,03
14.410.000	Bonos internacionales del Estado de Baréin	USD	5,450 %	16/09/2032	13.653.475	0,29
4.430.000	Bonos internacionales del Estado de Baréin	USD	5,250 %	25/01/2033	4.114.362	0,09
47.240.000	Bonos internacionales del Estado de Baréin	USD	5,625 %	18/05/2034	44.582.750	0,95
12.340.000	CBB International Sukuk Programme Co., WLL	USD	3,950 %	16/09/2027	12.370.850	0,26
					123.386.556	2,64
Bielorrusia 230.000	Bonos internacionales de Bielorrusia	USD	7,625 %	29/06/2027	216.775	0,00
	Bonos internacionales de Bielorrusia	USD	6,378 %	24/02/2031	6.338.120	0,14
					6.554.895	0,14
Belice						
	Bonos internacionales del Estado de Belice <sup>(d)</sup>	USD	4,938 %	20/02/2034	105.912	0,00
Benín 17.470.000	Bonos internacionales del Estado de Benín	EUR	4,875 %	19/01/2032	19.033.424	0,41
	Bonos internacionales del Estado de Benín	EUR	4,950 %	22/01/2035	20.686.472	0,44
	Bonos internacionales del Estado de Benín	EUR	6,875 %	19/01/2052	1.234.596	0,03
					40.954.492	0,88
Bermudas 6.750.000	Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	USD	2,625 %	15/08/2025	6.798.938	0,15
Bolivia	rengizenevion i mance co. international Etc.		2,023 /0	13/00/2023	0.790.930	0,10
	Bonos internacionales del Estado de Bolivia	USD	4,500 %	20/03/2028	1.922.422	0,04
Brasil	Banco do Brasil S.A.	USD	A 750 0/	20/03/2024	5 074 FE7	0.4
	Banco do Brasil S.A. (d)Banco do Brasil S.A. (d)	USD	4,750 % 6,250 %	20/03/2024 Perp.	5.074.557 7.430.114	0,11 0,16
	Bonos internacionales del Estado de Brasil	USD	5,000 %	27/01/2045	2.403.427	0,16
	Bonos internacionales del Estado de Brasil	USD	4,750 %	14/01/2050	26.985.139	0,08
3.190.000		USD	4,875 %	24/01/2030	3.137.461	0,07
	Samarco Mineracao S.A.	USD	4,075 %	01/11/2022	1.655.707	0,07
	Samarco Mineracao S.A.	USD	5,750 %	24/10/2023	1.347.365	0,03
	Samarco Mineracao S.A.	USD	5,375 %	26/09/2024	2.980.109	0,06
						1,09
					51.013.879	1,0

					Valor de	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con	<u> </u>					
Islas Vírgenes	·					
	Central American Bottling Corp.	USD	5,750 %	31/01/2027	11.168.331	0,24
	Easy Tactic Ltd.	USD	8,125 %	11/07/2024	355.350	0,01
	Fortune Star BVI Ltd.	EUR	3,950 %	02/10/2026	1.203.021	0,02
	Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	USD USD	4,750 %	27/04/2027	1.782.000	0,04
	Huarong Finance 2017 Co., Ltd. <sup>(d)</sup> Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	USD	4,000 % 3,750 %	Perp. 29/05/2024	13.196.700 437.800	0,28 0,01
	Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	USD	3,250 %	13/11/2024	1.055.700	0,01
	Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	USD	3,375 %	24/02/2030	1.510.650	0,03
	Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	5,500 %	16/01/2025	8.434.875	0,18
7.600.000	Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	5,000 %	19/11/2025	7.790.000	0,17
	Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	4,625 %	03/06/2026	7.754.600	0,17
	Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	4,875 %	22/11/2026	6.176.225	0,13
2.040.000	Kunzhi Ltd.	USD	6,250 %	17/10/2020	306.000	0,01
					61.171.252	1,31
Camerún	Panas internacionales de Comerón	FUD	E 050 0/	07/07/2022	22 020 006	0.51
	Bonos internacionales de Camerún	EUR	5,950 %	07/07/2032	23.930.996	0,51
9.136.400	Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais	USD	5,333 %	15/02/2028	9.545.368	0,20
	China Aoyuan Group Ltd.	USD	5,880 %	01/03/2027	367.500	0,20
	China SCE Group Holdings Ltd.	USD	6,000 %	04/02/2026	530.400	0,01
	DP World Crescent Ltd.	USD	4,848 %	26/09/2028	4.299.175	0,09
5.990.000	DP World Crescent Ltd.	USD	3,875 %	18/07/2029	6.382.345	0,14
6.160.000	DP World Crescent Ltd.	USD	3,750 %	30/01/2030	6.491.100	0,14
	DP World Salaam(d)	USD	6,000 %	Perp.	24.771.616	0,53
	Dubai DOF Sukuk Ltd.	USD	2,763 %	09/09/2030	11.534.200	0,25
	Embraer Overseas Ltd.	USD	5,696 %	16/09/2023	34.574	0,00
	Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	USD	10,875 %	09/01/2023	92.500	0,00
	Fantasia Holdings Group Co., Ltd. Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	USD USD	11,875 % 10,875 %	01/06/2023 02/03/2024	177.500 327.500	0,00 0,01
	Grupo Aval Ltd.	USD	4,750 %	26/09/2022	2.671.702	0,01
	IHS Holding Ltd.	USD	5,625 %	29/11/2026	1.028.713	0,00
	IHS Holding Ltd.	USD	6,250 %	29/11/2028	1.147.125	0,02
3.070.000	•	USD	2,000 %	01/04/2025	2.607.471	0,06
1.430.000	iQIYI, Inc.	USD	4,000 %	15/12/2026	1.182.794	0,02
1.310.000	KWG Group Holdings Ltd.	USD	6,000 %	14/08/2026	962.850	0,02
6.373.692	Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	USD	4,350 %	05/04/2036	6.823.834	0,15
	Maldives Sukuk Issuance Ltd.	USD	9,875 %	08/04/2026	2.387.775	0,05
1.280.000		USD	3,050 %	28/10/2030	1.192.262	0,03
	Redsun Properties Group Ltd.	USD	9,700 %	16/04/2023	336.400 159.800	0,01
	Redsun Properties Group Ltd. Ronshine China Holdings Ltd.	USD USD	7,300 % 6,750 %	13/01/2025 05/08/2024	93.450	0,00 0,00
	Sharjah Sukuk Program Ltd.	USD	4,226 %	14/03/2028	11.712.464	0,00
	Sharjah Sukuk Program Ltd.	USD	3,234 %	23/10/2029	13.005.073	0,28
	Sunac China Holdings Ltd.	USD	6,500 %	10/01/2025	462.049	0,01
	Sunac China Holdings Ltd.	USD	7,000 %	09/07/2025	317.400	0,01
	VLL International, Inc.	USD	7,250 %	20/07/2027	608.681	0,01
	Yuzhou Group Holdings Co., Ltd. (d)	USD	5,375 %	Perp.	369.050	0,01
2.560.000	Zhenro Properties Group Ltd. <sup>(d)</sup>	USD	10,250 %	Perp.	2.124.800	0,04
					113.747.471	2,43
Chile	Panco internacionales del Estada de Chila	Hen	2 400 0/	00/04/0004	0 200 000	0.40
	Bonos internacionales del Estado de Chile	USD	3,100 %	22/01/2061	8.389.968	0,18
	Bonos internacionales del Estado de Chile Corp. Nacional del Cobre de Chile	USD USD	3,250 % 3,750 %	21/09/2071 15/01/2031	1.184.910 212.850	0,03 0,00
	Empresa de los Ferrocarriles del Estado	USD	3,068 %	18/08/2050	2.424.833	0,00
	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.	USD	3,650 %	07/05/2030	3.052.962	0,07
	GNL Quintero S.A.	USD	4,634 %	31/07/2029	5.184.180	0,11
	Inversiones CMPC S.A.	USD	4,375 %	04/04/2027	512.335	0,01
840.000	Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A.	USD	4,250 %	22/01/2050	899.170	0,02
					21.861.208	0,47
Colombia	Person de Parrete O A		E 075 0/	10/00/0055	000 005	
	Banco de Bogota S.A.	USD	5,375 %	19/02/2023	226.325	0,01
	Banco de Bogota S.A.	USD	6,250 %	12/05/2026	27.349.400	0,58
	Bonos internacionales del Estado de Colombia Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD USD	3,875 % 4 500 %	25/04/2027 15/03/2029	403.675 10.447.216	0,01 0,22
	Bonos internacionales del Estado de Colombia  Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	4,500 % 3,000 %	30/01/2030	5.552.936	0,22
	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	3,125 %	15/04/2031	44.212.632	0,12
			-, .20 /0	.0.02001		5,00

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del
Bonos - (con	·	Divisa	interes.	recha de vencimiento.	030	patrinonic
Colombia – (con	•					
9.080.000	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	3,250 %	22/04/2032	8.149.300	0,17
3.850.000	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	5,625 %	26/02/2044	3.772.548	0,08
5.080.000	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	5,000 %	15/06/2045	4.634.395	0,10
	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	4,125 %	15/05/2051	18.572.838	0,40
17.300.000	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	3,875 %	15/02/2061	13.163.094	0,28
Chipre					136.484.359	2,92
7.700.000	MHP S.E.	USD	7,750 %	10/05/2024	7.929.094	0,17
República Don						
	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI S.A.	USD	6,750 %	30/03/2029	13.066.616	0,28
	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	6,600 %	28/01/2024	5.613.500	0,12
	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	5,875 %	18/04/2024	28.161.000	0,60
	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	6,875 %	29/01/2026	8.379.000	0,18
	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	8,625 %	20/04/2027	403.210	0,01
	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	4,500 %	30/01/2030	14.081.911	0,30
	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD USD	4,875 % 6,850 %	23/09/2032 27/01/2045	15.717.713 22.002.369	0,34 0,47
	Bonos internacionales de la República Dominicana Ropos internacionales de la República Dominicana	USD	6,500 %	15/02/2048	15.514.500	0,47
	Bonos internacionales de la República Dominicana Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	6,400 %	05/06/2049	9.892.628	0,33
	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	5,875 %	30/01/2060	9.272.100	0,21
9.920.000	Borios internacionales de la republica Dominicana	03D	3,073 /0	30/01/2000	142.104.547	3,04
Ecuador						
7.114.187	Bonos internacionales del Estado de Ecuador <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	31/07/2030	5.886.990	0,12
18.312.312	Bonos internacionales del Estado de Ecuador	USD	6,932 %	31/07/2030	10.209.114	0,22
58.616.048	Bonos internacionales del Estado de Ecuador(c)	USD	10,174 %	31/07/2035	38.833.132	0,83
28.577.141	Bonos internacionales del Estado de Ecuador <sup>(c)</sup>	USD	0,500 %	31/07/2040	16.735.488	0,36
					71.664.724	1,53
Egipto	B	EUD.	4.750.0/	11/01/0005	7 400 000	0.45
	Bonos internacionales del Estado de Egipto	EUR	4,750 %	11/04/2025	7.190.803	0,15
	Bonos internacionales del Estado de Egipto	EUR	4,750 %	16/04/2026	28.962.991	0,62
	Bonos internacionales del Estado de Egipto	USD EUR	6,588 %	21/02/2028 16/04/2030	1.731.900 49.443.933	0,04 1,06
	Bonos internacionales del Estado de Egipto Bonos internacionales del Estado de Egipto	USD	5,625 % 5,875 %	16/02/2031	943.500	0,02
	Bonos internacionales del Estado de Egipto	EUR	6,375 %	11/04/2031	5.278.734	0,02
	Bonos internacionales del Estado de Egipto	USD	7,625 %	29/05/2032	5.493.350	0,12
	Bonos internacionales del Estado de Egipto	USD	8,875 %	29/05/2050	3.001.550	0,06
	Bonos internacionales del Estado de Egipto	USD	8,150 %	20/11/2059	607.500	0,01
	Bonos internacionales del Estado de Egipto	USD	7,500 %	16/02/2061	9.718.650	0,21
					112.372.911	2,40
El Salvador						
	Bonos internacionales del Estado de El Salvador	USD	6,375 %	18/01/2027	2.213.760	0,05
	Bonos internacionales del Estado de El Salvador	USD	8,625 %	28/02/2029	820.642	0,02
	Bonos internacionales del Estado de El Salvador	USD	8,250 %	10/04/2032	729.732	0,01
	Bonos internacionales del Estado de El Salvador Bonos internacionales del Estado de El Salvador	USD USD	7,625 % 9,500 %	01/02/2041 15/07/2052	1.407.118 24.173.176	0,03 0,52
					29.344.428	0,63
Etiopía						
	Bonos internacionales de Etiopía	USD	6,625 %	11/12/2024	6.101.625	0,13
Gabón 3.925.079	Bonos internacionales del Estado de Gabón	USD	6,375 %	12/12/2024	4.132.401	0,09
	Bonos internacionales del Estado de Gabón	USD	6,625 %	06/02/2031	11.727.443	0,05
	Bonos internacionales del Estado de Gabón	USD	7,000 %	24/11/2031	6.775.650	0,14
					22.635.494	0,48
Ghana						2,10
	Bonos internacionales del Estado de Ghana	USD	6,375 %	11/02/2027	12.554.200	0,27
	Bonos internacionales del Estado de Ghana	USD	7,750 %	07/04/2029	10.448.000	0,22
	Bonos internacionales del Estado de Ghana	USD	7,625 %	16/05/2029	2.669.138	0,06
	Bonos internacionales del Estado de Ghana	USD	10,750 %	14/10/2030	3.513.825	0,08
	Bonos internacionales del Estado de Ghana	USD	8,125 %	26/03/2032	22.201.270	0,47
28.210.000						
	Bonos internacionales del Estado de Ghana	USD	8,625 %	07/04/2034	14.693.512	0,31

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de
	Descripción del valor	DIVISA	interes	recha de vencimiento(**/	020	patrimonic
Bonos - (con	•					
2 398 000	Bonos internacionales del Estado de Ghana	USD	8,627 %	16/06/2049	1.822.480	0,04
	Bonos internacionales del Estado de Ghana	USD	8,950 %	26/03/2051	1.828.856	0,04
					72.972.074	1,56
					72.972.074	1,30
Quatemala 22.055.000	Bonos del Estado de Guatemala	USD	4,500 %	03/05/2026	23.325.533	0,50
	Bonos del Estado de Guatemala  Bonos del Estado de Guatemala	USD	4,375 %	05/06/2027	29.685.335	0,63
	Bonos del Estado de Guatemala	USD	4,900 %	01/06/2030	440.078	0,01
7.140.000	Bonos del Estado de Guatemala	USD	6,125 %	01/06/2050	7.972.220	0,17
					61.423.166	1,31
Honduras						
	Bonos internacionales del Estado de Honduras	USD	7,500 %	15/03/2024	20.343.495	0,43
3.680.000	Bonos internacionales del Estado de Honduras	USD	5,625 %	24/06/2030	3.698.400	0,08
					24.041.895	0,51
Hong Kong						
	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	USD	4,125 %	19/07/2027	3.708.665	0,08
	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	USD	5,125 %	14/03/2028	6.737.070	0,15
	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	USD	3,875 %	19/06/2029	11.369.689	0,24
	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	USD	3,000 % 8.875 %	22/09/2030	3.838.880	0,08
540.000	Wanda Group Overseas Ltd.	USD	8,875 %	21/03/2023	467.100	0,01
					26.121.404	0,56
Hungría	Bonos internacionales del Estado de Hungría	EUR	1,750 %	05/06/2035	5.462.864	0,11
	Bonos internacionales del Estado de Hungría	USD	7,625 %	29/03/2041	1.272.313	0,1
700.000	Borios internacionales del Estado de Hangila	005	7,020 70	20/00/2041	6.735.177	0,14
 India						
	Adani Electricity Mumbai Ltd.	USD	3,949 %	12/02/2030	351.227	0,01
950.000	Adani Green Energy Ltd.	USD	4,375 %	08/09/2024	955.938	0,02
2.940.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	USD	4,200 %	04/08/2027	3.059.974	0,07
1.090.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	USD	4,375 %	03/07/2029	1.147.914	0,02
		,			5.515.053	0,12
Indonesia						
	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT(d)	USD	4,300 %	Perp.	4.856.062	0,10
	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	USD USD	3,398 % 3,541 %	09/06/2031 27/04/2032	199.625 5.519.631	0,00 0,12
	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	USD	4,745 %	09/06/2051	1.221.000	0,12
	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	USD	4,805 %	27/04/2052	3.131.400	0,07
	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	USD	5,450 %	15/05/2030	7.123.864	0,15
	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	USD	5,800 %	15/05/2050	4.478.874	0,10
1.800.000	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	6,625 %	17/02/2037	2.459.120	0,05
	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	4,625 %	15/04/2043	6.047.325	0,13
	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	4,350 %	11/01/2048	2.438.538	0,05
	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	3,500 %	14/02/2050	1.861.017	0,04
	Bonos internacionales del Estado de Indonesia Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD USD	3,050 % 4,450 %	12/03/2051	3.194.150 27.687.562	0,07 0,59
	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	3,350 %	15/04/2070 12/03/2071	3.073.950	0,07
	Pertamina Persero PT	USD	2,300 %	09/02/2031	4.210.813	0,09
	Pertamina Persero PT	USD	6,500 %	27/05/2041	2.773.581	0,06
	Pertamina Persero PT	USD	6,000 %	03/05/2042	5.083.324	0,11
4.500.000	Pertamina Persero PT	USD	4,700 %	30/07/2049	4.865.917	0,10
	Pertamina Persero PT	USD	4,175 %	21/01/2050	12.856.891	0,27
	Pertamina Persero PT	USD	4,150 %	25/02/2060	2.804.550	0,06
	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III	USD USD	2,550 % 3.800 %	09/06/2031	5.490.712 3.133.875	0,12
ა.სⴢს.სსს	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III	020	3,800 %	23/06/2050	3.133.875	0,07
					114.511.781	2,45
1rak 3 688 750	Bonos internacionales de Irak	USD	5,800 %	15/01/2028	3.390.155	0,07
Irlanda	3 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10	000	3,000 /0	.5/01/2020	2.300.100	0,07
	Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc.(d)	USD	7,500 %	05/10/2027	6.935.120	0,15
3.618.000	Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc.(d)	USD	8,875 %	Perp.	3.593.647	0,07

	Descripción del valor tinuación)	Divisa	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>		
Isla de Man 800.000					USD	patrimonic
	Sasol Financing International Ltd.	USD	4,500 %	14/11/2022	812.000	0,02
Israel						
	Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 212	ILS	(0,260 %)	02/02/2022	25.859.566	0,55
	Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 412	ILS	(0,140 %)	06/04/2022	4.927.921	0,11
	Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 622 Leviathan Bond Ltd. 144A <sup>(e)</sup>	ILS USD	(0,120 %) 5,750 %	08/06/2022 30/06/2023	5.420.713 10.981.498	0,12 0,23
10.7 10.000	Ecviation Bond Etd. 144A-	005	3,730 70	30/00/2023	47.189.698	1,01
Costa de Marfil					47.100.000	1,01
40.830.000	Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	EUR	5,250 %	22/03/2030	46.646.596	1,00
7.560.000	Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	EUR	4,875 %	30/01/2032	8.069.613	0,17
5.600.000	Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	USD	6,125 %	15/06/2033	5.747.798	0,12
14.130.000	Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	EUR	6,625 %	22/03/2048	15.393.798	0,33
					75.857.805	1,62
Jamaica	December of the second of the	1100	7.075.0/	00/07/0045	04 474 540	0.07
	Bonos internacionales del Estado de Jamaica	USD	7,875 %	28/07/2045	31.474.548	0,67
<b>Japón</b> 3.930.000	SoftBank Group Corp.(d)	USD	6,000 %	Perp.	3.851.400	0,08
Jersey			-			
	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,625 %	31/03/2036	997.050	0,02
2.760.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,940 %	30/09/2040	2.735.850	0,06
					3.732.900	0,08
Jordania 12.240.000	Bonos internacionales del Estado de Jordania	USD	5,850 %	07/07/2030	12.071.700	0,26
Kazajistán			-,			-, -
-	KazMunayGas National Co., JSC	USD	4,750 %	19/04/2027	26.717.178	0,57
	KazMunayGas National Co., JSC	USD	3,500 %	14/04/2033	8.793.500	0,19
	KazMunayGas National Co., JSC	USD	5,750 %	19/04/2047	601.698	0,01
					36.112.376	0,77
Kenia						
	Bonos internacionales del Estado de Kenia	USD	6,875 %	24/06/2024	15.978.655	0,34
	Bonos internacionales del Estado de Kenia	USD	7,000 %	22/05/2027	13.676.000	0,29
	Bonos internacionales del Estado de Kenia	USD	7,250 %	28/02/2028	2.482.187	0,06
13.410.000	Bonos internacionales del Estado de Kenia	USD	8,000 %	22/05/2032	14.181.075	0,30
Líbano					46.317.917	0,99
	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,100 %	04/10/2022	149.500	0,00
	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,650 %	22/04/2024	1.013.150	0,02
17.763.000	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,200 %	26/02/2025	2.042.745	0,04
650.000	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,600 %	27/11/2026	74.750	0,00
18.708.000	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,750 %	29/11/2027	2.151.420	0,05
3.780.000	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,650 %	03/11/2028	434.700	0,01
34.469.000	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,850 %	25/05/2029	3.963.935	0,08
24.287.000	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,650 %	26/02/2030	2.793.005	0,06
	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	7,050 %	02/11/2035	903.095	0,02
10.250.000	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	8,250 %	12/04/2049	1.217.188	0,03
					14.743.488	0,31
Luxemburgo 5.240.000	Altice Financing S.A.	EUR	4,250 %	15/08/2029	5.747.246	0,12
	Puma International Financing S.A.	USD	5,000 %	24/01/2026	461.725	0,01
	Rede D'or Finance SARL	USD	4,500 %	22/01/2030	5.026.203	0,11
					11.235.174	0,24
Malasia	Aviata SayE Laburan Ltd	Hen	2.064.0/	40/00/2050	1 000 533	0.00
	Axiata Spv5 Labuan Ltd.	USD	3,064 %	19/08/2050	1.090.532	0,02
	Genm Capital Ltd.	USD	3,882 %	19/04/2031	4.550.320	0,10
	Petronas Capital Ltd. Petronas Capital Ltd.	USD USD	4,550 % 4,800 %	21/04/2050 21/04/2060	20.630.380 10.530.939	0,44 0,23
7.510.000	. Sasasas Supriar Eta.	000	,000 /0	21/04/2000		
					36.802.171	0,79

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del
Bonos – (con	·	Divisa	interes	r echa de vencimiento	000	patimonic
Mauricio	tinuacion)					
	India Airport Infrastructure	USD	6,250 %	25/10/2025	878.439	0,02
	India Green Power Holdings	USD	4,000 %	22/02/2027	2.401.950	0,05
6.320.000	MTN Mauritius Investments Ltd.	USD	4,755 %	11/11/2024	6.525.337	0,14
					9.805.726	0,21
México						
3.240.000	Banco Mercantil del Norte S.A. (d)	USD	5,875 %	Perp.	3.182.879	0,07
8.800.000	Banco Mercantil del Norte S.A.(d)	USD	6,750 %	Perp.	9.102.280	0,19
2.650.000	Banco Santander Mexico S.A. Institucion de Banca Multiple Grupo		5.050.0/	0.4/4.0/0.000	0.005.000	2.00
4 547 000	Financiero Santander <sup>(d)</sup> BBVA Bancomer S.A. <sup>(d)</sup>	USD USD	5,950 % 5.125 %	01/10/2028 18/01/2033	2.805.999 4.631.120	0,06
	Cemex SAB de CV	USD	7,375 %	05/06/2027	908.186	0,10
	Cemex SAB de CV	USD	5,200 %	17/09/2030	1.633.429	0,03
	Industrias Penoles SAB de CV	USD	4,750 %	06/08/2050	2.186.630	0,05
5.543.000	Mexico City Airport Trust	USD	5,500 %	31/10/2046	5.363.961	0,11
	Mexico City Airport Trust	USD	5,500 %	31/07/2047	21.869.274	0,47
	Mexico City Airport Trust 144A <sup>(e)</sup>	USD	3,875 %	30/04/2028	16.665.704	0,36
	Mexico City Airport Trust 144A <sup>(e)</sup> Mexico City Airport Trust 144A <sup>(e)</sup>	USD USD	5,500 % 5,500 %	31/10/2046 31/07/2047	7.998.040 193.200	0,17 0,00
	Bonos internacionales del Estado de México	USD	5,500 % 4,500 %	22/04/2029	193.200	0,00
	Bonos internacionales del Estado de México	USD	2,659 %	24/05/2031	6.703.466	0,22
	Bonos internacionales del Estado de México	USD	4,750 %	27/04/2032	16.769.622	0,36
18.330.000	Bonos internacionales del Estado de México	EUR	2,250 %	12/08/2036	19.853.068	0,42
5.390.000	Bonos internacionales del Estado de México	USD	4,750 %	08/03/2044	5.798.225	0,12
	Bonos internacionales del Estado de México	USD	4,600 %	23/01/2046	786.315	0,02
	Bonos internacionales del Estado de México	USD	4,350 %	15/01/2047	1.374.415	0,03
	Bonos internacionales del Estado de México Bonos internacionales del Estado de México	USD EUR	4,600 % 2,125 %	10/02/2048 25/10/2051	13.545.090 4.562.212	0,29 0,10
	Bonos internacionales del Estado de México	USD	3,771 %	24/05/2061	18.723.244	0,10
	Petroleos Mexicanos	EUR	5,125 %	15/03/2023	46.255.237	0,99
	Petroleos Mexicanos	USD	6,875 %	04/08/2026	350.130	0,01
5.610.000	Petroleos Mexicanos	USD	6,490 %	23/01/2027	5.760.909	0,12
	Petroleos Mexicanos	USD	6,500 %	13/03/2027	7.276.183	0,16
	Petroleos Mexicanos	USD	5,350 %	12/02/2028	1.927.590	0,04
	Petroleos Mexicanos Petroleos Mexicanos	USD USD	6,375 %	23/01/2045 23/01/2046	4.052.625 6.601.125	0,09
	Petroleos Mexicanos	USD	5,625 % 6,750 %	21/09/2047	1.986.549	0,14 0,04
	Petroleos Mexicanos	USD	6,350 %	12/02/2048	17.716.144	0,38
	Petroleos Mexicanos	USD	7,690 %	23/01/2050	15.053.540	0,32
11.821.000	Petroleos Mexicanos	USD	6,950 %	28/01/2060	9.645.936	0,21
1.520.000	Unifin Financiera SAB de CV	USD	7,375 %	12/02/2026	1.265.571	0,03
1.110.000	Unifin Financiera SAB de CV	USD	8,375 %	27/01/2028	912.797	0,02
					293.939.284	6,28
Mongolia						
5.333.000	Bonos internacionales del Estado de Mongolia	USD	5,625 %	01/05/2023	5.517.988	0,12
8.530.000	Bonos internacionales del Estado de Mongolia	USD	5,125 %	07/04/2026	8.743.250	0,18
2.960.000	Bonos internacionales del Estado de Mongolia	USD	3,500 %	07/07/2027	2.797.200	0,06
					17.058.438	0,36
Marruecos						
5.200.000	Bonos internacionales del Estado de Marruecos	USD	2,375 %	15/12/2027	5.040.750	0,11
13.290.000	Bonos internacionales del Estado de Marruecos	EUR	1,500 %	27/11/2031	13.565.864	0,29
	Bonos internacionales del Estado de Marruecos	USD	3,000 %	15/12/2032	25.201.912	0,54
	Bonos internacionales del Estado de Marruecos	USD	4,000 %	15/12/2050	7.432.425	0,16
300.000	OCP S.A.	USD	3,750 %	23/06/2031	290.250	0,00
					51.531.201	1,10
Mozambique						
10.270.000	Bonos internacionales de Mozambique(c)	USD	5,000 %	15/09/2031	8.708.934	0,19
Países Bajos						
-	Greenko Dutch BV	USD	3,850 %	29/03/2026	1.651.451	0,04
	IHS Netherlands Holdco BV	USD	8,000 %	18/09/2027	2.630.112	0,06
	Lukoil Securities BV	USD	3,875 %	06/05/2030	10.021.577	0,21
	Metinvest BV	USD	7,750 %	23/04/2023	204.442	0,00
	Metinvest BV	USD	8,500 %	23/04/2026	3.727.695	0,08
	Minejesa Capital BV	USD	4,625 %	10/08/2030	4.577.938	0,10
	MV24 Capital BV NE Property BV	USD EUR	6,748 % 1,875 %	01/06/2034	5.161.991 5.682.276	0,11 0,12
4.070.000	NE FTOPETTY DV	EUK	1,875 %	09/10/2026	5.682.276	U,

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de
Bonos – (con	· · ·	Divisu		T cond do venomiento		patimom
•	- (continuación)					
-	NE Property BV	EUR	3,375 %	14/07/2027	3.072.026	0,07
	Prosus NV	USD	3,680 %	21/01/2030	4.745.151	0,10
11.160.000	Prosus NV	USD	4,027 %	03/08/2050	10.434.600	0,22
					51.909.259	1,1
Nigeria						
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	7,625 %	21/11/2025	1.496.363	0,03
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	6,500 %	28/11/2027	18.714.712	0,40
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	6,125 %	28/09/2028	17.038.383	0,36
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD USD	7,143 %	23/02/2030 21/01/2031	17.347.000 6.947.875	0,37 0,15
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	8,747 % 7,875 %	16/02/2032	35.577.281	0,76
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	7,375 %	28/09/2033	14.519.487	0,7
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	7,696 %	23/02/2038	8.707.513	0,19
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	9,248 %	21/01/2049	196.000	0,00
9.100.000	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	8,250 %	28/09/2051	8.178.625	0,18
					128.723.239	2,75
Macedonia del			0 === ::		00 577 000	<u> </u>
	Bonos internacionales del Estado de Macedonia del Norte Bonos internacionales del Estado de Macedonia del Norte	EUR EUR	2,750 % 1,625 %	18/01/2025 10/03/2028	29.577.902 12.838.653	0,63 0,28
12.100.000	Bollos iliterracionales del Estado de Macedonia del Norte	LOIX	1,023 /0	10/03/2020		
					42.416.555	0,91
Omán 7.800.000	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	4,750 %	15/06/2026	7.902.375	0,17
	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	5,375 %	08/03/2027	2.758.725	0,06
10.950.000	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	6,750 %	28/10/2027	12.010.781	0,26
23.120.000	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	5,625 %	17/01/2028	23.784.700	0,5
2.890.000	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	6,000 %	01/08/2029	3.009.213	0,06
23.850.000	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	6,250 %	25/01/2031	25.012.687	0,54
	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	7,375 %	28/10/2032	16.650.750	0,36
	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	6,500 %	08/03/2047	3.444.688	0,07
	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	6,750 %	17/01/2048	16.405.000	0,35
9.480.000	Oman Sovereign Sukuk Co.	USD	4,875 %	15/06/2030	9.989.550	0,21
					120.968.469	2,59
2 300 000	Bonos internacionales del Estado de Pakistán	USD	8,250 %	30/09/2025	2.478.773	0,06
	Bonos internacionales del Estado de Pakistán	USD	6,000 %	08/04/2026	7.910.100	0,17
	Bonos internacionales del Estado de Pakistán	USD	6,875 %	05/12/2027	7.535.008	0,16
	Bonos internacionales del Estado de Pakistán	USD	7,375 %	08/04/2031	8.509.375	0,18
17.280.000	Bonos internacionales del Estado de Pakistán	USD	8,875 %	08/04/2051	16.804.800	0,36
3.900.000	Pakistan Water & Power Development Authority	USD	7,500 %	04/06/2031	3.773.250	0,08
26.650.000	Third Pakistan International Sukuk Co., Ltd.	USD	5,625 %	05/12/2022	27.253.622	0,58
					74.264.928	1,59
Panamá	Acronyotto Internacional de Tenumes C.A.	1100	4.000.0/	44/00/00 ( 1	4 000 570	0.1
	Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.	USD	4,000 % 5.125 %	11/08/2041	4.992.570 14.810.084	0,11
	Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A. Autoridad del Canal de Panama	USD USD	5,125 %	11/08/2061		0,32 0,04
	Banco Latinoamericano de Comercio Exterior S.A.	USD	4,950 % 2,375 %	29/07/2035 14/09/2025	1.956.694 9.945.990	0,04
	Banco Nacional de Panama	USD	2,500 %	11/08/2030	6.671.440	0,2
	Bonos internacionales del Estado de Panamá	USD	4,500 %	16/04/2050	19.297.393	0,10
	Bonos internacionales del Estado de Panamá	USD	4,500 %	01/04/2056	1.879.680	0,04
	Bonos internacionales del Estado de Panamá	USD	3,870 %	23/07/2060	25.258.285	0,54
	Panamá Notas del Tesoro 144A(e)	USD	3,750 %	17/04/2026	11.810.238	0,25
					96.622.374	2,07
Papúa Nueva ( 7.160.000	Guinea Bonos internacionales del Estado de Papúa Nueva Guinea	USD	8,375 %	04/10/2028	7.231.600	0,15
Paraguay						,
	Bonos internacionales del Estado de Paraguay	USD	5,000 %	15/04/2026	20.916.682	0,4
6.446.000	Bonos internacionales del Estado de Paraguay	USD	4,700 %	27/03/2027	7.030.354	0,1
7.490.000	Bonos internacionales del Estado de Paraguay	USD	4,950 %	28/04/2031	8.255.572	0,18
8.137.000	Bonos internacionales del Estado de Paraguay	USD	2,739 %	29/01/2033	7.661.514	0,16
	Bonos internacionales del Estado de Paraguay	USD	6,100 %	11/08/2044	5.959.921	0,13
18.060.000	Bonos internacionales del Estado de Paraguay	USD	5,600 %	13/03/2048	20.167.737	0,43

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de patrimonie
Bonos – (con	iinuación)	,				
Paraguay - (co	ntinuación)					
	Bonos internacionales del Estado de Paraguay	USD	5,400 %	30/03/2050	13.187.870	0,2
496.000	Bonos internacionales del Estado de Paraguay 144A <sup>(e)</sup>	USD	5,000 %	15/04/2026	545.175	0,0
					83.724.825	1,7
Perú		'				
	ABY Transmision Sur S.A.	USD	6,875 %	30/04/2043	24.010.443	0,5
	ABY Transmision Sur S.A. 144A <sup>(e)</sup>	USD	6,875 %	30/04/2043	2.344.011	0,0
	Corp. Lindley S.A.	USD	4,625 %	12/04/2023	2.403.776	0,0
	Bonos internacionales del Estado de Perú	USD	2,783 %	23/01/2031	2.365.025	0,0
	Bonos internacionales del Estado de Perú	EUR	1,250 %	11/03/2033	2.875.349	0,0
	Bonos internacionales del Estado de Perú Bonos internacionales del Estado de Perú	USD USD	3,000 % 3,300 %	15/01/2034 11/03/2041	4.676.700 1.298.125	0,1 0,0
	Bonos internacionales del Estado de Perú	USD	2,780 %	01/12/2060	2.780.683	0,0
	Bonos internacionales del Estado de Perú	USD	3,230 %	28/07/2121	21.678.190	0,0
20.010.000	Bolloo Internacionales del Estado de 1 era	002		20/01/2121	64.432.302	1,3
FIIII					04.432.302	1,3
7.020.000	Bonos internacionales del Estado de Filipinas	USD	2,650 %	10/12/2045	6.476.564	0,1
	Bonos internacionales del Estado de Filipinas	USD	3,200 %	06/07/2046	2.909.050	0,0
	,		-,		9.385.614	0,2
Catar					0.000.011	0,2
	Qatar Energy	USD	2,250 %	12/07/2031	7.248.250	0,10
	Qatar Energy	USD	3,125 %	12/07/2041	27.734.245	0,5
11.490.000	Qatar Energy	USD	3,300 %	12/07/2051	11.798.794	0,2
2.580.000	Bonos internacionales del Estado de Catar	USD	4,625 %	02/06/2046	3.237.900	0,0
19.360.000	Bonos internacionales del Estado de Catar	USD	5,103 %	23/04/2048	25.857.700	0,5
25.170.000	Bonos internacionales del Estado de Catar	USD	4,817 %	14/03/2049	32.610.881	0,7
7.700.000	Bonos internacionales del Estado de Catar	USD	4,400 %	16/04/2050	9.446.937	0,2
6.180.000	Bonos internacionales del Estado de Catar 144A <sup>(e)</sup>	USD	5,103 %	23/04/2048	8.254.163	0,1
					126.188.870	2,7
Rumanía						
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,875 %	26/05/2028	6.392.473	0,14
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,875 %	11/03/2029	19.299.283	0,4
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR EUR	2,500 %	08/02/2030 26/05/2030	11.151.932 3.061.023	0,2 0,0
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	3,624 % 1,750 %	13/07/2030	5.589.145	0,0
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	USD	3,000 %	14/02/2031	9.381.250	0,1
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,124 %	16/07/2031	4.756.386	0,1
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,000 %	28/01/2032	4.628.691	0,1
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,000 %	14/04/2033	42.190.092	0,90
8.020.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,750 %	14/04/2041	8.190.192	0,1
7.350.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	3,375 %	28/01/2050	7.845.729	0,1
890.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	USD	4,000 %	14/02/2051	868.306	0,0
					123.354.502	2,6
Rusia			<u> </u>			
	Bonos extranjeros rusos – Eurobono	EUR	1,850 %	20/11/2032	17.131.024	0,3
	Bonos extranjeros rusos – Eurobono	USD	5,100 %	28/03/2035	72.734.200	1,5
	Bonos extranjeros rusos – Eurobono	EUR	2,650 %	27/05/2036	8.376.913	0,18
2.400.000	Bonos extranjeros rusos – Eurobono	USD	5,250 %	23/06/2047	3.042.600	0,00
		-			101.284.737	2,1
Arabia Saudí	Bonos internacionales del Estado saudí	Hen	4 E00 0/	26/10/2046	1 472 255	0.0
	Bonos internacionales del Estado saudí Bonos internacionales del Estado saudí	USD USD	4,500 % 4,625 %	26/10/2046 04/10/2047	1.473.255 17.189.738	0,0 0,3
	Bonos internacionales del Estado saudí  Bonos internacionales del Estado saudí	USD	4,625 % 5,000 %	17/04/2049	7.890.805	0,3
	Bonos internacionales del Estado saudí	USD	3,250 %	17/11/2051	5.038.165	0,1
	Bonos internacionales del Estado saudí	USD	3,750 %	21/01/2055	17.726.042	0,3
	Bonos internacionales del Estado saudí	USD	4,500 %	22/04/2060	39.809.000	0,8
					89.127.005	1,9
Senegal						<u> </u>
-	Bonos internacionales del Estado de Senegal	EUR	4,750 %	13/03/2028	22.728.139	0,4
13.080.000	Bonos internacionales del Estado de Senegal	EUR	5,375 %	08/06/2037	13.748.251	0,29
940.000	Bonos internacionales del Estado de Senegal	USD	6,750 %	13/03/2048	909.450	0,02

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de
Bonos – (conti		Divisa	interes	recha de vencimiento.	030	patrinonic
Serbia	muacion)					
10.340.000	Bonos internacionales de Serbia	EUR	1,000 %	23/09/2028	10.934.446	0,23
6.280.000	Bonos internacionales de Serbia	EUR	1,500 %	26/06/2029	6.761.620	0,15
					17.696.066	0,38
Singapur						
	ABJA Investment Co., Pte Ltd.	USD	5,450 %	24/01/2028	744.337	0,02
24.559	Innovate Capital Pte Ltd. – Serie MCB <sup>(d)</sup>	USD	6,000 %	11/12/2024	7.267	0,00
					751.604	0,02
Sudáfrica	Eskom Holdings SOC Ltd.	USD	6,750 %	06/08/2023	1.833.726	0,04
	Eskom Holdings SOC Ltd.	USD	7,125 %	11/02/2025	7.688.481	0,04
	Eskom Holdings SOC Ltd.	USD	6,350 %	10/08/2028	2.782.458	0,06
	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	4,875 %	14/04/2026	5.732.233	0,12
	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	4,850 %	27/09/2027	5.549.301	0,12
9.170.000	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	4,300 %	12/10/2028	9.127.612	0,20
16.480.000	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	4,850 %	30/09/2029	16.632.646	0,36
600.000	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	5,875 %	22/06/2030	645.197	0,01
16.340.000	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	5,650 %	27/09/2047	15.111.926	0,32
24.960.000	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	5,750 %	30/09/2049	23.174.486	0,50
					88.278.066	1,89
Sri Lanka						
	Bonos internacionales del Estado de Sri Lanka	USD	5,750 %	18/04/2023	7.382.103	0,16
	Bonos internacionales del Estado de Sri Lanka	USD	6,850 %	14/03/2024	5.372.417	0,11
	Bonos internacionales del Estado de Sri Lanka Bonos internacionales del Estado de Sri Lanka	USD USD	6,350 % 6,125 %	28/06/2024	3.297.837 2.833.243	0,07 0,06
	Bonos internacionales del Estado de Sri Lanka	USD	•	03/06/2025 03/11/2025	6.134.148	
	Bonos internacionales del Estado de Sri Lanka	USD	6,850 % 6,825 %	18/07/2026	12.892.436	0,13 0,28
	Bonos internacionales del Estado de Sri Lanka	USD	6,200 %	11/05/2027	2.843.856	0,06
	Bonos internacionales del Estado de Sri Lanka	USD	6,750 %	18/04/2028	3.054.394	0,07
	Bonos internacionales del Estado de Sri Lanka	USD	7,850 %	14/03/2029	193.346	0,00
	Bonos internacionales del Estado de Sri Lanka	USD	7,550 %	28/03/2030	5.419.347	0,12
					49.423.127	1,06
Supranacional	es					
	African Export-Import Bank	USD	2,634 %	17/05/2026	7.171.879	0,15
	African Export-Import Bank	USD	3,798 %	17/05/2031	7.794.177	0,17
	Black Sea Trade & Development Bank	USD	3,500 %	25/06/2024	37.075.194	0,79
56.250.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank	USD	4,875 %	23/05/2024	58.010.625	1,24
Tavildatés					110.051.875	2,35
<b>Tayikistán</b> 3.470.000	Bonos internacionales de Tayikistán	USD	7,125 %	14/09/2027	3.052.646	0,06
Tailandia	·					
	Bangkok Bank PCL(d)	USD	3,466 %	23/09/2036	1.279.398	0,03
6.700.000	GC Treasury Center Co., Ltd.	USD	2,980 %	18/03/2031	6.844.636	0,15
1.430.000	GC Treasury Center Co., Ltd.	USD	4,300 %	18/03/2051	1.618.653	0,03
10.860.000	PTT Treasury Center Co., Ltd.	USD	3,700 %	16/07/2070	11.226.742	0,24
					20.969.429	0,45
Trinidad y Toba	· •	1100	4.500.0/	00/00/0000	0.000.004	0.40
	Bonos internacionales del Estado de Trinidad y Tobago	USD	4,500 %	26/06/2030	6.292.391	0,13
<b>Túnez</b> 2 410 000	Bonos internacionales del Banco Central de Túnez	EUR	6,750 %	31/10/2023	2.245.192	0,05
	Bonos internacionales del Banco Central de Túnez	USD	5,750 %	30/01/2025	704.475	0,01
	Bonos internacionales del Banco Central de Túnez	EUR	6,375 %	15/07/2026	2.594.385	0,06
0.010.000	25.150(6.110.10.10.10.10.10.10.10.10.10.10.10.10	20.1		10/01/2020	5.544.052	0,12
Turquía						5,12
•	Akbank TAS	USD	6,800 %	06/02/2026	1.790.000	0,04
	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS	USD	5,125 %	22/06/2026	19.090.868	0,41
	TC Ziraat Bankasi AS	USD	5,125 %	03/05/2022	2.562.272	0,05
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	5,750 %	22/03/2024	8.103.428	0,17
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	6,350 %	10/08/2024	2.128.985	0,05
990.000	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	7,375 %	05/02/2025	1.017.369	0,02
9 970 000	Bonos internacionales del Estado de Turquía	EUR	4,625 %	31/03/2025	11.643.153	0,25
0.010.000	•					

			Tipo de	(b)	Valor de mercado en	% de
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	USD	patrimoni
Bonos – (con Turquía – (con	•					
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	4,750 %	26/01/2026	9.375.000	0,2
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	4,250 %	14/04/2026	15.377.096	0,3
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	6,000 %	25/03/2027	12.319.696	0,2
670.000	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	6,125 %	24/10/2028	637.667	0,0
10.910.000	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	5,250 %	13/03/2030	9.613.537	0,2
4.280.000	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	5,950 %	15/01/2031	3.878.750	0,0
6.220.000	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	5,875 %	26/06/2031	5.598.000	0,1
10.030.000	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	6,500 %	20/09/2033	9.240.137	0,2
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	6,000 %	14/01/2041	3.448.579	0,0
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	5,750 %	11/05/2047	46.568.041	1,0
	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO	USD	8,125 %	28/03/2024	9.213.244	0,2
	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO	USD	5,250 %	05/02/2025	7.164.672	0,1
21.570.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS <sup>(d)</sup>	USD	13,875 %	Perp.	23.727.000	0,5
Jcrania					217.025.551	4,6
	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	7,750 %	01/09/2022	10.806.390	0,2
16.980.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	7,750 %	01/09/2023	17.166.780	0,3
9.275.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	8,994 %	01/02/2024	9.543.975	0,2
47.340.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	7,750 %	01/09/2024	47.441.426	1,0
12.280.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	7,750 %	01/09/2025	12.310.700	0,2
520.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	EUR	6,750 %	20/06/2026	588.724	0,0
	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	7,750 %	01/09/2026	10.042.111	0,2
	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	7,750 %	01/09/2027	2.756.150	0,0
	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	9,750 %	01/11/2028	4.583.760	0,1
	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	6,876 %	21/05/2029	6.145.175	0,1
	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	EUR	4,375 %	27/01/2030	11.724.066	0,2
	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	7,253 %	15/03/2033	2.610.520	0,0
23.290.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania <sup>(d)</sup>	USD	0,000 %	31/05/2040	21.018.060	0,4
Emiratos Árab	os Unidos				156.737.837	3,3
	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC	USD	4,600 %	02/11/2047	31.824.000	0,6
	DP World Plc.	USD	5,625 %	25/09/2048	4.307.600	0,0
1.330.000	DP World Plc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	6,850 %	02/07/2037	1.750.616	0,0
7.960.000	Bonos internacionales del Estado del Emirato de Dubái	USD	3,900 %	09/09/2050	7.502.300	0,1
8.970.000	Finance Department Government of Sharjah	USD	3,625 %	10/03/2033	8.745.750	0,1
11.240.000	Finance Department Government of Sharjah	USD	4,000 %	28/07/2050	10.144.100	0,2
9.780.000	NBK Tier 1 Financing 2 Ltd. <sup>(d)</sup>	USD	4,500 %	Perp.	10.028.999	0,2
					74.303.365	1,5
4 080 000	Gazprom PJSC Via Gaz Finance Plc.	USD	3,250 %	25/02/2030	3.947.542	0,0
	Gazprom PJSC Via Gaz Finance Plc.(d)	USD	4,599 %	Perp.	14.767.275	0,3
	Vedanta Resources Finance II Plc.	USD	8,950 %	11/03/2025	3.217.313	0,0
	Vedanta Resources Finance II Plc.	USD	9,250 %	23/04/2026	2.118.250	0,0
	Vedanta Resources Ltd.	USD	6,125 %	09/08/2024	3.694.357	0,0
					27.744.737	0,5
Estados						
Unidos 8 756 448	Brazil Loan Trust 1	USD	5,477 %	24/07/2023	9.030.087	0,1
	Brazil Loan Trust 1  Brazil Loan Trust 1 144A <sup>(e)</sup>	USD	5,477 % 5,477 %	24/07/2023	1.111.452	0,1
	Kosmos Energy Ltd.	USD	5,477 % 7,750 %	01/05/2027	2.654.325	0,0
	Sasol Financing USA LLC	USD	7,750 % 5,875 %	27/03/2024	17.585.163	0,0
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	0,375 %	31/12/2025	67.552.883	1,4
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	0,750 %	31/01/2028	49.847.961	1,0
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	3,125 %	15/11/2028	20.725.781	0,4
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	2,375 %	15/11/2049	6.496.630	0,1
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	2,000 %	15/02/2050	6.236.250	0,1
					181.240.532	3,8
Uruguay 3.200.000	Bonos internacionales del Estado de Uruguay	USD	5,100 %	18/06/2050	4.136.024	0,0
Uzbekistán	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		-,:,			3,0
	National Bank of Uzbekistan	USD	4,850 %	21/10/2025	4.880.448	0,1
	Bonos internacionales de Uzbekistán	USD	5,375 %	20/02/2029	446.250	0,0
	Bonos internacionales de Uzbekistán	USD	3,700 %	25/11/2030	8.250.000	0,1

Tempor   Person						Valor de	
Serios   Communication   Co	Tenencias	Descripción del valor	Divisa		Fecha de vencimiento(b)		% del patrimonio
Name   Section		•					
44 2000 Petrilos of weinzules S.A. USD 6,000 % 1601/0502 B2 2194 540 0.02 22 22 22 22 22 22 22 23 23 23 23 23 23 2	•	and do sold					
ACCUPATION   Per Notices de Venezuelas   A.   USD   6,000 %   1511/2007   30,330   0.00   3,330   300 mois internacionales del Estado de Venezuela   USD   2,705 %   1204/307   33,330   0.00   3,230   300 mois internacionales del Estado de Venezuela   USD   7,750 %   2114/2007   335,00   0.00   3,200   3,000 mois internacionales del Estado de Venezuela   USD   7,750 %   2114/2007   35,200   0.00   3,000   3,000 mois internacionales del Estado de Venezuela   USD   3,000 %   1014/2005   12,000,50   0.00   3,000   3,000 mois internacionales del Estado de Zambia   USD   5,375 %   2009/2002   16,146,385   0.00   3,000   3,000 mois internacionales del Estado de Zambia   USD   5,375 %   2009/2002   16,146,385   0.00   3,000   3,000 mois internacionales del Estado de Zambia   USD   5,375 %   2009/2002   16,146,385   0.00   3,000   3,000 mois internacionales del Estado de Zambia   USD   5,375 %   2009/2002   16,146,385   0.00   3,000   3,000 mois internacionales del Estado de Zambia   USD   5,375 %   2009/2002   16,146,385   0.00   3,000   3,000 mois internacionales del Estado de Zambia   USD   5,375 %   2009/2002   16,146,385   0.00   3,000   3,000 mois internacionales del Estado de Zambia   USD   5,375 %   2009/2002   16,146,385   0.00   3,000   3,000 mois internacionales del Estado de Zambia   USD   5,375 %   2009/2002   17,863,305   0.00   3,000   3,000 mois internacionales del Estado de Zambia   USD   3,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   3,000   3,000 mois internacionales del Estado de Zambia   0.00 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %   2,000 %	564.690.000	Petroleos de Venezuela S.A.	USD	6,000 %	28/10/2022	22.587.600	0,48
1							0,05
\$\    \text{							
\$\text{\$\text{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$\cut{\$							
Victnam							•
Vertram	9.525.000	bolios illeritacionales dei Estado de Veriezdeia	03D	7,000 %	21/04/2023		
1.13   1.00   Ver Namn Debt & Asset Traiding Corp.   USD   1.00 %   1.00 10 / 10 / 10 / 10 / 10 / 10 / 10 /						35.929.433	0,77
Zambia         Lambia         USD 5,375 % 2009/2022 16.146.385 0.34 3.590.00 Bonos internacionales del Estado de Zambia         USD 5,375 % 2009/2022 16.146.385 20.00 0.34 3.590.00 Bonos internacionales del Estado de Zambia         USD 5,375 % 2009/2022 16.146.385 20.00 0.34 0.34 3.590.00 Bonos internacionales del Estado de Zambia         USD 1,146.385.240 2.2009/2022 18.385.220 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340 0.340		Viet Nam Deht & Asset Trading Corp	USD	1 000 %	10/10/2025	12 009 551	0.26
21673,000 Bonos internacionales del Estado de Zambia   USD   8.507 %   1404/02022   2708.675 % 0.04	-	Vict Nam Bobt a root mading oorp.		1,000 70	10/10/2020	12.000.001	0,20
\$2,550.000   \$0 noos intermacionales del Estado de Zambia   USD   8,500 %   14,044,202   27,06,875   0,06   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,0		Bonos internacionales del Estado de Zambia	USD	5.375 %	20/09/2022	16.146.385	0.34
TOTAL DE BIONS   134.869.349    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.240    18.893.24							
TOTAL DE BONS			_	-,			
Total Designation   Properties   Properti	TOTAL DE BOL	NOS				10.000.200	
Part						4.340.536.158	92,78
Total De						Valor de	
Fondos de Inversión - 0,25 %   Irlanda   Intra 11,788,352   Coldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución XI)   Intra 11,788,352   Coldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución XI)   Intra 11,788,352   Coldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución XI)   Intra 11,788,352   Coldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución XI)   Intra 11,788,352   Coldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución XI)   Intra 11,788,352   Coldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución XI)   Intra 11,788,352   Coldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución XI)   Intra 11,788,352   Coldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución XI)   Intra 11,788,352   Coldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de la financia funda	Tononcias	Descripción del valor					% del
### 1.788.35   Golman Sachs USS Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X) (7/10   1.788.35   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   1.788.35   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25   0.25	-	·				030	patrillollio
11.788.352 Goldman Sachs USS Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X) <sup>(filigia</sup> 11.788.352 Go.25 TOTAL DE FONDOS DE INVERSIÓN (coste USD 11.788.352) 11.788.352 0.25 TOTAL DE VALORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VALORES OFICIAL (coste USD 15.777.180) 11.788.352 324.510 33.03 Tipo de Coste USD 15.777.180 11.788.352 324.510 32.03 Tipo de Coste USD 15.777.180 11.788.352 324.350 32.03 Tipo de Coste USD 15.777.180 11.788.350 Tipo de Coste USD 15.777.180 11.7888.350 Tipo Tipo Tipo Tipo Tipo Tipo Tipo Tipo		version = 0,25 %					
Coste USD 11.788.352    11.788.352    12.80   11.788.352    11.788.352    12.80   11.788.352    12.80   11.788.352    12.80   11.788.352    12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80   12.80		Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones	de distribución X	)(f)(g)		11.788.352	0,25
TOTAL DE VALORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VALORES OFICIAL (coste USD 5.126.157.276)							
Coste USD 5.12€.157.276)   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03   33,03	<u> </u>	·				11.788.352	0,25
Tenencias   Descripción del valor   Divisa   Tipo de intervés   Pecha de vencimoto   Divisa			VALORES OFIC	IAL		4.352.324.510	93,03
Name							
Salas Caimán							
Stas Caimán	Tenencias	Descripción del valor	Divisa		Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	mercado en	% del patrimonio
1.970.000 NIO, Inc. 144A(e) 1.510.000 NIO, Inc. 144A(e) 1		<u> </u>	Divisa		Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	mercado en	
1.510.000 NIO, Inc. 144Ale) NIO, Inc. 144Ale)	Valores mobi	liarios negociados en otro mercado regulado	Divisa		Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	mercado en	
Reino Unido   216.950.000   Bonos internacionales del Estado de Egipto—HSBC Bank Plc. 144A(e)   EGP   0,000 %   23/12/2021   13.717.219   0,29     TOTAL DE BONOS (coste USD 16.777.180)   16.801.843   0,36     TOTAL DE VAL-ORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO (coste USD 16.777.180)   16.801.843   0,36     TOTAL DE VAL-ORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO (coste USD 16.777.180)   16.801.843   0,36     VALOR DE MERCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD 5.142.934.456)   4.369.126.353   93,39     Contratos de futuros - 0,33 %   Valor de mercado de la asignación en USD   U	Valores mobil Bonos – 0,36 Islas Caimán	liarios negociados en otro mercado regulado %		interés <sup>(a)</sup>		mercado en USD	patrimonio
Reino Unido   216.950.000   Bonos internacionales del Estado de Egipto—HSBC Bank Plc. 144A(e)   EGP   0,000 %   23/12/2021   13.717.219   0,29	Valores mobil Bonos – 0,36 Islas Caimán 1.970.000	liarios negociados en otro mercado regulado % NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	2,802 %	01/02/2026	mercado en USD 1.755.889	patrimonio
216.950.000 Bonos internacionales del Estado de Egipto—HSBC Bank Plc. 144A(e) EGP 0,000 % 23/12/2021 13.717.219 0,29  TOTAL DE BONOS (coste USD 16.777.180) 16.801.843 0,36  TOTAL DE VALORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO (coste USD 16.777.180) 16.801.843 0,36  VALOR DE MERCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD 5.142.934.456) 4.369.126.353 93,39  Contratos de futuros – 0,33 % Valor de mercado de la asignación en USD	Valores mobil Bonos – 0,36 Islas Caimán 1.970.000	liarios negociados en otro mercado regulado % NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	2,802 %	01/02/2026	mercado en USD 1.755.889	patrimonio
TOTAL DE BONOS (coste USD 16.777.180)   16.801.843   0,36	Valores mobil Bonos – 0,36 Islas Caimán 1.970.000	liarios negociados en otro mercado regulado % NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	2,802 %	01/02/2026	1.755.889 1.328.735	0,04 0,03
Coste USD 16.777.180    16.801.843   0,36	Valores mobil Bonos – 0,36 Islas Caimán 1.970.000 1.510.000	liarios negociados en otro mercado regulado % NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	2,802 % 0,500 %	01/02/2026	1.755.889 1.328.735 3.084.624	0,04 0,03
TOTAL DE VALORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO (coste USD 16.777.180)  7 ALOR DE MERCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD 5.142.934.456)  8 A.369.126.353  9 3,39  Contratos de futuros - 0,33 %    Valor de mercado de la asignación en USD   USD   USD	Valores mobil Bonos – 0,36 Islas Caimán 1.970.000 1.510.000	liarios negociados en otro mercado regulado %  NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD USD	2,802 % 0,500 %	01/02/2026 01/02/2027	1.755.889 1.328.735 3.084.624	0,04 0,03 0,07
(coste USD 16.777.180)         16.801.843         0,36           VALOR DE MERCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD 5.142.934.456)         4.369.126.353         93,39           Contratos de futuros - 0,33 %         Valor de mercado de la asignación en USD         Plusvalía latente en USD         % del patrimonio USD           EUR         6 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/2021         Larga         1.487.899         42.192         0,00           USD           1.189         Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022         Larga         192.580.844         4.688.721         0,10           1.757         Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022         Larga         230.276.813         3.670.953         0,08           901         Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022         Larga         197.340.118         582.417         0,01	Valores mobil Bonos - 0,36 Islas Caimán 1.970.000 1.510.000  Reino Unido 216.950.000  TOTAL DE BOI	liarios negociados en otro mercado regulado % NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> Bonos internacionales del Estado de Egipto—HSBC Bank Plc. 144A <sup>(e)</sup> NOS	USD USD	2,802 % 0,500 %	01/02/2026 01/02/2027	1.755.889 1.328.735 3.084.624	0,04 0,03 0,07
(coste USD 5.142.934.456)         4.369.126.353         93,39           Contratos de futuros – 0,33 %         Valor de mercado de la asignación en USD         Plusvalía latente en USD         % del patrimonio USD           EUR         6 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/2021         Larga         1.487.899         42.192         0,00           USD           1.189         Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022         Larga         192.580.844         4.688.721         0,10           1.757         Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022         Larga         230.276.813         3.670.953         0,08           901         Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022         Larga         197.340.118         582.417         0,01	Valores mobil Bonos – 0,36 Islas Caimán 1.970.000 1.510.000  Reino Unido 216.950.000  TOTAL DE BOI (coste USD 16.	liarios negociados en otro mercado regulado  %  NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> Bonos internacionales del Estado de Egipto—HSBC Bank Plc. 144A <sup>(e)</sup> NOS .777.180)	USD USD EGP	2,802 % 0,500 %	01/02/2026 01/02/2027	1.755.889 1.328.735 3.084.624	0,04 0,03 0,07
Contratos de futuros - 0,33 %           Número de contratos         Descripción del valor         Valor de mercado de la asignación en USD         Plusvalía latente en USD         % del patrimonio           EUR         6         Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/2021         Larga         1.487.899         42.192         0,00           1.189         Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022         Larga         192.580.844         4.688.721         0,10           1.757         Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022         Larga         230.276.813         3.670.953         0,08           901         Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022         Larga         197.340.118         582.417         0,01	Valores mobil Bonos - 0,36 Islas Caimán 1.970.000 1.510.000  Reino Unido 216.950.000  TOTAL DE BOI (coste USD 16.	liarios negociados en otro mercado regulado %  NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> Bonos internacionales del Estado de Egipto—HSBC Bank Plc. 144A <sup>(e)</sup> NOS 7.777.180)  CORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO	USD USD EGP	2,802 % 0,500 %	01/02/2026 01/02/2027	1.755.889 1.328.735 3.084.624 13.717.219	0,04 0,03 0,07
Número de contratos         Valor de mercado de la asignación en USD         Plusvalía latente en USD         % del patrimonio           EUR         6         Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/2021         Larga         1.487.899         42.192         0,00           USD         1.189         Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022         Larga         192.580.844         4.688.721         0,10           1.757         Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022         Larga         230.276.813         3.670.953         0,08           901         Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022         Larga         197.340.118         582.417         0,01	Valores mobil Bonos - 0,36 Islas Caimán 1.970.000 1.510.000  Reino Unido 216.950.000  TOTAL DE BOI (coste USD 16.  TOTAL DE VAL (coste USD 16.  VALOR DE ME	liarios negociados en otro mercado regulado %  NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> Bonos internacionales del Estado de Egipto—HSBC Bank Plc. 144A <sup>(e)</sup> NOS .777.180)  ORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO.777.180)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS	USD USD EGP	2,802 % 0,500 %	01/02/2026 01/02/2027	1.755.889 1.328.735 3.084.624 13.717.219 16.801.843	0,04 0,03 0,07 0,29 0,36
Número de contratos         Descripción del valor         de la asignación en USD         latente en USD         % del patrimonio           USD         USD         Larga         1.487.899         42.192         0,00           1.189         Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022         Larga         192.580.844         4.688.721         0,10           1.757         Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022         Larga         230.276.813         3.670.953         0,08           901         Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022         Larga         197.340.118         582.417         0,01	Valores mobil Bonos - 0,36 Islas Caimán 1.970.000 1.510.000  Reino Unido 216.950.000  TOTAL DE BOI (coste USD 16.  TOTAL DE VAL (coste USD 16.  VALOR DE ME	liarios negociados en otro mercado regulado %  NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> Bonos internacionales del Estado de Egipto—HSBC Bank Plc. 144A <sup>(e)</sup> NOS .777.180)  ORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO.777.180)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS	USD USD EGP	2,802 % 0,500 %	01/02/2026 01/02/2027	1.755.889 1.328.735 3.084.624 13.717.219 16.801.843	0,04 0,03 0,07 0,29 0,36
contratos         Descripción del valor         en USD         USD         patrimonio           USD         1.189 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/2021         Larga         1.487.899         42.192         0,00           1.189 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022         Larga         192.580.844         4.688.721         0,10           1.757 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022         Larga         230.276.813         3.670.953         0,08           901 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022         Larga         197.340.118         582.417         0,01	Valores mobil Bonos - 0,36 Islas Caimán 1.970.000 1.510.000  Reino Unido 216.950.000  TOTAL DE BOI (coste USD 16.  TOTAL DE VAL (coste USD 5.1	liarios negociados en otro mercado regulado %  NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> Bonos internacionales del Estado de Egipto—HSBC Bank Plc. 144A <sup>(e)</sup> NOS .777.180)  ORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO .777.180)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS 42.934.456)	USD USD EGP	2,802 % 0,500 %	01/02/2026 01/02/2027 23/12/2021	1.755.889 1.328.735 3.084.624 13.717.219 16.801.843 16.801.843	0,04 0,03 0,07 0,29 0,36
6 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/2021 Larga 1.487.899 42.192 0,00 USD  1.189 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Larga 192.580.844 4.688.721 0,10 1.757 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Larga 230.276.813 3.670.953 0,08 901 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022 Larga 197.340.118 582.417 0,01	Valores mobil Bonos – 0,36 Islas Caimán 1.970.000 1.510.000  Reino Unido 216.950.000  TOTAL DE BOI (coste USD 16.  VALOR DE ME (coste USD 5.1	liarios negociados en otro mercado regulado %  NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> Bonos internacionales del Estado de Egipto—HSBC Bank Plc. 144A <sup>(e)</sup> NOS .777.180)  ORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO .777.180)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS 42.934.456)	USD USD EGP	2,802 % 0,500 %	01/02/2026 01/02/2027 23/12/2021 Valor de mercado	1.755.889 1.328.735 3.084.624 13.717.219 16.801.843 16.801.843	0,04 0,03 0,07 0,29 0,36 0,36
6 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/2021 Larga 1.487.899 42.192 0,00  USD  1.189 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Larga 192.580.844 4.688.721 0,10 1.757 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Larga 230.276.813 3.670.953 0,08 901 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022 Larga 197.340.118 582.417 0,01	Valores mobil Bonos – 0,36 Islas Caimán 1.970.000 1.510.000  Reino Unido 216.950.000  TOTAL DE BOI (coste USD 16.  TOTAL DE VAL (coste USD 5.1  VALOR DE ME (coste USD 5.1	liarios negociados en otro mercado regulado %  NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> Bonos internacionales del Estado de Egipto—HSBC Bank Plc. 144A <sup>(e)</sup> NOS .777.180)  .ORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO .777.180)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS 42.934.456)	USD USD EGP	2,802 % 0,500 %	01/02/2026 01/02/2027 23/12/2021 Valor de mercado de la asignación	1.755.889 1.328.735 3.084.624 13.717.219 16.801.843 4.369.126.353	0,04 0,03 0,07 0,29 0,36
USD 1.189 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Larga 192.580.844 4.688.721 0,10 1.757 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Larga 230.276.813 3.670.953 0,08 901 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022 Larga 197.340.118 582.417 0,01	Valores mobil Bonos – 0,36 Islas Caimán 1.970.000 1.510.000  Reino Unido 216.950.000  TOTAL DE BOI (coste USD 16.  TOTAL DE VAL (coste USD 5.1  VALOR DE ME (coste USD 5.1	liarios negociados en otro mercado regulado %  NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> Bonos internacionales del Estado de Egipto—HSBC Bank Plc. 144A <sup>(e)</sup> NOS .777.180)  CORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO .777.180)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS 42.934.456)  turos – 0,33 %  Descripción del valor	USD USD EGP	2,802 % 0,500 %	01/02/2026 01/02/2027 23/12/2021 Valor de mercado de la asignación	1.755.889 1.328.735 3.084.624 13.717.219 16.801.843 4.369.126.353	0,04 0,03 0,07 0,29 0,36 93,39
1.189       Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022       Larga       192.580.844       4.688.721       0,10         1.757       Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022       Larga       230.276.813       3.670.953       0,08         901       Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022       Larga       197.340.118       582.417       0,01	Valores mobil Bonos – 0,36 Islas Caimán 1.970.000 1.510.000  Reino Unido 216.950.000  TOTAL DE BOI (coste USD 16.  TOTAL DE VAL (coste USD 5.1  Contratos de fut Número de contratos	liarios negociados en otro mercado regulado %  NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> Bonos internacionales del Estado de Egipto—HSBC Bank Plc. 144A <sup>(e)</sup> NOS .777.180) .ORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO .777.180) RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS 42.934.456) turos – 0,33 %  Descripción del valor EUR	USD USD EGP	2,802 % 0,500 %	01/02/2026 01/02/2027 23/12/2021 Valor de mercado de la asignación en USD	1.755.889 1.328.735 3.084.624 13.717.219 16.801.843 4.369.126.353	0,04 0,03 0,07 0,29 0,36 93,39
1.757       Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022       Larga       230.276.813       3.670.953       0,08         901       Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022       Larga       197.340.118       582.417       0,01	Valores mobil Bonos – 0,36 Islas Caimán 1.970.000 1.510.000  Reino Unido 216.950.000  TOTAL DE BOI (coste USD 16.  TOTAL DE VAL (coste USD 5.1  Contratos de fut Número de contratos	liarios negociados en otro mercado regulado % NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> Bonos internacionales del Estado de Egipto—HSBC Bank Plc. 144A <sup>(e)</sup> NOS .777.180) .ORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO .777.180) RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS 42.934.456) turos – 0,33 %  Descripción del valor EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/	USD USD EGP	2,802 % 0,500 %	01/02/2026 01/02/2027 23/12/2021 Valor de mercado de la asignación en USD	1.755.889 1.328.735 3.084.624 13.717.219 16.801.843 4.369.126.353	0,04 0,03 0,07 0,29 0,36 93,39 % del patrimonio
901 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022 Larga 197.340.118 582.417 0,01	Valores mobil Bonos – 0,36 Islas Caimán 1.970.000 1.510.000  Reino Unido 216.950.000  TOTAL DE BOI (coste USD 16.  VALOR DE ME (coste USD 5.1  Contratos de fut Número de contratos	liarios negociados en otro mercado regulado %  NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> Bonos internacionales del Estado de Egipto—HSBC Bank Plc. 144A <sup>(e)</sup> NOS .777.180)  CORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO .777.180)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS 42.934.456)  turos – 0,33 %  Descripción del valor  EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/	USD USD EGP	2,802 % 0,500 % 0,000 %	01/02/2026 01/02/2027 23/12/2021 Valor de mercado de la asignación en USD	1.755.889 1.328.735 3.084.624 13.717.219 16.801.843 16.801.843 4.369.126.353  Plusvalia latente en USD 42.192	0,04 0,03 0,07 0,29 0,36 93,39 % del patrimonio
	Valores mobil Bonos – 0,36 Islas Caimán 1.970.000 1.510.000  Reino Unido 216.950.000  TOTAL DE BOI (coste USD 16.  VALOR DE ME (coste USD 5.1  Contratos de fut  Número de contratos 6	liarios negociados en otro mercado regulado %  NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> Bonos internacionales del Estado de Egipto—HSBC Bank Plc. 144A <sup>(e)</sup> NOS .777.180) .ORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO .777.180) RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS 42.934.456) turos – 0,33 %  Descripción del valor EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/ USD Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022	USD USD EGP	2,802 % 0,500 % 0,000 % Larga	01/02/2026 01/02/2027 23/12/2021 Valor de mercado de la asignación en USD 1.487.899	1.755.889 1.328.735 3.084.624 13.717.219 16.801.843 16.801.843 4.369.126.353 Plusvalia latente en USD 42.192	0,04 0,03 0,07 0,29 0,36 93,39 % del patrimonio 0,00
	Valores mobil Bonos – 0,36 Islas Caimán 1.970.000 1.510.000  Reino Unido 216.950.000  TOTAL DE BOI (coste USD 16.  VALOR DE ME (coste USD 5.1  Contratos de fut  Número de contratos  6  1.189 1.757	liarios negociados en otro mercado regulado %  NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> Bonos internacionales del Estado de Egipto—HSBC Bank Plc. 144A <sup>(e)</sup> NOS .777.180)  ORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO .777.180)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS 42.934.456)  turos – 0,33 %  Descripción del valor  EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/ USD Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022	USD USD EGP	2,802 % 0,500 % 0,000 % Larga Larga	01/02/2026 01/02/2027 23/12/2021 Valor de mercado de la asignación en USD 1.487.899 192.580.844 230.276.813	1.755.889 1.328.735 3.084.624 13.717.219 16.801.843 16.801.843 4.369.126.353  Plusvalia latente en USD 42.192 4.688.721 3.670.953	0,04 0,03 0,07 0,29 0,36 93,39 % del patrimonio

Contratos	de futuros - (	(continuación)	)
-----------	----------------	----------------	---

Número de contratos	Descripción del valor		Compromiso Valor de mercado en USD	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
	USD – (continuación)				
618	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022	Larga	123.445.500	3.630.856	0,08
144	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022	Larga	21.165.750	437.141	0,01
			1.063.205.932	16.031.288	0,34
PLUSVALÍA LA	TENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS			16.073.480	0,34
Número de contratos	Descripción del valor		Valor de mercado de la asignación USD	Minusvalía latente USD	% del patrimonio
	EUR				
(366)	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/12/2021	Corta	(56.487.728)	(251.829)	(0,00)
	USD				
(18)	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022	Corta	(2.359.125)	(36.715)	(0,00)
(13)	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022	Corta	(2.847.305)	(10.059)	(0,00)
(31)	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022	Corta	(3.772.555)	(39.095)	(0,00)
(21)	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022	Corta	(4.194.750)	(144.867)	(0,01)
(25)	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022	Corta	(3.674.609)	(70.899)	(0,00)
		•	(16.848.344)	(301.635)	(0,01)
			(10.040.344)	(301.033)	(0,01)

#### Contratos de divisas a plazo – (0,32 %)

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	latente en USD	% del patrimonio
BRL	26.730.765	USD	4.768.659	02/12/2021	4.351	0,00
EUR	8.041.568	PLN	37.076.913	06/12/2021	122.478	0,00
USD	49.058.249	INR	3.666.186.991	07/12/2021	234.346	0,00
USD	1.891.134	TRY	24.017.215	10/12/2021	64.932	0,00
USD	1.926.400	ZAR	29.355.061	13/12/2021	88.433	0,00
USD	10.266.000	TRY	97.198.488	14/12/2021	2.889.039	0,06
CAD	38.434.884	EUR	25.818.085	15/12/2021	711.959	0,02
CHF	76.446.311	EUR	71.329.884	15/12/2021	2.299.431	0,05
CHF	31.078.062	USD	33.916.915	15/12/2021	28.029	0,00
CNH	715.662.528	USD	110.650.403	15/12/2021	1.615.194	0,03
EUR	4.108.533	CAD	5.918.855	15/12/2021	41.337	0,00
EUR	12.602.117	PLN	57.949.021	15/12/2021	242.727	0,00
EUR	12.640.450	SEK	127.574.988	15/12/2021	233.152	0,00
GBP	21.830.822	EUR	25.569.730	15/12/2021	63.287	0,00
ILS	15.183.007	EUR	4.182.791	15/12/2021	67.596	0,00
JPY	2.174.277.927	EUR	16.899.612	15/12/2021	75.829	0,00
USD	9.876.152	AUD	13.446.637	15/12/2021	244.409	0,01
USD	72.958.770	CAD	92.325.290	15/12/2021	649.704	0,01
USD	9.618.692	CZK	211.873.314	15/12/2021	185.667	0,00
USD	242.838.079	EUR	210.716.812	15/12/2021	2.967.088	0,09
USD	69.857.523	GBP	50.947.115	15/12/2021	1.780.996	0,04
USD	4.851.593	HUF	1.517.238.604	15/12/2021	134.086	0,00
USD	86.548.446	JPY	9.652.295.548	15/12/2021	809.267	0,02
USD	24.372.582	MXN	499.959.391	15/12/2021	986.724	0,03
USD	27.522.017	NOK	238.573.684	15/12/2021	1.154.183	0,04
USD	30.045.716	NZD	42.815.370	15/12/2021	770.541	0,01
USD	28.667.552	SEK	248.465.601	15/12/2021	1.096.887	0,02
USD	9.755.418	SGD	13.269.807	15/12/2021	25.630	0,00
USD	16.111.978	THB	538.792.736	15/12/2021	123.041	0,00
USD	47.440.702	TRY	433.637.569	15/12/2021	14.544.702	0,32
USD	28.984.208	ZAR	430.329.569	15/12/2021	2.048.428	0,04
USD	3.140.993	TRY	37.621.461	20/12/2021	293.621	0,00
USD	1.235.912	ILS	3.786.836	21/12/2021	31.017	0,00
USD	5.821.609	ILS	18.265.889	22/12/2021	9.400	0,00
ILS	42.180.638	USD	13.314.700	24/12/2021	108.877	0,00
USD	1.154.788	ILS	3.564.252	24/12/2021	20.499	0,00
TWD	563.259.507	USD	20.282.291	19/01/2022	141.942	0,00
USD	11.167.064	MXN	228.447.971	24/01/2022	562.480	0,00
USD	10.562.126	ILS	32.554.030	26/01/2022	190.531	0,00
	26.251.669	ILS	81.337.199	02/02/2022		0,00
USD USD	6.289.093	CLP	5.182.904.196	02/02/2022 07/02/2022	334.087 130.843	0,01
USD	22.967.420	KRW		10/02/2022		0,00
USD	22.907.420	VKM	27.210.837.359	10/02/2022	35.514	0,00

Plusvalía

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	latente en USD	% del patrimonio
USD	16.286.611	PLN	66.299.570	10/02/2022	218.145	0,01
USD	14.288.542	RUB	1.072.924.366	10/02/2022	31.209	0,00
USD	20.531.000	TRY	198.113.885	14/06/2022	6.927.407	0,15
PLUSVALÍA LAT PLAZO	TENTE SOBRE CONTRA	TOS DE DI	VISAS A		45.339.045	0,97

PLAZO					45.339.045	0,97
Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% de patrimonio
USD	4.884.244	BRL	27.654.589	02/12/2021	(53.723)	(0,00)
PLN	7.704.287	EUR	1.675.100	06/12/2021	(30.145)	(0,00
INR	3.822.925.566	USD	51.626.545	07/12/2021	(715.297)	(0,01
USD	26.090.152	ZAR	416.744.525	09/12/2021	(18.063)	(0,00
ZAR	489.517.401	USD	30.705.078	09/12/2021	(37.787)	(0,01
ZAR	150.473.622	USD	9.816.264	13/12/2021	(394.874)	(0,01
TRY	181.699.350	USD	20.531.000	14/12/2021	(6.740.774)	(0,14
AUD	13.556.486	NZD	14.214.247	15/12/2021	(8.620)	(0,00
AUD	52.360.533	USD	38.699.524	15/12/2021	(1.194.001)	(0,03
CAD	66.542.359	USD	53.173.712	15/12/2021	(1.057.808)	(0,01
CZK	319.644.299	EUR	12.591.964	15/12/2021	(102.949)	(0,00
CZK	547.189.117	USD	25.336.159	15/12/2021	(974.205)	(0,02
					, ,	
EUR	12.916.144	AUD	20.827.362	15/12/2021	(215.323)	(0,00)
EUR	8.570.581	CHF	9.273.711	15/12/2021	(372.809)	(0,01)
EUR	8.432.728	CZK	216.455.372	15/12/2021	(37.570)	(0,00)
EUR	4.207.839	GBP	3.611.251	15/12/2021	(35.401)	(0,00)
EUR	21.073.205	HUF	7.716.477.516	15/12/2021	(3.790)	(0,00)
EUR	16.710.196	JPY	2.194.989.005	15/12/2021	(475.425)	(0,01)
EUR	624.407.242	USD	728.457.448	15/12/2021	(17.658.994)	(0,41)
GBP	25.196.187	USD	34.140.259	15/12/2021	(472.624)	(0,01)
HUF	6.063.969.471	EUR	16.959.946	15/12/2021	(451.948)	(0,01)
HUF	1.632.318.530	USD	5.498.503	15/12/2021	(423.181)	(0,01)
JPY	7.821.079.602	USD	70.525.217	15/12/2021	(1.052.319)	(0,03)
MXN	530.868.228	USD	25.927.858	15/12/2021	(1.096.222)	(0,01)
NOK	268.572.684	EUR	26.221.599	15/12/2021	(166.137)	(0,00)
NOK	45.166.270	USD	5.228.273	15/12/2021	(236.370)	(0,01)
NZD	29.937.605	USD	21.303.433	15/12/2021	(833.479)	(0,02)
PLN	77.168.172	EUR	16.779.023	15/12/2021	(320.195)	(0,00)
PLN	130.640.841	USD	34.192.057	15/12/2021	(2.398.151)	(0,05)
SEK	84.360.207	EUR	8.419.930	15/12/2021	(223.966)	(0,00)
SEK	170.032.621	USD	19.120.602	15/12/2021	(253.152)	(0,01)
SGD	12.977.871	USD	9.624.966	15/12/2021	(109.234)	(0,00)
THB	326.084.450	USD	9.692.062	15/12/2021	(15.347)	(0,00)
TRY	208.009.687	USD	21.415.365	15/12/2021	(5.635.630)	(0,13)
USD	61.705.460	CHF	56.697.195	15/12/2021	(221.926)	(0,00)
USD	71.932.309	CNH	464.900.230	15/12/2021	(996.341)	(0,01
USD	5.383.387	ILS	17.245.945	15/12/2021	(101.856)	(0,00
ZAR	559.724.011	USD	37.405.696	15/12/2021	(2.370.682)	(0,07
ILS	31.828.127	USD	10.177.422	22/12/2021	(49.708)	(0,00
INR	457.964.593	USD	6.093.819	27/12/2021	(4.331)	(0,00)
USD	58.302.255	TWD	1.614.250.274	19/01/2022	(231.731)	(0,00)
MXN	123.392.924	USD	5.910.457	24/01/2022	(182.542)	(0,00)
ZAR	59.413.364	USD	3.850.725	03/02/2022	(156.959)	(0,00)
CLP	7.846.767.596	USD	9.722.074	07/02/2022	(398.660)	(0,01)
IDR	138.461.073.741	USD	9.618.024	10/02/2022	(14.486)	(0,00
RUB	1.753.512.849	USD	24.264.130	10/02/2022	(962.938)	(0,02)
USD	899.039.169	EUR	795.455.017	10/02/2022	(8.130.530)	(0,17)
TRY	107.618.478	USD	10.266.000	14/06/2022	(2.876.321)	(0,06)
	LATENTE SOBRE CONTR			00/2022	(60.514.524)	(1,29)

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones – 0,18 %

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
USD	4.908.866	GBP	3.659.700	21/01/2022	15.468	0,00
USD	2.484.541	SGD	3.384.925	07/02/2022	3.191	0,00
EUR	1.360.594.914	USD	1.537.787.231	10/02/2022	13.891.309	0,30
USD	150.134	HKD	1.170.060	10/02/2022	38	0,00
JPY	8.489.872.197	USD	74.595.909	16/02/2022	888.593	0,02
PLUSVALÍA LA	ATENTE SOBRE CONTRA	ATOS DE D	IVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA		14.798.599	0,32

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones – (continuación)

					Fecha de	Minusvalía latente	% de
Divisa	Compra	Divisa	Venta		vencimiento	USD	patrimon
GBP	142.369.172	USD	195.693.303		21/01/2022	(5.330.944)	(0,1
CHF	38.714.635	USD	42.431.363		25/01/2022	(76.652)	(0,0
JSD	2.554.888	CHF	2.362.006		25/01/2022	(29.203)	(0,0
SGD	67.316.108	USD	49.876.629		07/02/2022	(529.943)	(0,0
HKD	39.474.140	USD	5.066.628		10/02/2022	(2.848)	(0,00
PLN	15.794.048	USD	3.879.829		10/02/2022	(51.960)	(0,00
USD	40.354.098		35.747.553		10/02/2022	(413.885)	(0,00
USD	166.659		696.288		10/02/2022	(2.093)	(0,00
USD	1.567.032		178.562.413		16/02/2022	(20.589)	(0,00
			S A PLAZO CELEBRADOS CON F	FINES DE COBERTURA		(6.458.117)	(0,14
Opciones –	0,01 %	-					
					Plusvalía/ (minusvalía)	Valor de	
Tononcias	Descripción del valor				latente USD	mercado en USD	% de
Tenencias	Opciones adquiridas				030	090	patrimoni
	EUR						
16.751.000	Put EUR / Call PLN		Vence 02/12/2021	Precio de ejercicio 4,56	(43.747)	19	0,0
16.751.000	Put EUR / Call PLN		Vence 02/12/2021	Precio de ejercicio 4,56	(50.585)	19	0,0
134.147.000	Put EUR / Call USD		Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,12	(234.241)	193.546	0,0
147.059.000	Put EUR / Call USD		Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,12	(452.721)	151.435	0,0
134.541.000	Put EUR / Call USD		Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	(79.024)	487.584	0,0
	Put EUR / Call USD		Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,14	244.060	764.047	0,0
				•	(616.258)	1.596.650	0,0
	USD						
38.046.000	Call USD / Put ILS		Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 3,11	644.461	783.748	0,0
37.923.000	Call USD / Put ILS		Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 3,13	390.986	540.403	0,0
38.042.000	Call USD / Put ILS		Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 3,14	366.801	518.588	0,0
74.763.000	Call USD / Put INR		Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 75,26	155.881	361.479	0,0
28.977.000	Call USD / Put ZAR		Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 15,90	84.903	327.730	0,0
	Call USD / Put ZAR		Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 16,15	(132.786)	277.440	0,0
				•	1.510.246	2.809.388	0,0
TOTAL DE OI (coste USD 3	PCIONES ADQUIRIDAS .512.050)					4.406.038	0,0
	Opciones suscritas						
	EUR						
(67.074.000)	Put EUR / Call USD		Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	174.442	(243.080)	(0,00
(67.227.000)	Put EUR / Call USD		Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	392.728	(243.634)	(0,01
(67.271.000)	Put EUR / Call USD		Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,14	16.830	(381.038)	(0,01
					584.000	(867.752)	(0,02
	USD				-		
(19.023.000)	Call USD / Put ILS		Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 3,06	(471.257)	(627.854)	(0,01
(18.962.000)	Call USD / Put ILS		Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 3,08	(344.710)	(514.231)	(0,01
(19.021.000)	Call USD / Put ILS		Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 3,09	(331.954)	(509.420)	(0,01
(37.381.000)	Call USD / Put INR		Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 74,72	(136.142)	(329.476)	(0,01
	Call USD / Put TRY		Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 12,30	(675.877)	(782.172)	(0,01
. ,	Call USD / Put ZAR		Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 15,90	36.908	(322.697)	(0,01
					(1.923.032)	(3.085.850)	(0,06
	PCIONES SUSCRITAS					(2.052.602)	(0.09
(coste USD (2						(3.953.602)	(0,08
(coste USD 8						452.436	0,0
Contratos d	e permutas financieras -	<b>-</b> 0,11 %				Plusvalía	
Importe teóric local neto	o A pagar		A recibir	Divisa Fe	echa de vencimiento	latente en USD	% de patrimoni
	Permutas de tipos de	e interés		217104 1 6			Paumom
547.430.	000 Fijo 5,800 %		Variable (BRCDI a 1	mes en BRL) BRL	02/01/2023	4.146.918	0,0
	000 Variable (BRCDI a 1 m	nes en RRI \	Fijo 12,400 %	BRL	02/01/2023	79.700	0,0
	000 Variable (BRCDI a 1 m	,	Fijo 12,400 % Fijo 12,300 %	BRL	02/01/2024	411.167	0,0
	510 Fijo 6,320 %	ica eli DIAL)	•				
			· ·	•			0,1 0,0
	000 Fijo 8,495 %		Variable (BRCDI a 1 Variable (BRCDI a 1	•	02/01/2025 04/01/2027	7.193.549 1.025.799	

#### Contratos de permutas financieras – (continuación)

Importe teórico						Plusvalía latente en	% del
local neto	A pagar		A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	USD	patrimonio
	Permutas de tipos de interés - (continu	ıación)					
252.720.000	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)		Fijo 11,230 %	BRL	04/01/2027	321.019	0,01
2.093.370.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)		Fijo 2,500 %	CNY	15/09/2023	573.040	0,01
537.490.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)		Fijo 2,750 %	CNY	15/09/2026	577.742	0,01
	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)		Fijo 2,500 %	CNY	15/12/2026	47.817	0,00
72.210.000			Variable (LIBOR a 6 meses en				
	Fijo 0,000 %		EUR)	EUR	15/12/2024	354.274	0,01
23.650.398			Variable (LIBOR a 6 meses en				
	Fijo 0,000 %		EUR)	EUR	15/12/2026	208.836	0,00
118.970.000	Fijo 0,000 %		Variable (EURIBOR a 6 meses	EUD	45/40/2020	1 057 064	0.00
97 220 000	Fiio 0 000 %		en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses	EUR	15/12/2028	1.257.064	0,03
67.320.000	Fijo 0,000 %		en EUR)	EUR	15/12/2031	1.099.304	0,02
29 520 000	Fijo 0,250 %		Variable (EURIBOR a 6 meses	LOIX	10/12/2001	1.000.004	0,02
20.020.000	1 10 0,200 /0		en EUR)	EUR	15/12/2036	226.489	0,01
373.803.330.000	Fijo 1,500 %		Variable (LIBOR a 3 meses en				
	•		KRW)	KRW	16/03/2024	998.503	0,02
2.760.090.000	Fijo 6,200 %		Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	13/12/2023	2.078.376	0,04
804.555.000	Fijo 6,700 %		Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	09/12/2026	977.658	0,02
22.725.000	Fijo 1,700 %		Variable (WIBOR a 6 meses en				
			PLN)	PLN	15/12/2026	302.773	0,01
15.000.000	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)		Fijo 1,750 %	USD	15/12/2031	270.868	0,01
368.325.000	Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)		Fijo 7,400 %	ZAR	15/12/2031	448.439	0,01
PLUSVALÍA LATE	NTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE	INTERÉS				22.599.335	0,48
	Permutas de incumplimiento crediticio	(CDS)					
41 910 000	Variable (Bonos internacionales del Estad	. ,	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2023	610.304	0,01
41.310.000	de Filipinas)	· ·	1 130 1,000 70	OOD	20/12/2023	010.304	0,01
20.720.000	Variable (Bonos internacionales del Estad	0	Fijo 5,000 %	USD	20/12/2023	786.524	0,02
	de Ucrania)						
	Variable (Bonos internacionales del Estad	,	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2024	225.081	0,01
	Variable (Bonos internacionales del Estad	,	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2024	1.116.281	0,02
19.730.000	Variable (Bonos internacionales del Estad Dabi)	o de Abu	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	111.410	0,00
6 370 000	Variable (Bonos internacionales del Estad	o de Porú)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	2.930	0,00
	,		•				-
12.110.000	Variable (Bonos internacionales del Estad de Filipinas)	0	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	278.922	0,01
61.100.000	Variable (Bonos internacionales del Estad	o de Catar)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	551.871	0,01
18.960.000	Variable (Bonos internacionales del Estad	0	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2025	62.356	0,00
	de Filipinas)						
13.840.000	Variable (Bonos internacionales del Estad	o de Catar)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2025	198.730	0,00
20.730.000	Variable (Bonos extranjeros rusos - Eurol	ono)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2025	13.437	0,00
55.230.000	Variable (Bonos internacionales del Estad	0	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	833.021	0,02
	de Indonesia)						
4.400.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Panamá)		Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	14.350	0,00
1.000.000	Variable (Bonos internacionales del Estad	o de Catar)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	4.065	0,00
	Variable (Bonos extranjeros rusos – Eurol	,	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	8.524	0,00
	Variable (Bonos internacionales del Estad	,	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	443.350	0,01
CREDITICIO (CDS	ENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLI S)	WIENTO				5.261.156	0,11
TOTAL DE PLUS	VALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS D	E					
PERMUTAS FINA	NCIERAS					27.860.491	0,59
						Minusvalía	
Importe teórico						latente	% del
local neto	A pagar	A recibir		Divisa	Fecha de vencimiento	USD	patrimonio
	Permutas de tipos de interés						
	0 Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 10,56		BRL	02/01/2023	(81.964)	(0,00)
	0 Variable (LIBOR a 1 mes en BRL)	Fijo 7,200		BRL	02/01/2023	(3.821.808)	(80,0)
34.925.00	0 Fijo 11,814 %	,	BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(26.181)	(0,00)
	0 Fijo 11,905 %	,	BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(29.718)	(0,00)
47.450.00	0 Fijo 12,185 %	Variable (	BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(78.769)	(0,00)
159.060.00	0 Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 4,930	%	BRL	02/01/2024	(2.533.077)	(0,06)
557.025.00	0 Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 7,370	%	BRL	02/01/2024	(5.915.697)	(0,13)
411.480.60	0 Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 9,200	%	BRL	02/01/2024	(979.811)	(0,02)
19.800.81	3 Fijo 0,000 %	Variable (	LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2023	(23.370)	(0,00)
19.070.00	0 Fijo 0,500 %	Variable (	EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2041	(110.171)	(0,00)
5.460.00	0 Fijo 0,250 %	Variable (	EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2051	(156.667)	(0,00)
71.694.490.00	0 Fijo 1,750 %	Variable (	KWCDC a 3 meses en KRW)	KRW	15/09/2031	(1.559.197)	(0,03)
		,	,				,

#### Contratos de permutas financieras – (continuación)

Importe teórico	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% del
						<b>P</b>
	Permutas de tipos de interés -					
531.190.000	(continuación)	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	03/12/2031	(544.298)	(0,01)
1.184.070.000	•	Variable (VIBOR a 3 meses en PLN)	PLN	16/12/2021	(543.675)	(0,01)
	Fijo 1,750 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2023	(6.493)	(0,00)
135.925.000		Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2031	(180.923)	(0,01)
2.475.734.599	•	Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	ZAR	15/12/2023	(465.911)	(0,01)
MINUSVALÍA LATE DE INTERÉS	NTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS				(17.057.730)	(0,36
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)					
12.020.000	Fijo 0,000 %	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2021	(1.703)	(0,00
25.870.000	Fijo 1,000 %	Variable (Bonos internacionales del				
44 700 000	Fijo 1,000 %	Estado de China) Variable (Bonos internacionales del	USD	20/12/2021	(13.935)	(0,00
44.700.000	1 10 1,000 /6	Estado de China)	USD	20/12/2021	(20.493)	(0,00)
8.430.000	Fijo 1,000 %	Variable (Bonos internacionales del Estado de China)	USD	20/06/2022	(31.669)	(0,00)
17 830 000	Variable (Bonos internacionales del	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2024	(84.698)	(0,00)
17.630.000	Estado de Chile)	Fijo 1,000 %	USD	20/00/2024	(64.096)	(0,00
18.020.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Colombia)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2024	(263.567)	(0,01)
78.010.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Chile)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	(326.845)	(0,01)
3.650.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Ucrania)	Fijo 5,000 %	USD	20/12/2024	(227.216)	(0,00)
2.940.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Argentina)	Fijo 5,000 %	USD	20/12/2025	(1.045.491)	(0,02)
1.160.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Colombia)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	(40.149)	(0,00)
56.010.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Indonesia)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(375.427)	(0,01)
109.030.000	Variable (iTraxx Asia ex-Japan IG Serie 36 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(58.878)	(0,00)
77.330.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de México)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(865.111)	(0,02
18.060.000	Variable (Bonos extranjeros rusos – Eurobono)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(261.651)	(0,01)
125.660.000	Variable (The Markit CDX Emerging Markets 36 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(1.934.673)	(0,04
MINUSVALÍA LATE INCUMPLIMIENTO	NTE SOBRE PERMUTAS DE CREDITICIO (CDS)				(5.551.506)	(0,12
TOTAL DE MINUSV	ALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS					
DE PERMUTAS FIN	IANCIERAS DO DE LAS INVERSIONES				(22.609.236)	(0,48)
(coste USD 5.143.8					4.383.515.063	93,70
OTROS ACTIVOS Y	PASIVOS				294.563.395	6,30
PATRIMONIO					4.678.078.458	100,00
TOTAL DE INIVERS	IONES				Valor de mercado en	% de
TOTAL DE INVERS					USD	patrimonio
	cluyendo derivados (coste USD 5.142.9 ore contratos de futuros	34.456)			4.369.126.353 16.073.480	93,39 0,34
	obre contratos de futuros				(553.464)	(0,01
	obre contratos de luturos ore contratos de divisas a plazo				45.339.045	0,01
	obre contratos de divisas a plazo				(60.514.524)	(1,29
	ore contratos de divisas a plazo celebra	dos con fines de cobertura			14.798.599	0,32
	obre contratos de divisas a plazo celebr				(6.458.117)	(0,14
	e opciones compradas (coste USD 3.51				4.406.038	0,09
	e opciones suscritas (coste USD (2.614.	•			(3.953.602)	(0,08
	ore contratos de permutas financieras				27.860.491	0,59
Minusvalía latente s	obre contratos de permutas financieras				(22.609.236)	(0,48
Otros activos y pasiv	vos				294.563.395	6,30
Patrimonio					4.678.078.458	100,00

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Australia & New Zealand Banking Group Ltd., Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Credit Suisse International, Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Natwest Markets Plc., Royal Bank of Canada, Standard Chartered Bank, State Street Bank & Trust y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Barclays Bank Plc., HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc. y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Barclays Bank Plc., Barclays Capital, Inc., Deutsche Bank AG, JP Morgan Chase Bank N.A. y Morgan Stanley & Co. International Plc.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,72 %.

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (C) Este título tiene un cupón escalonado que pasará al segundo tipo en una fecha determinada del futuro.
- (d) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (e) 144A. La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (f) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- (g) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

Tenencias		Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de
		Descripción del valor	Divisa	Interes	recna de vencimiento(*)	020	patrimoni
		rios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial					
Bonos – 9	,	/6					
Azerbaiyán							
510	10.000	Bonos internacionales de Azerbaiyán	USD	4,750 %	18/03/2024	540.750	1,04
Bahamas							
280	30.000	Intercorp Peru Ltd.	USD	3,875 %	15/08/2029	270.339	0,52
Bermudas							
540	10.000	China Oil & Gas Group Ltd.	USD	5,500 %	25/01/2023	544.050	1,0
620	20.000	Credicorp Ltd.	USD	2,750 %	17/06/2025	628.320	1,22
26	34.000	Geopark Ltd.	USD	6,500 %	21/09/2024	270.546	0,52
						1.442.916	2,79
						2.0.10	_,
Brasil		B00A B 3B B B	1100	4 405 0/	00/00/0004	070 000	0.70
		B3 S.A Brasil Bolsa Balcao	USD	4,125 %	20/09/2031	372.200	0,72
020	20.000	Embraer S.A.	USD	5,150 %	15/06/2022	629.860	1,21
						1.002.060	1,93
Islas Virger	nes Br	ritánicas					
		Fortune Star BVI Ltd.	USD	5,950 %	29/01/2023	211.050	0,41
200	00.000	Fortune Star BVI Ltd.	USD	6,750 %	02/07/2023	203.500	0,39
440	10.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.	USD	5,125 %	15/05/2024	470.047	0,91
200	00.000	Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	USD	3,750 %	29/05/2024	199.000	0,38
200	00.000	Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	4,875 %	22/11/2026	203.500	0,39
						1.287.097	2,48
Canadá	20.000	MEClahal Canada III C	HCD	F 000 %	10/05/2025	622.766	1.00
	30.000	MEGlobal Canada ULC	USD	5,000 %	18/05/2025	633.766	1,22
Islas Caimá	án						
300	00.000	DP World Salaam <sup>(c)</sup>	USD	6,000 %	Perp.	323.953	0,63
1.200	00.000	Grupo Aval Ltd.	USD	4,750 %	26/09/2022	1.223.681	2,36
200	00.000	IHS Holding Ltd.	USD	5,625 %	29/11/2026	199.750	0,39
		IHS Holding Ltd.	USD	6,250 %	29/11/2028	199.500	0,39
		Industrial Senior Trust	USD	5,500 %	01/11/2022	1.105.669	2,13
		Lamar Funding Ltd.	USD	3,958 %	07/05/2025	532.915	1,03
		Mumtalakat Sukuk Holding Co.	USD	5,625 %	27/02/2024	421.783	0,81
		NagaCorp Ltd.	USD	7,950 %	06/07/2024	309.378	0,60
		NIO, Inc.	USD	0,500 %	01/02/2027	291.955	0,56
210	10.000	Wynn Macau Ltd.	USD	5,500 %	15/01/2026	197.400	0,38
						4.805.984	9,28
Chile							
360	30.000	Inversiones CMPC S.A.	USD	3,000 %	06/04/2031	347.634	0,67
0-1							
Colombia	20 000	Panca Pilhaa Vizacya Argentaria Colombia S. A	USD	4,875 %	21/04/2025	862.407	1.67
		Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Colombia S.A. Banco de Bogota S.A.	USD	5,375 %	19/02/2023	534.950	1,67 1,03
		Banco de Bogota S.A.	USD	6,250 %	12/05/2026	326.625	0,63
		Bancolombia S.A.	USD	3,000 %	29/01/2025	369.558	0,71
			_	-,,,,,,			
						2.093.540	4,04
Chipre							
580	30.000	MHP S.E.	USD	7,750 %	10/05/2024	597.256	1,15
República I	Domin	icana					
480	30.000	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI S.A.	USD	6,750 %	30/03/2029	504.990	0,98
670	70.000	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	5,500 %	27/01/2025	725.275	1,40
						4 000 005	
						1.230.265	2,38
Guatemala							
		Bonos del Estado de Guatemala	USD	5,750 %	06/06/2022	612.130	1,18
340	10.000	Bonos del Estado de Guatemala	USD	4,500 %	03/05/2026	359.587	0,70
						971.717	1,88
India							
	50 000	Adani Green Energy IID Ltd. Via Provetna Davidenara Did Ltd. Vi-	USD	6 250 0/	40/40/0004		
551	0.000	Adani Green Energy UP Ltd. Via Prayatna Developers Pvt Ltd. Via Parampujya Solar Energy Pvt Ltd.	บอบ	6,250 %	10/12/2024	593.869	1,14
250	50.000	Reliance Industries Ltd.	USD	5,400 %	14/02/2022	252.224	0,49
				-, ,-			1,63
						846.093	1,03

Tenencias		Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de
Bonos -		<u> </u>	Divisu	Interes	Techa de Venemiento		putililoili
Indonesi	•						
		Perusahaan Gas Negara Tbk PT	USD	5,125 %	16/05/2024	217.248	0,4
1.	070.000	Tower Bersama Infrastructure Tbk PT	USD	4,250 %	21/01/2025	1.116.272	2,1
Isla de M	lan					1.333.520	2,5
		AngloGold Ashanti Holdings Plc.	USD	3,375 %	01/11/2028	504.900	0,9
Israel							
		Leviathan Bond Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,750 %	30/06/2023	861.294	1,6
	120.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	EUR	3,750 %	09/05/2027	134.659	0,2
Costa de	Marfil					995.953	1,9
		Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	USD	5,375 %	23/07/2024	261.098	0,5
Japón							
-	500.000	SoftBank Group Corp.	USD	4,000 %	06/07/2026	486.250	0,94
Luxembu	-	Altice Financing S.A.	EUR	2,250 %	15/01/2025	832.822	1,61
		GTC Aurora Luxembourg S.A.	EUR	2,250 % 2,250 %	23/06/2026	472.672	0,9
		Hidrovias International Finance SARL	USD	5,950 %	24/01/2025	633.984	1,2
			_	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		1.939.478	3,74
Mauricio							
		HTA Group Ltd.	USD	7,000 %	18/12/2025	640.683	1,24
	520.000	MTN Mauritius Investments Ltd.	USD	4,755 %	11/11/2024	536.895	1,00
						1.177.578	2,27
México	310.000	Banco Santander Mexico S.A. Institucion de Banca Multiple Grupo					
		Financiero Santander	USD	5,375 %	17/04/2025	338.287	0,68
		BBVA Bancomer S.A.	USD	1,875 %	18/09/2025	878.352	1,70
		Cemex SAB de CV <sup>(c)</sup>	USD	5,125 %	Perp.	649.200	1,25
		CIBANCO S.A. Institucion de Banca Multiple Trust CIB GCC SAB de CV	USD USD	4,375 % 5,250 %	22/07/2031 23/06/2024	470.857 923.598	0,9 <sup>2</sup> 1,78
		Grupo Bimbo SAB de CV <sup>(c)</sup>	USD	5,950 %	Perp.	697.193	1,35
			_			3.957.487	7,64
Marrueco							
		Bonos internacionales del Estado de Marruecos	EUR	1,375 %	30/03/2026	328.698	0,64
Países B	-	Bharti Airtel International Netherlands BV	USD	5,350 %	20/05/2024	574.256	1,1
		Lukoil International Finance BV	USD	4,750 %	02/11/2026	629.723	1,22
		Metinvest BV	USD	7,750 %	23/04/2023	296.441	0,57
		Metinvest BV	USD	8,500 %	23/04/2026	201.497	0,39
	580.000	NE Property BV	EUR	1,750 %	23/11/2024	678.412	1,31
	117.403	OCI NV	EUR	3,125 %	01/11/2024	135.647	0,26
		Syngenta Finance NV	USD	4,441 %	24/04/2023	207.762	0,40
	800.000	VEON Holdings BV	USD	3,375 %	25/11/2027	784.000	1,5
 Nigeria						3.507.738	6,77
-	450.000	Access Bank Plc.	USD	6,125 %	21/09/2026	447.187	0,86
		SEPLAT Energy Plc.	USD	7,750 %	01/04/2026	1.155.750	2,23
1.	020.000	United Bank for Africa Plc.	USD	7,750 %	08/06/2022	1.046.714	2,02
						2.649.651	5,1
Omán	270.000	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	4.750 %	15/06/2026	273.544	0,53
Pakistán				.,			-,-,-
:	200.000	Bonos internacionales del Estado de Pakistán	USD	6,000 %	08/04/2026	198.000	0,38
Panamá							
		Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.	USD	4,000 %	11/08/2041	213.097	0,4
		Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.	USD	5,125 %	11/08/2061	424.922	0,82
		Banco Latinoamericano de Comercio Exterior S.A.	USD	2,375 %	14/09/2025	810.264	1,57
	520.000	Multibank, Inc.	USD	4,375 %	09/11/2022	528.605	1,02
						1.976.888	3,82

T	Provident for delivering	Distan	Tipo de	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en	% de
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento	USD	patrimonio
Bonos – (contir Paraguay	nuacion)					
	Banco Continental SAECA	USD	2,750 %	10/12/2025	863.475	1,67
610.000	Telefonica Celular del Paraguay S.A.	USD	5,875 %	15/04/2027	632.613	1,22
					1.496.088	2,89
Perú						
	Cementos Pacasmayo SAA	USD	4,500 %	08/02/2023	427.081	0,83
	InRetail Consumer	USD	3,250 %	22/03/2028	540.650	1,04
470.000	SAN Miguel Industrias Pet S.A. Via NG PET R&P Latin America S.A.	USD	3,500 %	02/08/2028	459.896	0,89
					1.427.627	2,70
Sudáfrica 600 000	Bidvest Group Ltd.	USD	3,625 %	23/09/2026	597.000	1,15
	Growthpoint Properties International Pty Ltd.	USD	5,872 %	02/05/2023	684.602	1,32
	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	4,665 %	17/01/2024	230.789	0,45
	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	5,875 %	16/09/2025	275.572	0,53
					1.787.963	3,45
Supranacionales						
•	African Export-Import Bank	USD	3,994 %	21/09/2029	537.243	1,04
690.000	ATP Tower Holdings LLC Via Andean Tower Partners Colombia SAS Via Andean Telecom Partners	USD	4,050 %	27/04/2026	683.590	1,32
330.000	Black Sea Trade & Development Bank	USD	3,500 %	25/06/2024	346.203	0,67
540.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank	USD	5,375 %	14/03/2022	542.344	1,04
200.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank	USD	4,875 %	23/05/2024	206.260	0,40
					2.315.640	4,47
Turquía						
	Akbank TAS	USD	5,000 %	24/10/2022	362.700	0,70
	Anadolu Efes Biracilik ve Malt Sanayii AS	USD	3,375 %	29/06/2028	197.000	0,38
	Mersin Uluslararasi Liman Isletmeciligi AS	USD	5,375 %	15/11/2024 22/03/2024	376.614	0,73
	Bonos internacionales del Estado de Turquía Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD USD	5,750 % 6,350 %	10/08/2024	200.184 201.799	0,39 0,39
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	4,250 %	13/03/2025	311.245	0,60
	Turkiye Garanti Bankasi AS	USD	5,875 %	16/03/2023	235.105	0,45
	Yapi ve Kredi Bankasi AS	USD	5,850 %	21/06/2024	348.589	0,67
					2.233.236	4,31
Ucrania						
	onos internacionales del Estado de Ucrania	USD	7,750 %	01/09/2023	323.520	0,62
480.000 B	lonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	7,750 %	01/09/2024	481.028	0,93
					804.548	1,55
Emiratos Árabes	Unidos					
480.000 N	IBK Tier 1 Financing Ltd. <sup>(c)</sup>	USD	3,625 %	Perp.	475.500	0,92
Reino Unido	indexes Minim Die	HOD	F 000 0/	4.4/4.0/0000	400.000	0.00
	indeavour Mining Plc.	USD	5,000 %	14/10/2026	199.000	0,38
Estados Unidos 366 757 B	Brazil Loan Trust 1	USD	5,477 %	24/07/2023	378.218	0,73
	Genting New York LLC Via GENNY Capital, Inc.	USD	3,300 %	15/02/2026	198.496	0,78
	Cosmos Energy Ltd.	USD	7,125 %	04/04/2026	515.700	1,00
	fercadoLibre, Inc.	USD	2,375 %	14/01/2026	482.500	0,93
					1.574.914	3,04
Uzbekistán						
	poteka-Bank ATIB	USD	5,500 %	19/11/2025	530.172	1,02
	lational Bank of Uzbekistan	USD	4,850 %	21/10/2025	508.380	0,98
480.000 U	Izbek Industrial and Construction Bank ATB	USD	5,750 %	02/12/2024	491.843	0,95
					1.530.395	2,95
TOTAL DE BONO					40 505 444	
(coste USD 49.24	+r.20U)				49.505.111	95,54

Tenencias	Descripción del valor					Valor de mercado en USD	% de patrimonio
Fondos de in	nversión – 1,06 %						
	6 Goldman Sachs US\$ Trea	sury Liquid Rese	erves Fund (Clase de acciones de distribución X) <sup>(e)(f)</sup>			547.526	1,06
TOTAL DE FO	NDOS DE INVERSIÓN 17.526)					547.526	1,06
		MITIDOS A COT	IZACIÓN EN UNA BOLSA DE VALORES OFICIAL				
	ERCADO DE LAS INVERSI	ONES EXCLUY	ENDO DERIVADOS			50.052.637	96,60
Contratos de	9.794.776) futuros – (0,32 %)					50.052.637	96,6
Contratos de	iuturos – (0,32 %)				Compromiso Valor de mercado	Plusvalía	
Número de contratos	Descripción del valor				en USD	latente USD	% de patrimonio
	EUR						
(10	) Futuros sobre bonos de la USD	República Fede	eral de Alemania a 5 años 08/12/2021	Corta	(1.543.381)	2.048	0,00
47	Futuros sobre pagarés del	l Tesoro de EE. l	JU. a 2 años 31/03/2022	Larga	10.294.102	35.706	0,07
PLUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRA	TOS DE FUTUR	os			37.754	0,07
Número de contratos	Descripción del valor				Compromiso Valor de mercado en USD	Plusvalía latente USD	% de patrimonio
	EUR						
(6		a República Fede	eral de Alemania a 2 años 08/12/2021	Corta	(767.674)	(1.058)	(0,00
(4	USD	Facero de CC III	L a large place 22/02/2022	Conto	(161.060)	(2.075)	(0.01
	<ul> <li>) Futuros sobre bonos del 1</li> <li>i) Futuros sobre pagarés de</li> </ul>			Corta Corta	(161.969) (3.407.625)	(3.875) (53.033)	(0,01 (0,10
	) Futuros sobre pagarés de			Corta	(12.047.836)	(124.850)	(0,24
(2	) Futuros sobre bonos del 1	Tesoro de EE. Ul	J. a muy largo plazo	Corta			
	22/03/2022				(399.500)	(13.797)	(0,03
(2	) Futuros sobre pagarés de	l Tesoro de EE.	UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022	Corta	(293.968)	(5.672)	(0,01
MINUSVALÍA	LATENTE SOBRE CONTRA	ATOS DE FUTUI	ROS		(10.310.696)	(202.285)	(0,39
	divisas a plazo – (0,04 %)					(======)	(4,52
						Plusvalía	
Divisa	Compra	Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	latente USD	% del patrimonio
USD	2.629.954	EUR	2.326.940		10/02/2022	(23.784)	(0,04
-	LATENTE SOBRE CONTRA					(23.784)	(0,04
Contratos de	divisas a piazo especificos	s de una ciase d	de acciones – 0,30 %				
Divisa	Compra	Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
EUR	14.830.381	USD	16.744.760		10/02/2022	168.419	0,33
PLUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRA	TOS DE DIVISA	S A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBER	TURA		168.419	0,33
_					Fecha de	Plusvalía latente	
Divisa	Compra	Divisa	Venta		vencimiento	USD	% del patrimonio
GBP USD	333.512 112.641	USD EUR	458.943 100.020		21/01/2022 10/02/2022	(13.004) (1.426)	(0,02 (0,01
			AS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBEI	RTURA	. 5. 52. 2522	(14.430)	(0,03)
VALOR DE MI	ERCADO DE LAS INVERSI		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·				
OTROS ACTIV	9.794.776) /OS Y PASIVOS					50.018.311 1.795.782	96,54
PATRIMONIO	TOO I PAOIVOS					51.814.093	100,00
AIRIMONIO						51.014.033	100,00

TOTAL DE INVERSIONES	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Total inversiones excluyendo derivados (coste USD 49.794.776)	50.052.637	96,60
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	37.754	0,07
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(202.285)	(0,39)
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	(23.784)	(0,04)
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	168.419	0,33
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	(14.430)	(0,03)
Otros activos y pasivos	1.795.782	3,46
Patrimonio	51.814.093	100,00

El Comisionista de futuros fue Morgan Stanley & Co., Inc.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Australia & New Zealand Banking Group Ltd., Barclays Bank Plc., Deutsche Bank AG, Royal Bank of Canada, State Street Bank & Trust y UBS AG.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,17 %.

<sup>(</sup>a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.

<sup>(</sup>b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.

<sup>(</sup>c) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.

<sup>(</sup>d) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.

<sup>(</sup>e) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

<sup>(</sup>f) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

Tenencias		Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado EUR	% del
Bonos –		admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial					
Austria							
		Raiffeisen Bank International AG Volksbank Wien AG	EUR EUR	6,000 % 0,875 %	16/10/2023 23/03/2026	554.855 1.509.630	0,14 0,37
	1.000.000	Tomosaliii. Thom/te	-	0,0.0 70	20/00/2020	2.064.485	0,51
						2.004.403	0,51
Bélgica	1.500.000	KBC Group NV	EUR	0,750 %	01/03/2022	1.504.695	0,37
		KBC Group NV	EUR	0,625 %	10/04/2025	1.321.177	0,32
			-			2.825.872	0,69
Islas Vírge	enes Británio	cas	-				
		Fortune Star BVI Ltd.	EUR	4,350 %	06/05/2023	543.898	0,13
	1.900.000	Global Switch Holdings Ltd.	EUR	1,500 %	31/01/2024	1.932.699	0,48
			_			2.476.597	0,61
Bulgaria							
•	670.000	Bonos internacionales del Estado de Bulgaria	EUR	2,000 %	26/03/2022	675.732	0,17
Canadá							
	2.525.000	Canadian Imperial Bank of Commerce	EUR	0,375 %	03/05/2024	2.548.457	0,63
Dinamarca	а						
	1.625.000	Danske Bank A/S	EUR	1,625 %	15/03/2024	1.684.459	0,42
	975.000	Danske Bank A/S <sup>(c)</sup>	EUR	0,500 %	27/08/2025	981.708	0,24
		Jyske Bank A/S	EUR	0,875 %	03/12/2021	700.000	0,17
		Nykredit Realkredit AS	EUR	0,500 %	19/01/2022	2.903.393	0,71
		Nykredit Realkredit AS <sup>(c)</sup> Nykredit Realkredit AS	EUR EUR	12,190 % 0,250 %	02/06/2022 20/01/2023	751.642 1.305.551	0,19 0,32
	1.300.000	Nykieuit Kealkieuit Ao	LOIN -	0,230 /0	20/01/2023		
						8.326.753	2,05
Finlandia	700.000	Nokia OYJ	EUR	2,375 %	15/05/2025	733.863	0,18
Francia							
Tancia	0.400.000	11804	EUD	0.075.0/	10/07/0000	0.447.440	0.50
	2.400.000 1.900.000		EUR EUR	0,375 % 0,375 %	18/07/2023 19/10/2023	2.417.448 1.918.620	0,59 0,47
		Altice France S.A.	EUR	2,500 %	15/01/2025	342.328	0,47
		Banijay Entertainment SASU	EUR	3,500 %	01/03/2025	971.724	0,24
		Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.	EUR	3,000 %	21/05/2024	695.155	0,17
	650.000	BNP Paribas S.A.	GBP	5,750 %	24/01/2022	768.637	0,19
		BNP Paribas S.A.	EUR	1,125 %	22/11/2023	1.356.893	0,33
		BNP Paribas S.A.	EUR	0,076 %	27/06/2024	1.023.970	0,25
		BPCE S.A.	EUR	1,125 %	18/01/2023	1.522.920	0,37
		BPCE S.A. Capgemini S.E.	EUR EUR	4,625 % 1,250 %	18/07/2023 15/04/2022	644.028 2.210.054	0,16 0,54
		Constellium S.E.	EUR	4,250 %	15/02/2026	378.098	0,09
		Crédit Agricole S.A.(c)	EUR	1,319 %	17/01/2022	800.560	0,20
		Crédit Agricole S.A.(c)	EUR	0,252 %	20/04/2022	501.455	0,12
	1.200.000	Crédit Agricole S.A.	GBP	7,375 %	18/12/2023	1.576.299	0,39
		Crédit Agricole S.A.	EUR	3,000 %	22/12/2024	834.497	0,21
		Crown European Holdings S.A.	EUR	3,375 %	15/05/2025	744.166	0,18
		Elis S.A. Faurecia S.E.	EUR	1,000 %	03/04/2025	794.332	0,20
		Indigo Group SAS	EUR EUR	2,750 % 2,125 %	15/02/2027 16/04/2025	1.398.894 739.970	0,34 0,18
		Loxam SAS	EUR	3,500 %	03/05/2023	626.781	0,15
		Loxam SAS	EUR	3,250 %	14/01/2025	550.924	0,14
	350.000	Loxam SAS	EUR	2,875 %	15/04/2026	345.317	0,09
		Nexans S.A.	EUR	3,750 %	08/08/2023	835.720	0,21
		Pernod Ricard S.A.	EUR	(0,184 %)	24/10/2023	4.820.016	1,19
		PSA Banque France S.A.	EUR	0,141 %	22/01/2025	1.593.280	0,39
		Renault S.A. Rubis Terminal Infra SAS	EUR EUR	2,375 % 5,625 %	25/05/2026 15/05/2025	603.054 567.388	0,15 0,14
		Société Générale S.A.	EUR	1,000 %	01/04/2022	2.712.771	0,14
		Société Générale S.A.	EUR	0,500 %	13/01/2023	1.310.023	0,32
		Société Générale S.A.	GBP	1,875 %	03/10/2024	830.664	0,20
		Sodexo S.A.	EUR	0,500 %	17/01/2024	2.406.255	0,59
	1.000.000		EUR	3,125 %	22/03/2024	1.042.130	0,26
	3.900.000	Thales S.A.	EUR _	0,750 %	23/01/2025	3.978.468	0,98
						43.862.839	10,78

Tenencias		Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado EUR	% de patrimoni
•	ontinuació	n)					
Alemania	300 000	ADLER Real Estate AG	EUR	1,500 %	06/12/2021	297.080	0,07
		Commerzbank AG	EUR	0,500 %	06/12/2021	1.300.143	0,32
		Commerzbank AG	EUR	1,500 %	21/09/2022	253.630	0,00
		Commerzbank AG	EUR	0,500 %	13/09/2023	857.438	0,2
		Commerzbank AG	EUR	0,100 %	11/09/2025	947.026	0,2
		E.ON S.E.	EUR	(0,319 %)	24/10/2022	1.454.292	0,3
		IHO Verwaltungs GmbH	EUR	3,625 %	15/05/2025	1.524.540	0,3
	2.500.000	Infineon Technologies AG	EUR	0,750 %	24/06/2023	2.532.600	0,6
	950.000	Nidda Healthcare Holding GmbH	EUR	3,500 %	30/09/2024	945.649	0,2
	1.550.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH	EUR	2,000 %	15/07/2025	1.531.198	0,3
	3.850.000	Volkswagen Bank GmbH	EUR	0,750 %	15/06/2023	3.896.161	0,9
	1.700.000	Vonovia S.E.	EUR	0,240 %	01/12/2025	1.685.142	0,4
						17.224.899	4,2
Guernsey	3.400.000	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	EUR	1,250 %	14/04/2022	3.420.230	0,8
Hong Kong							
Indonesia	210.000	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	EUR	1,750 %	14/06/2022	211.634	0,0
	2.980.000	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	EUR	2,625 %	14/06/2023	3.094.574	0,7
Irlanda	1 750 000	Abbott Ireland Financing DAC	EUR	0.875 %	27/09/2023	1.786.225	0,4
		Abbott Ireland Financing DAC		-,			0,4
		AIB Group Plc.	EUR	1,500 %	29/03/2023	2.731.496	
		AIB Group Plc.	EUR	1,250 %	28/05/2024	822.152	0,2
		AIB Group Plc.	EUR	2,250 %	03/07/2025	614.813	0,1
		Bank of Ireland Group Plc.(c)	EUR	0,750 %	08/07/2024	3.740.996	0,9
	1.150.000	Dell Bank International DAC	EUR	0,625 %	17/10/2022	1.158.568	0,2
	975.000	Dell Bank International DAC	EUR	1,625 %	24/06/2024	1.012.011	0,2
	725.000	Fresenius Finance Ireland Plc.	EUR	1,500 %	30/01/2024	746.641	0,1
						12.612.902	3,1
Isla de Man		Playtech Plc.	EUR	3,750 %	12/10/2023	1.568.802	0,3
Italia							
	725.000	Banco BPM SpA	EUR	1,750 %	28/01/2025	741.603	0,1
	1.150.000	FCA Bank SpA	EUR	0,250 %	28/02/2023	1.154.910	0,2
	625.000	FCA Bank SpA	EUR	0,125 %	16/11/2023	626.125	0,
	475.000	FCA Bank SpA	EUR	0,113 %	16/04/2024	473.993	0,
		Ferrovie dello Stato Italiane SpA	EUR	3,500 %	13/12/2021	400.468	0,1
		Intesa Sanpaolo SpA <sup>(c)</sup>	EUR	0,402 %	19/04/2022	3.812.540	0,9
		Intesa Sanpaolo SpA	EUR	1,000 %	04/07/2024	843.224	0,2
		Buoni poliennali del Tesoro Italia	EUR	1,000 %	15/07/2022	827.675	0,2
,							
4		Buoni poliennali del Tesoro Italia	EUR	(0,134 %)	15/08/2024	22.991.403	5,6
		Leasys SpA	EUR	(0,014 %)	22/07/2024	950.751	0,2
	1.525.000	•	EUR	1,625 %	30/04/2026	1.483.253	0,3
		Telecom Italia SpA	EUR	4,000 %	11/04/2024	1.018.412	0,2
		UniCredit SpA	EUR	6,950 %	31/10/2022	824.964	0,2
		UniCredit SpA	EUR	1,000 %	18/01/2023	833.844	0,2
	950.000	UniCredit SpA <sup>(c)</sup>	EUR	1,250 %	25/06/2025	973.588	0,2
Costa de M	Marfil					37.956.753	9,3
Costa de M		Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	EUR	5,125 %	15/06/2025	37.956.753 583.628	
	540.000					583.628	0,1
	540.000 1.425.000	Asahi Group Holdings Ltd.	EUR	0,010 %	19/04/2024	583.628 1.427.138	0,1
	540.000 1.425.000 3.225.000	Asahi Group Holdings Ltd. NTT Finance Corp.	EUR EUR	0,010 % 0,010 %	19/04/2024 03/03/2025	583.628 1.427.138 3.224.290	0,1 0,3 0,7
	540.000 1.425.000 3.225.000	Asahi Group Holdings Ltd.	EUR	0,010 %	19/04/2024	583.628 1.427.138 3.224.290 797.095	0,1 0,3 0,7 0,2
Japón	540.000 1.425.000 3.225.000	Asahi Group Holdings Ltd. NTT Finance Corp.	EUR EUR	0,010 % 0,010 %	19/04/2024 03/03/2025	583.628 1.427.138 3.224.290	0,1 0,3 0,7 0,2
Japón	540.000 1.425.000 3.225.000 775.000	Asahi Group Holdings Ltd. NTT Finance Corp.	EUR EUR	0,010 % 0,010 %	19/04/2024 03/03/2025	583.628 1.427.138 3.224.290 797.095	9,3 0,1 0,3 0,7 0,2 1,3
Costa de M Japón Jersey Kazajistán	540.000 1.425.000 3.225.000 775.000 925.000	Asahi Group Holdings Ltd. NTT Finance Corp. SoftBank Group Corp.	EUR EUR EUR	0,010 % 0,010 % 4,000 %	19/04/2024 03/03/2025 20/04/2023	583.628 1.427.138 3.224.290 797.095 5.448.523	0,1 0,3 0,7 0,2 1,3
Japón Jersey	540.000 1.425.000 3.225.000 775.000 925.000 400.000	Asahi Group Holdings Ltd. NTT Finance Corp. SoftBank Group Corp.  Adient Global Holdings Ltd.	EUR EUR EUR EUR	0,010 % 0,010 % 4,000 %	19/04/2024 03/03/2025 20/04/2023 15/08/2024	583.628 1.427.138 3.224.290 797.095 5.448.523 933.825	0,1 0,3 0,7 0,2 1,3
Japón Jersey Kazajistán	540.000 1.425.000 3.225.000 775.000 925.000 400.000 go	Asahi Group Holdings Ltd. NTT Finance Corp. SoftBank Group Corp.  Adient Global Holdings Ltd.	EUR EUR EUR EUR	0,010 % 0,010 % 4,000 %	19/04/2024 03/03/2025 20/04/2023 15/08/2024	583.628 1.427.138 3.224.290 797.095 5.448.523 933.825	0,1 0,5 0,7 0,2 1,3

Tenencias		Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado EUR	% del patrimonio
Bonos –	(continuac	ión)					
Luxembu	rgo – (contir						
		Becton Dickinson Euro Finance SARL	EUR	0,632 %	04/06/2023	1.566.771	0,38
		Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR	1,400 %	06/07/2022	1.709.452	0,42
		Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR	0,500 %	12/09/2023	2.163.674	0,53
		Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR	2,000 %	15/02/2024	1.009.105	0,25
		Lincoln Financing SARL	EUR	3,625 %	01/04/2024	1.531.100	0,38
		Logicor Financing SARL	EUR	1,500 %	14/11/2022	2.858.702	0,70
		Logicor Financing SARL	EUR	2,250 %	13/05/2025	954.189	0,23
		Medtronic Global Holdings S.C.A.	EUR	0,375 %	07/03/2023	1.915.105	0,47
	575.000	SIG Combibloc PurchaseCo SARL	EUR	2,125 %	18/06/2025	602.037	0,15
México						15.956.340	3,92
	2.680.000	Bonos internacionales del Estado de México	EUR	1,375 %	15/01/2025	2.769.110	0,68
Países Ba	ajos						
	2.125.000	ABN AMRO Bank NV	EUR	7,125 %	06/07/2022	2.215.908	0,54
		Airbus S.E.	EUR	1,625 %	07/04/2025	734.545	0,18
		Bunge Finance Europe BV	EUR	1,850 %	16/06/2023	3.356.810	0,83
		Cooperatieve Rabobank UA	EUR	4,125 %	14/09/2022	2.070.040	0,51
		Cooperatieve Rabobank UA Daimler International Finance BV	USD	3,950 %	09/11/2022 09/04/2024	1.176.106	0,29
		E.ON International Finance BV	EUR EUR	0,875 % 0,750 %	30/11/2022	765.885 1.461.977	0,19 0,36
		Enel Finance International NV	EUR		17/06/2024	600.210	0,30
		Heimstaden Bostad Treasury BV	EUR	0,007 % 0,250 %	13/10/2024	1.027.983	0,15
		ING Groep NV	EUR	0,750 %	09/03/2022	3.009.930	0,74
		ING Groep NV	USD	3,150 %	29/03/2022	576.462	0,14
		Intertrust Group BV	EUR	3,375 %	15/11/2025	1.016.710	0,25
		LeasePlan Corp. NV	EUR	0,750 %	03/10/2022	352.975	0,09
		Novo Nordisk Finance Netherlands BV	EUR	(0,176 %)	04/06/2024	1.281.005	0,31
	925.000	OI European Group BV	EUR	3,125 %	15/11/2024	947.524	0,23
	700.000	PACCAR Financial Europe BV	EUR	(0,234 %)	03/03/2023	702.170	0,17
		Q-Park Holding I BV	EUR	1,500 %	01/03/2025	577.386	0,14
		RELX Finance BV	EUR	(0,076 %)	18/03/2024	400.876	0,10
		Signify NV	EUR	2,000 %	11/05/2024	4.742.601	1,17
		Stellantis NV	EUR	3,375 %	07/07/2023	1.151.084	0,28
		Thermo Fisher Scientific Finance I BV	EUR EUR	0,070 %	18/11/2025 01/07/2024	1.072.925 731.880	0,26 0,18
		United Group BV United Group BV	EUR	4,875 % 3,125 %	15/02/2026	240.345	0,16
		Upjohn Finance BV	EUR	0,816 %	23/06/2022	1.559.393	0,38
		Vonovia Finance BV	EUR	0,875 %	10/06/2022	1.409.548	0,35
		Vonovia Finance BV	EUR	0,125 %	06/04/2023	702.919	0,17
	600.000	Wintershall Dea Finance BV	EUR	0,452 %	25/09/2023	604.464	0,15
	1.000.000	ZF Europe Finance BV	EUR	2,000 %	23/02/2026	1.000.380	0,25
						35.490.041	8,72
Macedoni	1.740.000	Bonos internacionales del Estado de Macedonia del Norte	EUR	5,625 %	26/07/2023	1.866.146	0,46
Noruega	205.222			0.005.0/	45/44/0005	0.44.400	0.00
 Rumanía	925.000	Adevinta ASA	EUR	2,625 %	15/11/2025	941.123	0,23
Kumama	4.190.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,750 %	29/10/2025	4.515.772	1,11
España							
	1.500.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	EUR	0,750 %	11/09/2022	1.513.200	0,37
		Banco de Sabadell S.A.	EUR	0,875 %	05/03/2023	1.415.092	0,35
	300.000	Banco de Sabadell S.A.	EUR	5,625 %	06/05/2026	344.001	0,09
		Banco Santander S.A.	EUR	1,375 %	09/02/2022	2.207.832	0,54
		Banco Santander S.A.	EUR	1,125 %	17/01/2025	1.645.056	0,40
		CaixaBank S.A.	EUR	1,125 %	12/01/2023	2.734.668	0,67
		CaixaBank S.A.	EUR	1,750 %	24/10/2023	618.750	0,07
		CaixaBank S.A.	EUR	2,375 %	01/02/2024	1.990.554	0,49
		Bonos del Estado de España	EUR	0,350 %	30/07/2023	6.024.999	1,48
	1.290.000	Bonos del Estado de España 144A <sup>(d)</sup>	EUR .	2,750 %	31/10/2024	1.415.478	0,35
Succia						19.909.630	4,89
Suecia	1.525.000	Intrum AB	EUR	3,125 %	15/07/2024	1.526.067	0,37
		Svenska Handelsbanken AB(c)	EUR	1,250 %	02/03/2028	1.623.328	0,40
		Verisure Holding AB	EUR	3,500 %	15/05/2023	504.650	0,12
		Verisure Holding AB <sup>(c)</sup>	EUR	4,751 %	15/04/2025	202.687	0,05
	200.000	10.00.0 Floriding / LD	LOIN	7,751 /0	13/04/2023	202.007	0,00

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado EUR	% del patrimonio
Bonos – (continuació Suecia – (continuació						
•	Verisure Holding AB	EUR	3,875 %	15/07/2026	815.728	0,20
	Volvo Treasury AB	EUR	0,125 %	17/09/2024	754.110	0,19
	•	-			5.426.570	1,33
Suiza	UPO O	5110	4.750.0/	40/44/0000		
	UBS Group AG	EUR	1,750 %	16/11/2022	2.551.925	0,63
1.300.000	UBS Group AG	EUR -	2,125 %	04/03/2024	1.362.933	0,33
Reino Unido					3.914.858	0,96
	Barclays Plc. <sup>(c)</sup>	EUR	0,625 %	14/11/2023	1.006.870	0,25
	Barclays Plc.(c)	EUR	3,375 %	02/04/2025	2.871.024	0,71
2.400.000	Diageo Finance Plc.	EUR	0,125 %	12/10/2023	2.414.664	0,59
	Lloyds Banking Group Plc.(c)	EUR	0,625 %	15/01/2024	302.157	0,07
	NatWest Group Plc.	EUR	2,500 %	22/03/2023	1.654.640	0,41
	NatWest Group Plc.(c)	EUR	2,000 %	04/03/2025	962.648	0,24
	NatWest Markets Plc.	EUR	0,625 %	02/03/2022	1.754.917	0,43
	Santander UK Plc.	EUR	1,125 %	14/01/2022	4.508.865	1,11
	Smiths Group Plc.	EUR	1,250 %	28/04/2023	990.083	0,24
	Tritax EuroBox Plc. Virgin Money UK Plc. (c)	EUR EUR	0,950 % 0,375 %	02/06/2026	276.818 703.507	0,07 0,17
	Vodafone Group Plc.	EUR	1,125 %	27/05/2024 20/11/2025	727.363	0,17
		-			18.173.556	4,47
Estados Unidos	AbbVie, Inc.	EUR	1,500 %	15/11/2023	1.961.503	0,48
	American International Group, Inc.	EUR	1,500 %	08/06/2023	3.037.594	0,46
	American Tower Corp.	USD	3,500 %	31/01/2023	1.224.402	0,30
	AT&T, Inc.	EUR	2,650 %	17/12/2021	700.889	0,17
	AT&T, Inc.	EUR	1,450 %	01/06/2022	954.180	0,24
1.050.000	AT&T, Inc.	EUR	1,050 %	05/09/2023	1.070.969	0,26
900.000	Athene Global Funding	EUR	1,125 %	02/09/2025	929.979	0,23
	Ball Corp.	EUR	4,375 %	15/12/2023	864.488	0,21
	Bank of America Corp.	EUR	1,625 %	14/09/2022	1.067.157	0,26
	Bank of America Corp.(c)	EUR	0,213 %	04/05/2023	1.779.917	0,44
	Bank of America Corp.(c) Becton Dickinson and Co.	EUR EUR	1,379 % 1,401 %	07/02/2025 24/05/2023	2.701.072 2.757.564	0,66 0,68
	Berry Global, Inc.	EUR	1,000 %	15/01/2025	1.005.360	0,25
	Capital One Financial Corp.	USD	2,600 %	11/05/2023	585.745	0,14
	Citigroup, Inc.	EUR	0,500 %	29/01/2022	400.320	0,10
	Citigroup, Inc.	USD	4,050 %	30/07/2022	494.867	0,12
2.450.000	Citigroup, Inc.(c)	EUR	0,000 %	21/03/2023	2.463.891	0,61
775.000	Citigroup, Inc.	EUR	2,375 %	22/05/2024	820.392	0,20
	Citigroup, Inc.	EUR	1,750 %	28/01/2025	2.232.907	0,55
	Colfax Corp.	EUR	3,250 %	15/05/2025	756.420	0,19
	Danaher Corp.	EUR	1,700 %	30/03/2024	937.242	0,23
	Expedia Group, Inc. Fidelity National Information Services, Inc.	EUR EUR	2,500 % 0,125 %	03/06/2022 03/12/2022	1.459.584	0,36 0,27
	Fidelity National Information Services, Inc.	EUR	0,750 %	21/05/2023	1.103.597 809.576	0,27
	Fisery. Inc.	EUR	0,375 %	01/07/2023	1.812.204	0,44
	Ford Motor Credit Co., LLC	EUR	1,355 %	07/02/2025	651.781	0,16
	General Electric Co.	EUR	0,375 %	17/05/2022	1.805.490	0,44
1.100.000	General Electric Co.	EUR	0,875 %	17/05/2025	1.129.887	0,28
1.400.000	General Motors Financial Co., Inc.	EUR	0,955 %	07/09/2023	1.422.344	0,35
	General Motors Financial Co., Inc.	EUR	2,200 %	01/04/2024	4.479.345	1,10
	IQVIA, Inc.	EUR	1,750 %	15/03/2026	931.087	0,23
	Kellogg Co.	EUR	0,800 %	17/11/2022	1.466.066	0,36
	Kellogg Co.	EUR	1,000 %	17/05/2024	1.589.680	0,39
	Keurig Dr Pepper, Inc.	USD	4,057 %	25/05/2023	601.178	0,15
	McDonald's Corp. Morgan Stanley	EUR EUR	1,000 % 1,000 %	15/11/2023 02/12/2022	2.150.001 1 115 411	0,53 0,27
	Morgan Stanley Morgan Stanley	EUR	1,000 %	30/03/2023	1.115.411 976.420	0,27
	MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.	EUR	0,993 %	15/10/2026	324.298	0,24
	National Grid North America, Inc.	EUR	0,750 %	11/02/2022	1.904.408	0,00
	National Grid North America, Inc.	EUR	0,750 %	08/08/2023	2.612.003	0,64
	Netflix, Inc.	EUR	3,000 %	15/06/2025	757.232	0,19
	Sealed Air Corp.	EUR	4,500 %	15/09/2023	847.992	0,21
	Silgan Holdings, Inc.	EUR	3,250 %	15/03/2025	1.008.190	0,25
	Stryker Corp.	EUR	0,250 %	03/12/2024	1.934.047	0,47
	Verizon Communications, Inc.	USD	0,750 %	22/03/2024	1.552.955	0,38

Secretario File Internation   Sec	Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en EUR	% del patrimonio
Elados Univolve							Patrimonia
1.550.000 Velies Fargin Sank NA	•	•					
TOTAL DE BONS			EUR	1,500 %	12/09/2022	1.370.452	0,34
Transpar   Secret EUR 321-731-731-731-731-731-731-731-731-731-73	1.050.000	Wells Fargo Bank NA	GBP	5,250 %	01/08/2023	1.311.495	0,32
Part			-			65.873.581	16,19
Tenencias   Descripción del valor	TOTAL DE BONO	s		,		-	
Tennicals   Descripcion del valor   Servicion   Ser	(coste EUR 321.70	03.778)				321.817.495	79,08
Sagra   Galdman Sachs Euro Liquid Reserves Fund (Cliase de acciones de acumulación X)   Marcha   Sagra   Sa	Tenencias	Descripción del valor				mercado en	% del patrimonio
3.9.3   Goldman Sachs Euro Liquia Reserves Fund (Clase de acionnes de l'acionnes de l'aci		rsión – 9,50 %		,			
Coaste EUR 3.704.064    Coaste EUR 3.06.065  MOBILLARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VALORES OFICIAL (Coste EUR 360.407.842)   360.968.616   88.568   88.568   7   1   1   1   1   1   1   1   1   1		Goldman Sachs Euro Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de acumula	ción X) <sup>(e)(f)</sup>			38.679.321	9,50
TOTAL DE VALORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VALORES OFICIAL (coste EUR 366.407 A/42)   Valor de Euro de EUR 366.407 A/42)   Valor de Euro de EUR 366.407 A/42)   Valor de EUR 366.407 A/42)   Valor de EUR 366.407 A/42)   Valor de Euro de EUR 366.407 A/42)   Valor de EUR 366.407 A/4						38.679.321	9.50
Tenencias Descripción del valor   Tenencias Descripción del valor   Tenencias Descripción del valor   Tenencias   Descripción del valor   Tenencia   Tene	TOTAL DE VALOR	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VALO	RES OFICIA	NL			· · ·
Transmission   Tran	(coste EUR 360.4	U1.842)					88,58
Valores mobililarios negociados en otro mercado regulado						mercado en	% del
Blase Calmán	Tenencias	Descripción del valor	Divisa	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	EUR	patrimonio
Section   Sect	Valores mobiliario	os negociados en otro mercado regulado					
1.100.000   Avolon Holdings Funding Ltd. 144A(d)   USD 3,825 % 01/05/2022   976.286   0,24	,						
Francia	Islas Caimán						
1,800,000 BNP Paribas S.A. 144A <sup>(6)</sup>	1.100.000	Avolon Holdings Funding Ltd. 144A(d)	USD	3,625 %	01/05/2022	976.286	0,24
1.350 000 BPCE S.A. 144A <sup>(4)</sup> USD 3,000 % 2205/2022 1200 934 0,33 550 000 Crédit Agricole S.A. 144A <sup>(4)</sup> USD 3,750 % 24/04/2023 504,003 0,72 350,000 Crédit Agricole S.A. 144A <sup>(4)</sup> 3,306,040 0,81 3,750 % 24/04/2023 504,003 0,72 3,000 Crédit Agricole S.A. 144A <sup>(4)</sup>	Francia						
TOTAL DE BONOS (coste EUR 4.267.524)   3,306.040   0,81	1.800.000	BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,950 %	23/05/2022	1.601.103	0,39
TOTAL DE BONOS   Coste EUR 4.257.524	1.350.000	BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,000 %	22/05/2022	1.200.934	0,30
TOTAL DE BONOS	550.000	Crédit Agricole S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD _	3,750 %	24/04/2023	504.003	0,12
Coste EUR 4.257.524    4.282.326   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1,082   1						3.306.040	0,81
Estados Unidos						4.282.326	1,05
150.000   Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A(c)(d)   USD   1,700 %   25/01/2034   132.756   0,03	-	garantía de activos emitidos o garantizados por agencias - 3,27 %				-	
655.306 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup> USD 3,842 % 25/08/2050 581.020 0,14 3.586.417 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/06/2048 3.387.167 0,88 6.338.873 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,500 % 01/11/2050 5.926.375 1.46 38.259 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/08/2045 37.724 0,01 1.942.174 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/08/2045 37.724 0,01 1.942.174 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/01/2048 70.275 0,06 69.933 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/01/2048 70.275 0,06 644.382 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/12/2048 610.209 0,15 744.495 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/01/2049 696.099 0,17 13.306.160 3.27		- (-)(a)(a)(a)(a)(a)(a)(a)(a)(a)(a)(a)(a)(a)		. ===			
3.586.417 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/06/2048 3.387.167 0,83 6.338.873 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,500 % 01/11/2050 5.926.375 1,46 33.259 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/08/2045 37.724 0,01 1.942.174 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/12/2047 1.864.535 0,46 69.933 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/12/2047 1.864.535 0,46 69.933 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/12/2048 70.275 0,02 644.382 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/12/2048 610.209 0,15 744.495 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/12/2048 696.099 0,17 13.306.160 3,27 TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170) 13.306.160 3,27 TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170) 13.306.160 3,27 TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170) 13.306.160 3,27 TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170) 13.306.160 3,27 TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170) 13.306.160 3,27 TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170) 13.306.160 3,27 TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170) 13.306.160 3,27 TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170) 13.306.160 3,27 TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170) 13.306.160 3,27 TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170) 13.306.160 3,27 TOTAL DE CONTRO CONTRO CONTRO CONTRO CONTRO CONTRO CONTRO CONTRO CONTRO							
6.338.873 Federal National Mortgage Association (FNMA)  38.259 Government National Mortgage Association (GNMA)  1.942.174 Government National Mortgage Association (GNMA)  89.933 Government National Mortgage Association (GNMA)  89.933 Government National Mortgage Association (GNMA)  89.934 Government National Mortgage Association (GNMA)  89.935 Government National Mortgage Association (GNMA)  89.936 Government National Mortgage Association (GNMA)  89.937 (A.4.495 Government National Mortgage Association (GNMA)  89.938 (Government National Mortgage Association (GNMA)  89.939 (A.500 % 20/01/2048 610.209 0.15 (A.500 % 20/01/2048 610.209 0.15 (A.500 % 20/01/2049 696.099 0.17 (A.500 % 20/01							
38.259 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/08/2045 37.724 0,01 1.942.174 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/12/2047 1.864.535 0,46 69.933 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/01/2048 70.275 0,02 644.382 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/01/2048 610.209 0,15 744.495 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/01/2048 610.209 0,15 744.495 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/01/2049 696.099 0,17 744.495 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,500 % 20/01/2049 696.099 0,17 744.495 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,500 % 20/01/2049 696.099 0,17 744.495 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,500 % 20/01/2049 696.099 0,17 744.495 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,500 % 20/01/2049 696.099 0,17 744.495 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,500 % 20/01/2049 696.099 0,17 744.495 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,500 % 20/01/2049 696.099 0,17 744.495 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,500 % 20/01/2049 696.099 0,17 744.495 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 1,380 6160 3,27 744.495 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 1,182 % 18/04/2034 833.525 0,26 74/04/2034 833.525 USD 1,264 % 18/04/2034 833.525 USD 1,264 % 18/04/2034 833.525 USD 1,264 % 19/04/2034 837.031 0,21 2,2500.000 UGG US CLO Ltd. 2016-1A "CRR" 144A/6/d0 USD 3,686 % 28/07/2034 2,183.059 0,54 1.93.622 Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30 A"A "144A/6/d0 USD 3,686 % 28/07/2034 2,183.059 0,54 1.93.622 Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30 A"A "144A/6/d0 USD 1,412 % 20/01/2032 880.088 0,22 80.0000 Nassau Ltd. 2017-1A "CRR" 144A/6/d0 USD 1,412 % 20/01/2032 880.088 0,22 80.0000 Nassau Ltd. 2017-1A "A" 144A/6/d0 USD 1,434 % 25/01/2034 2,642.437 0,65 2,831.000 Venture 41 CLO		* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *		,			
1.942.174 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/12/2047 1.864.535 0,46 69.933 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,500 % 20/10/2048 70.275 0,00 644.382 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/12/2048 610.209 0,15 744.495 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,500 % 20/01/2049 696.099 0,17 13.306.160 3,27 TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170) 13.306.160 3,27 TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170) 13.306.160 3,27 TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170) 13.306.160 3,27 TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170) 13.306.160 3,27 TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170) 13.306.160 3,27 TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170) 13.306.160 3,27 TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170) 13.306.160 3,27 TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170) 13.306.160 3,27 TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170) 13.306.160 3,27 TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170) 13.306.160 3,27 TOTAL DE COSTA DE CONTROL DE CONTROL DE COSTA DE COST							
69.933 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,500 % 20/01/2048 70.275 0,02 644.382 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/12/2048 610.209 0,15 744.495 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,500 % 20/01/2049 696.099 0,17 13.306.160 3,27							
644.382 Government National Mortgage Association (GNMA)  744.495 Government National Mortgage Association (GNMA)  13.306.160  13.306.160  3.27  TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170)  13.306.160  3.27  Obligaciones con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias – 5,70 %  Islas Caimán  950.000 Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2014-1A "A" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2015-1A "A" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2016-1A "CRR" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "DRR" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "A" 187" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "DRR" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "A" 187" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "A" 187" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "A" 187" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "A" 187" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "A" 187" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "A" 187" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "A" 187" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "A" 187" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "A" 187" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "A" 187" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "A" 187" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "A" 187" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "A" 187" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "A" 187" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "A" 187" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "A" 187" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "A" 187" 144A(c)(d)  10.50.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "A" 187" 144A(c)(d)  10.50.0							
TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170)  13.306.160  3,27  TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170)  13.306.160  3,27  Obligaciones con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias – 5,70 % Islas Caimán  950.000 Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(c)(d)  10.500.000 ICG US CLO Ltd. 2014-1A "A1A2" 144A(c)(d)  11.050.000 ICG US CLO Ltd. 2015-1A "A1R" 144A(c)(d)  11.000.000 ICG US CLO Ltd. 2016-1A "CRR" 144A(c)(d)  11.000.000 ICG US CLO Ltd. 2016-1A "CRR" 144A(c)(d)  11.000.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "DRR" 144A(c)(d)  11.000.000 Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-30A "A" 144A(c)(d)  11.000.000 Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(d)  11.000.000 Neuberger Berman Loan Advisers CLO 31 Ltd. 2019-31A "DR" 144A(c)(d)  11.000.000 Trinitas CLO VI Ltd. 2017-6A "ARR" 144A(c)(d)  11.000.000 Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(c)(d)  11.000.000 Venture 41 C							
TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste EUR 12.760.170)    3.306.160   3,27							0,15
Coste EUR 12.760.170    Cost			-			13.306.160	3,27
Substitution   Obligaciones con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias - 5,70 %			OR AGENC	IAS		13.306.160	3,27
950.000 Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(c)(d)  1.050.000 ICG US CLO Ltd. 2014-1A "A1A2" 144A(c)(d)  1.050.000 ICG US CLO Ltd. 2014-1A "A1A2" 144A(c)(d)  1.050.000 ICG US CLO Ltd. 2015-1A "A1R" 144A(c)(d)  1.000.000 ICG US CLO Ltd. 2015-1A "A1R" 144A(c)(d)  1.000.000 ICG US CLO Ltd. 2016-1A "CRR" 144A(c)(d)  2.500.000 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "DRR" 144A(c)(d)  1.193.622 Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(c)(d)  1.000.000 Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(d)  1.000.000 Nassau Ltd. 2017-IIA "AL" 144A(c)(d)  1.000.000 Nassau Ltd. 2017-IIA "AL" 144A(c)(d)  1.000.000 Neuberger Berman Loan Advisers CLO 31 Ltd. 2019-31A "DR" 144A(c)(d)  1.050.000 USD 1,434 %  1.050.000 Venture 41 CLO Ltd. 2017-6A "ARR" 144A(c)(d)  1.050.000 Venture 41 CLO Ltd. 2017-1A "AL" 144A(c)(d)  1.050.000 Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(c)(d)  1.050.000 Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A	Obligaciones con						
1.050.000       ICG US CLO Ltd. 2014-1A "A1A2" 144A(c)(d)       USD       1,332 %       20/10/2034       923.251       0,23         1.663.215       ICG US CLO Ltd. 2015-1A "A1R" 144A(c)(d)       USD       1,264 %       19/10/2028       1.462.281       0,36         1.000.000       ICG US CLO Ltd. 2016-1A "CRR" 144A(c)(d)       USD       3,779 %       29/04/2034       877.031       0,21         2.500.000       ICG US CLO Ltd. 2017-1A "DRR" 144A(c)(d)       USD       3,686 %       28/07/2034       2.183.059       0,54         1.193.622       Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(c)(d)       USD       0,874 %       15/04/2029       1.049.361       0,26         1.000.000       Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(d)       USD       1,412 %       20/01/2032       880.088       0,22         800.000       Nassau Ltd. 2017-IIA "AL" 144A(c)(d)       USD       1,374 %       15/01/2030       701.816       0,17         800.000       Neuberger Berman Loan Advisers CLO 31 Ltd. 2019-31A "DR" 144A(c)(d)       USD       3,382 %       20/04/2031       703.582       0,17         132.195       OCP CLO Ltd. 2015-10 "A1R" 144A(c)(d)       USD       0,945 %       26/10/2027       116.180       0,03         3.000.000       Trinitas CLO VI Ltd. 2017-6A "ARR" 144A(c)(d) </td <td></td> <td>Bain Capital Credit CL Ω Ltd. 2021-1Δ "Δ" 144Δ(c)(d)</td> <td>HED</td> <td>1 182 %</td> <td>18/04/2034</td> <td>833 525</td> <td>U 20</td>		Bain Capital Credit CL Ω Ltd. 2021-1Δ "Δ" 144Δ(c)(d)	HED	1 182 %	18/04/2034	833 525	U 20
1.663.215       ICG US CLO Ltd. 2015-1A "A1R" 144A(c)(d)       USD 1,264 %       19/10/2028 1.462.281       0,36         1.000.000       ICG US CLO Ltd. 2016-1A "CRR" 144A(c)(d)       USD 3,779 %       29/04/2034 877.031       0,21         2.500.000       ICG US CLO Ltd. 2017-1A "DRR" 144A(c)(d)       USD 3,686 %       28/07/2034 2.183.059       0,54         1.193.622       Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(c)(d)       USD 0,874 %       15/04/2029 1.049.361       0,26         1.000.000       Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(d)       USD 1,412 %       20/01/2032 880.088       0,22         800.000       Nassau Ltd. 2017-IIA "AL" 144A(c)(d)       USD 1,374 %       15/01/2030 701.816       0,17         800.000       Neuberger Berman Loan Advisers CLO 31 Ltd. 2019-31A "DR" 144A(c)(d)       USD 3,382 %       20/04/2031 703.582       0,17         132.195       OCP CLO Ltd. 2015-10 "A1R" 144A(c)(d)       USD 0,945 %       26/10/2027 116.180       0,03         3.000.000       Trinitas CLO VI Ltd. 2017-6A "ARR" 144A(c)(d)       USD 1,434 %       25/01/2034 2.642.437       0,65         2.831.000       Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(c)(d)       USD 1,462 %       20/01/2034 2.490.112       0,61							
1.000.000       ICG US CLO Ltd. 2016-1A "CRR" 144A(c)(d)       USD 3,779 %       29/04/2034       877.031       0,21         2.500.000       ICG US CLO Ltd. 2017-1A "DRR" 144A(c)(d)       USD 3,686 %       28/07/2034       2.183.059       0,54         1.193.622       Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(c)(d)       USD 0,874 %       15/04/2029       1.049.361       0,26         1.000.000       Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(d)       USD 1,412 %       20/01/2032       880.088       0,22         800.000       Nassau Ltd. 2017-IIA "AL" 144A(c)(d)       USD 1,374 %       15/01/2030       701.816       0,17         800.000       Neuberger Berman Loan Advisers CLO 31 Ltd. 2019-31A "DR" 144A(c)(d)       USD 3,382 %       20/04/2031       703.582       0,17         132.195       OCP CLO Ltd. 2015-10 "A1R" 144A(c)(d)       USD 0,945 %       26/10/2027       116.180       0,03         3.000.000       Trinitas CLO VI Ltd. 2017-6A "ARR" 144A(c)(d)       USD 1,434 %       25/01/2034       2.642.437       0,66         2.831.000       Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(c)(d)       USD 1,462 %       20/01/2034       2.490.112       0,61							
2.500.000       ICG US CLO Ltd. 2017-1A "DRR" 144A(c)(d)       USD 3,686 %       28/07/2034       2.183.059       0,54         1.193.622       Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(c)(d)       USD 0,874 %       15/04/2029       1.049.361       0,26         1.000.000       Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(d)       USD 1,412 %       20/01/2032       880.088       0,22         800.000       Nassau Ltd. 2017-IIA "AL" 144A(c)(d)       USD 1,374 %       15/01/2030       701.816       0,17         800.000       Neuberger Berman Loan Advisers CLO 31 Ltd. 2019-31A "DR" 144A(c)(d)       USD 3,382 %       20/04/2031       703.582       0,17         132.195       OCP CLO Ltd. 2015-10 "A1R" 144A(c)(d)       USD 0,945 %       26/10/2027       116.180       0,03         3.000.000       Trinitas CLO VI Ltd. 2017-6A "ARR" 144A(c)(d)       USD 1,434 %       25/01/2034       2.642.437       0,65         2.831.000       Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(c)(d)       USD 1,462 %       20/01/2034       2.490.112       0,61							
1.193.622       Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(c)(d)       USD 0,874 %       15/04/2029       1.049.361       0,26         1.000.000       Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(d)       USD 1,412 %       20/01/2032       880.088       0,22         800.000       Nassau Ltd. 2017-IIA "AL" 144A(c)(d)       USD 1,374 %       15/01/2030       701.816       0,17         800.000       Neuberger Berman Loan Advisers CLO 31 Ltd. 2019-31A "DR" 144A(c)(d)       USD 3,382 %       20/04/2031       703.582       0,17         132.195       OCP CLO Ltd. 2015-10 "A1R" 144A(c)(d)       USD 0,945 %       26/10/2027       116.180       0,03         3.000.000       Trinitas CLO VI Ltd. 2017-6A "ARR" 144A(c)(d)       USD 1,434 %       25/01/2034       2.642.437       0,65         2.831.000       Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(c)(d)       USD 1,462 %       20/01/2034       2.490.112       0,61							
1.000.000       Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(d)       USD 1,412 %       20/01/2032 880.088       0,22         800.000       Nassau Ltd. 2017-IIA "AL" 144A(c)(d)       USD 1,374 %       15/01/2030 701.816       0,17         800.000       Neuberger Berman Loan Advisers CLO 31 Ltd. 2019-31A "DR" 144A(c)(d)       USD 3,382 %       20/04/2031 703.582       0,17         132.195       OCP CLO Ltd. 2015-10 "A1R" 144A(c)(d)       USD 0,945 %       26/10/2027 116.180       0,03         3.000.000       Trinitas CLO VI Ltd. 2017-6A "ARR" 144A(c)(d)       USD 1,434 %       25/01/2034 2.642.437       0,65         2.831.000       Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(c)(d)       USD 1,462 %       20/01/2034 2.490.112       0,61							
800.000       Nassau Ltd. 2017-IIA "AL" 144A(c)(d)       USD 1,374 %       15/01/2030 701.816       0,17         800.000       Neuberger Berman Loan Advisers CLO 31 Ltd. 2019-31A "DR" 144A(c)(d)       USD 3,382 %       20/04/2031 703.582       0,17         132.195       OCP CLO Ltd. 2015-10 "A1R" 144A(c)(d)       USD 0,945 %       26/10/2027 116.180       0,03         3.000.000       Trinitas CLO VI Ltd. 2017-6A "ARR" 144A(c)(d)       USD 1,434 %       25/01/2034 2.642.437       0,65         2.831.000       Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(c)(d)       USD 1,462 %       20/01/2034 2.490.112       0,61							
800.000       Neuberger Berman Loan Advisers CLO 31 Ltd. 2019-31A "DR" 144A(c)(d)       USD       3,382 %       20/04/2031       703.582       0,17         132.195       OCP CLO Ltd. 2015-10 "A1R" 144A(c)(d)       USD       0,945 %       26/10/2027       116.180       0,03         3.000.000       Trinitas CLO VI Ltd. 2017-64 "ARR" 144A(c)(d)       USD       1,434 %       25/01/2034       2.642.437       0,65         2.831.000       Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(c)(d)       USD       1,462 %       20/01/2034       2.490.112       0,61							
132.195 OCP CLO Ltd. 2015-10 "A1R" 144A(c)(d) USD 0,945 % 26/10/2027 116.180 0,03   3.000.000 Trinitas CLO VI Ltd. 2017-6A "ARR" 144A(c)(d) USD 1,434 % 25/01/2034 2.642.437 0,65   2.831.000 Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(c)(d) USD 1,462 % 20/01/2034 2.490.112 0,61							
3.000.000 Trinitas CLO VI Ltd. 2017-6A "ARR" 144A <sup>(c)(d)</sup> USD 1,434 % 25/01/2034 2.642.437 0,65 2.831.000 Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A <sup>(c)(d)</sup> USD 1,462 % 20/01/2034 2.490.112 0,61							
2.831.000 Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A <sup>(c)(d)</sup> USD 1,462 % 20/01/2034 2.490.112 0,61							
		• • • • • • • • • • • • • • • • • • • •		,		14.862.723	3,65

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en EUR	% del patrimonio
(continuación)	on garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias –					
<b>Irlanda</b> 999.730	Haus European Loan Conduit No 39 DAC 39X "A1"(c)	EUR	0,650 %	28/07/2051	1.001.635	0,25
858.256	Primrose Residential 2021-1 DAC "A"(c)	EUR	0,190 %	24/03/2061	857.729	0,21
					1.859.364	0,46
Jersey 1.426.727	Saranac CLO VII Ltd. 2014-2A "A1AR" 144A <sup>(c)</sup> (d)	USD	1,390 %	20/11/2029	1.254.191	0,31
Reino Unido						
	Ripon Mortgages Plc. 1X "A1" <sup>(c)</sup> Stratton Mortgage Funding 2019-1 Plc. "A" <sup>(c)</sup>	GBP GBP	0,914 % 1,250 %	20/08/2056 25/05/2051	2.721.193 794.860	0,67 0,20
					3.516.053	0,87
Estados Unidos						
	Brazos Higher Education Authority, Inc. 2011-2 "A2"(C)		0,974 %	25/07/2029	10.437	0,00
	Montana Higher Education Student Assistance Corp. 2012-1 "A2"(c)		1,086 %	20/05/2030	28.375	0,01
	Pennsylvania Higher Education Assistance Agency 2006-1 "A3"(C)		0,264 %	25/10/2035	264.246	0,06
1.572.448	SLC Student Loan Trust 2007-1 "A4"(c)	090	0,216 %	15/05/2029	1.373.073	0,34
					1.676.131	0,41
TOTAL DE OBLIG GARANTIZADOS (coste EUR 22.07					23.168.462	5,70
TOTAL DE VALO	RES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO				40.750.040	40.00
VALOR DE MERC	ADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS				40.756.948	10,02
(coste EUR 399.4	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·				401.253.764	98,60
Contratos de futu	iros – 0,04 %			Compromiso	Plusvalía	
Número de contratos	Descripción del valor			Valor de mercado en EUR	latente EUR	% del patrimonio
	EUR					
1.287	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/12/2021		Larga	144.716.715	211.525	0,05
	USD		Laiga	144.7 10.7 13	211.020	0,00
	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022		Larga	15.319.509	237.857	0,06
4	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022		Larga –	702.201	21.204	0,00
DI LISVALÍA I ATE	ENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS			16.021.710	259.061 470.586	0,06
	THE SOURCE CONTRATOS DE L'OTOROS					0,11
Número de				Compromiso Valor de mercado en	Minusvalía latente	
contratos	Descripción del valor			EUR	EUR	% del patrimonio
(2)	EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años					
(2)	08/12/2021		Corta	(345.100)	(3.460)	(0,00)
(1)	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/2021		Corta	(217.940)	(3.560)	(0,00)
(101)	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años					
	08/12/2021		Corta	(13.699.640)	(54.540)	(0,01)
12	Futuros sobre bonos del Estado de Italia en euros a corto plazo 08/12/2021		Larga _	1.366.080	(480)	(0,00)
	USD			(12.896.600)	(62.040)	(0,01)
(2)	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022		Corta	(284.692)	(6.811)	(0,00)
(11)	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022		Corta	(2.117.376)	(7.480)	(0,00)
` ,	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022		Corta	(10.481.289)	(95.503)	(0,03)
(49)	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 10 años		01-	/0.000.00.1)	(400 400)	(0.00)
	22/03/2022		Corta -	(6.329.684)	(122.126)	(0,03)
MINITOVAL ÍA 1 47	FINTE CORRE CONTRATOS DE FUTUROS			(19.213.041)	(231.920)	(0,06)
MINUSVALIA LAT	ENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS Sas a plazo = 0.14 %		-		(293.960)	(0,07)
Contratos do divi	040 4 PIAZO - V, 17 /0				Plusvalía	
Contratos de divi				Fecha de	latente	
Contratos de divi	Compra Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	latente EUR	% del patrimonio
Divisa CHF	1.676.700 EUR	1.581.000		vencimiento 15/12/2021	<b>EUR</b> 27.785	0,01
Divisa	·			vencimiento	EUR	•

C	4-	distince.	_	-1	(continuación)

380.000

3.820.000

600.000 5.750.000 Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)

Fijo 0,250 %

Fijo 0,750 %

Divisa	Compra Di	ivisa	Venta		Fecha de vencimiento	latente EUR	% del patrimonio
USD	758.229 C	AD 9	56.798		15/12/2021	7.789	0,00
JSD	1.217.781 G	BP 8	86.000		15/12/2021	29.758	0,01
USD	981.356 JF	PY 110.1	71.788		15/12/2021	2.383	0,00
USD	2.481.957 N	ZD 3.6	16.709		15/12/2021	7.871	0,00
EUR			36.291		21/01/2022	75.695	0,02
EUR			99.609		31/01/2022	5.379	0,00
EUR			41.994		31/01/2022	4.634	0,00
EUR			74.734		10/02/2022	530.143	0,13
PLUSVALÍA LAT	ENTE SOBRE CONTRATOS DE DI	VISAS A PLAZO	-			701.818	0,17
						Minusvalía	
Divisa	Compra Di	ivisa	Venta		Fecha de vencimiento	latente EUR	% del patrimonio
AUD	809.739 E	UR 5	25.000		15/12/2021	(15.478)	(0,00)
AUD	530.000 U	SD 3	90.790		15/12/2021	(9.795)	(0,00)
CAD	754.446 G	BP 4	48.000		15/12/2021	(6.811)	(0,00)
CAD	1.505.521 U		18.000		15/12/2021	(34.153)	(0,01)
EUR			09.460		15/12/2021	(25.140)	(0,01)
NOK			56.000		15/12/2021	(39.215)	(0,01)
NOK		SD	1.053		15/12/2021	(36)	(0,00)
USD			60.838		15/12/2021	(1.777)	(0,00)
USD			14.352		10/02/2022	(4.207)	(0,00)
	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE D					(136.612)	(0,03)
•	ermutas financieras – (0,12 %)						
Importe local neto						Plusvalía latente	
Importe	A pagar	A recibir		Divisa	Fecha de vencimiento	EUR	% del patrimonio
	Permutas de tipos de interés						
5.670.000	Fijo 1,750 %	Variable (CDOR a 3 meses en	CAD)	CAD	15/12/2026	6.856	0,00
6.490.000	Fijo 1,680 %	Variable (CDOR a 3 meses en	CAD)	CAD	22/08/2028	77.458	0,02
2.980.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,500 %		CAD	14/10/2031	20.041	0,01
3.790.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,250 %		CAD	15/12/2051	51.676	0,01
690.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,180 %		CAD	22/08/2052	364	0,00
4.420.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,000 %		CHF	16/03/2032	40.822	0,01
25.740.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en	EUR)	EUR	15/12/2023	41.050	0,01
6.580.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en	EUR)	EUR	15/12/2025	41.424	0,01
1.120.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	- ,	EUR	15/12/2026	4.220	0,00
320.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,900 %		EUR	20/05/2029	8.080	0,00
250.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en	Fijo 0,000 %		EUR	15/12/2031		,
50.050.000	EUR)					1.163	0,00
52.350.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)			SEK SEK	16/03/2024	11.440 11.445	0,00
26.450.000 18.740.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Fijo 0,750 % Variable (LIBOR a 3 meses en	IISD)	USD	15/12/2031 25/07/2024	521	0,01 0,00
5.280.000	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	Fijo 1,530 %	(03D)	USD	22/09/2031	26.298	0,00
4.850.000	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	Fijo 1,750 %		USD	15/12/2031	50.395	0,01
PLUSVALÍA LAT	TENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPO	OS DE INTERÉS				393.253	0,10
	Permutas de inflación						
1.290.000	Fijo 2,250 %	Variable (LIBOR a 12 meses e	n EUR)	EUR	15/10/2023	620	0,00
1.760.000	Fijo 3,250 %	Variable (LIBOR a 12 meses e	n USD)	USD	07/10/2022	17.933	0,00
PLUSVALÍA LAT	TENTE SOBRE PERMUTAS DE INFI	LACIÓN				18.553	0,00
TOTAL DE PLUS\	VALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS	DE PERMUTAS FINANCIERAS	; 			411.806	0,10
Importe						Plusvalía	
local neto Importe	A pagar	A recibir		Divisa	Fecha de vencimiento	latente EUR	% del patrimonio
	Permutas de tipos de interés						
24.310.000	Variable (BBSW a 3 meses en AUD)	Fijo 0,190 %		AUD	22/02/2023	(35.461)	(0,01)
19.610.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 1,250 %		AUD	15/12/2026	(189.659)	(0,05)
4.390.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 2,000 %		AUD	15/12/2031	(49.075)	(0,01)
9.150.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 1,560 %		CAD	22/08/2025	(69.704)	(0,02)
4.400.000	Fijo 2,000 %	Variable (CDOR a 3 meses en	CAD)	CAD	15/12/2031	(46.175)	(0,01)
11.060.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %		EUR	15/12/2024	(45.507)	(0,01)
380.000	Fijo 0,250 %	Variable (EURIBOR a 6 meses	s en	EUD	15/12/2051		

15/12/2051

15/12/2026

15/12/2028

15/12/2031

(4.979)

(15.659) (53.736)

(22.840)

(0,00)

(0,00) (0,01) (0,01)

EUR

GBP

GBP

Plusvalía

Variable (EURIBOR a 6 meses en

Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP)

#### Contratos de permutas financieras - (continuación)

Importe local neto					Plusvalía latente	
Importe	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	EUR	% del patrimonio
	Permutas de tipos de interés -					
422.900.000	(continuación) Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)	JPY	15/12/2031	(5.336)	(0.00
23.060.000	Fijo 2,000 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	16/03/2027	(25.020)	(0,00
23.410.000	Fijo 2,130 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	11/05/2031	(24.918)	(0,01
5.750.000	Fijo 2,000 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	16/03/2032	(10.417)	(0,00
3.370.000	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 1,250 %	NZD	15/12/2022	(3.781)	(0,00
2.380.000	Fijo 2,000 %	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	NZD	15/12/2031	(5.195)	(0,00
20.910.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,250 %	SEK	15/12/2026	(3.793)	(0,00
3.670.000	Fijo 0,250 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2024	(13.752)	(0,00
5.540.000	Fijo 1,000 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2027	(17.618)	(0,00
6.360.000	Fijo 1,630 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	22/09/2036	(26.415)	(0,01
1.680.000	Fijo 1,750 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2052	(26.232)	(0,01
MINUSVALÍA LATENT	E SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTER	ÉS			(695.272)	(0,17
	Permutas de incumplimiento crediticio (0	CDS)				
15.775.000	Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 28 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2022	(6.563)	(0,00
MINUSVALÍA LATENT	E SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMIENT	O CREDITICIO (CDS)			(6.563)	(0,00
	Permutas de inflación					
1.550.000	Fijo 1,920 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/11/2031	(10.505)	(0,00
2.760.000	Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)	Fijo 4,170 %	GBP	15/11/2028	(186.223)	(0,05
	E SOBRE PERMUTAS DE INFLACIÓN				(196.728)	(0,05
TOTAL DE MINUSVAL	ÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE PER	MUTAS FINANCIERAS			(898.563)	(0,22
VALOR DE MERCADO (coste EUR 399.499.4	D DE LAS INVERSIONES 06)				401.508.839	98,66
OTROS ACTIVOS Y P	ASIVOS				5.440.561	1,3
PATRIMONIO					406.949.400	100,00
TOTAL DE INVERSIO	NES				Valor de mercado en EUR	% de patrimoni
Total inversiones exclu (coste EUR 399.499.4					401.253.764	98,6
Plusvalía latente sobre	•				470.586	0.1
	ore contratos de futuros				(293.960)	(0,07
	e contratos de divisas a plazo				701.818	0.1
	ore contratos de divisas a plazo				(136.612)	(0,03
	e contratos de germutas financieras				411.806	0,03
	•					- 1
	ore contratos de permutas financieras				(898.563)	(0,22
Otros activos y pasivo	<b>&gt;</b>				5.440.561	1,3
Patrimonio					406.949.400	100,0

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Standard Chartered Bank y State Street Bank & Trust.

Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Credit Suisse y Merrill Lynch International.

 $La \ exposición \ m\'{a}xima \ a \ cada \ contraparte \ a \ 30 \ de \ noviembre \ de \ 2021, \ medida \ como \ porcentaje \ del \ VL, \ es \ del \ 0,15 \ \%.$ 

<sup>(</sup>a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.

<sup>(</sup>b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.

<sup>(</sup>c) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.

<sup>(</sup>d) 144A. La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.

<sup>(</sup>e) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

 $<sup>^{(</sup>f)}$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del (0,627) %.

				,	Valor de mercado	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en EUR	% del
	liarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	2				patimonic
Bonos – 94,0						
Austria						
100.000	ams AG	EUR	6,000 %	31/07/2025	105.502	0,10
Bélgica						
	House of Finance NV	EUR	4,375 %	15/07/2026	304.470	0,29
	Ontex Group NV Solvay S.A. <sup>(c)</sup>	EUR EUR	3,500 % 4,250 %	15/07/2026 Perp.	331.695 210.350	0,31 0,20
200.000	Olivay O.A.	LOIX	<del></del>	ı cıp.		
					846.515	0,80
Islas Vírgenes		EUR	4 250 %	06/05/2023	148.336	0.14
	Fortune Star BVI Ltd.	EUR	4,350 %	00/03/2023	146.330	0,14
Canadá 200.000	Bausch Health Cos., Inc.	USD	5,000 %	15/02/2029	149.405	0,14
Islas Caimán	Budon Houlin Coo., mo.	- 002	0,000 /0	10/02/2020	1.10.100	0,
	UPCB Finance VII Ltd.	EUR	3,625 %	15/06/2029	356.562	0,34
Dinamarca						
200.000	Norican A/S	EUR	4,500 %	15/05/2023	196.958	0,18
Finlandia						
	Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy	EUR	3,625 %	04/02/2028	198.199	0,19
	Citycon OYJ <sup>(c)</sup>	EUR	3,625 %	Perp.	96.295	0,09
	Nokia OYJ	EUR	2,000 %	11/03/2026	208.392	0,20
	Nokia OYJ	EUR	3,125 %	15/05/2028	388.829	0,36
225.000	Teollisuuden Voima OYJ	EUR	1,125 %	09/03/2026	224.403	0,21
					1.116.118	1,05
Francia	(1)			_		
	Accor S.A.(c)	EUR	4,375 %	Perp.	102.379	0,10
	Altice France S.A. Altice France S.A.	EUR EUR	2,125 % 3,375 %	15/02/2025 15/01/2028	292.875 201.327	0,28 0,19
	Altice France S.A.	USD	5,125 %	15/07/2029	168.300	0,18
	Banijay Entertainment SASU	EUR	3,500 %	01/03/2025	99.664	0,09
	Banijay Group SAS	EUR	6,500 %	01/03/2026	363.821	0,34
	CAB SELAS	EUR	3,375 %	01/02/2028	444.627	0,42
200.000	Chrome Bidco SASU	EUR	3,500 %	31/05/2028	200.420	0,19
300.000	Chrome Holdco SASU	EUR	5,000 %	31/05/2029	301.529	0,28
	Constellium S.E.	EUR	4,250 %	15/02/2026	100.826	0,10
	Constellium S.E.	EUR	3,125 %	15/07/2029	295.616	0,28
	Derichebourg S.A.	EUR	2,250 %	15/07/2028	280.009	0,26
	Électricité de France S.A.(c)	EUR	5,375 %	Perp.	220.300	0,21
	Électricité de France S.A.(c)	EUR	2,625 %	Perp.	404.500	0,38
	Électricité de France S.A. <sup>(c)</sup> Électricité de France S.A. <sup>(c)</sup>	EUR EUR	2,875 %	Perp.	820.000	0,77
	Elior Group S.A.	EUR	3,375 % 3,750 %	Perp. 15/07/2026	416.200 204.639	0,39 0,19
	Elis S.A.	EUR	1,625 %	03/04/2028	496.782	0,13
	Faurecia S.E.	EUR	2,625 %	15/06/2025	303.889	0,29
	Faurecia S.E.	EUR	2,750 %	15/02/2027	499.605	0,47
500.000	Faurecia S.E.	EUR	2,375 %	15/06/2029	498.640	0,47
300.000	Getlink S.E.	EUR	3,500 %	30/10/2025	302.290	0,28
137.000	Iliad Holding SAS	EUR	5,125 %	15/10/2026	140.288	0,13
350.000	Kapla Holding SAS	EUR	3,375 %	15/12/2026	347.609	0,33
	La Financière Atalian SASU	EUR	5,125 %	15/05/2025	396.072	0,37
	La Mondiale SAM <sup>(c)</sup>	EUR	4,375 %	Perp.	106.309	0,10
	Laboratoire Eimer Selas	EUR	5,000 %	01/02/2029	100.489	0,09
	Loxam SAS	EUR	3,500 %	03/05/2023	100.285	0,09
	Loxam SAS	EUR	3,250 %	14/01/2025	225.378	0,21
	Loxam SAS Midco GB SASU	EUR EUR	5,750 % 7,750 %	15/07/2027 01/11/2027	257.023 102.981	0,24 0,10
	Orano S.A.	EUR	3,375 %	23/04/2026	215.661	0,10
	Orano S.A.	EUR	2,750 %	08/03/2028	103.904	0,10
	Parts Europe S.A.	EUR	6,500 %	16/07/2025	207.928	0,20
	Parts Europe S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	4,000 %	20/07/2027	100.037	0,09
250.000	Picard Groupe SAS	EUR	3,875 %	01/07/2026	250.135	0,24
400.000	Quatrim SASU	EUR	5,875 %	15/01/2024	410.940	0,39
	RCI Banque S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	2,625 %	18/02/2030	395.700	0,37
	Renault S.A.	EUR	2,375 %	25/05/2026	502.545	0,47
	Renault S.A.	EUR	2,500 %	02/06/2027	198.938	0,19
100 000	Renault S.A.	EUR	% 25ئ1,1	04/10/2027	92.578	0,09
	Rexel S.A.	EUR	2,125 %	15/06/2028	200.713	0,19

			<b>.</b>	'	/alor de mercado	۰.
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	en EUR	% d
	<u> </u>	2				patrimoni
Bonos – (con	· ·					
rancia – (con	Rexel S.A.	EUR	2,125 %	15/12/2028	99.400	0,0
	Rubis Terminal Infra SAS	EUR	5,625 %	15/05/2025	309.484	0,0
	SPCM S.A.	EUR			378.909	
			2,625 %	01/02/2029		0,3
	SPIE S.A.	EUR	3,125 %	22/03/2024	208.426	0,2
	SPIE S.A.	EUR	2,625 %	18/06/2026	207.048	0,2
100.000		EUR	1,500 %	18/06/2025	102.666	0,1
	Valeo S.A.	EUR	1,000 %	03/08/2028	193.157	0,1
	Veolia Environnement S.A.(c)	EUR	2,000 %	Perp.	299.250	0,2
	Verallia S.A.	EUR	1,625 %	14/05/2028	203.558	0,1
100.000	Verallia S.A.	EUR	1,875 %	10/11/2031	99.389	0,0
					13.575.038	12,7
Alemania						
	ADLER Real Estate AG	EUR	1,500 %	17/04/2022	191.038	0,1
	APCOA Parking Holdings GmbH	EUR	4,625 %	15/01/2027	197.219	0,1
	CeramTec BondCo GmbH	EUR	5,250 %	15/12/2025	305.319	0,2
	Cheplapharm Arzneimittel GmbH	USD	5,500 %	15/01/2028	382.260	0,3
	Commerzbank AG <sup>(c)</sup>	EUR	4,000 %	05/12/2030	217.250	0,2
	Commerzbank AG <sup>(c)</sup>	EUR	1,375 %	29/12/2031	294.375	0,2
	Commerzbank AG <sup>(c)</sup>	USD	7,000 %	Perp.	187.854	0,
	Deutsche Bank AG	EUR	4,500 %	19/05/2026	113.989	0,
	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	EUR	5,625 %	19/05/2031	116.375	0,
400.000	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	USD	3,729 %	14/01/2032	361.235	0,3
200.000	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	EUR	4,625 %	Perp.	200.356	0,
200.000	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	USD	6,000 %	Perp.	180.164	0,
300.000	Deutsche Lufthansa AG	EUR	2,875 %	16/05/2027	284.245	0,3
300.000	Deutsche Lufthansa AG	EUR	3,500 %	14/07/2029	285.603	0,:
300.000	Deutsche Pfandbriefbank AG(c)	EUR	2,875 %	28/06/2027	301.755	0,:
200.000	Gruenenthal GmbH	EUR	4,125 %	15/05/2028	207.630	0,:
100.000	IHO Verwaltungs GmbH	EUR	3,625 %	15/05/2025	101.636	0,
	IHO Verwaltungs GmbH	EUR	3,875 %	15/05/2027	408.074	0,
	IHO Verwaltungs GmbH	USD	6,000 %	15/05/2027	183.021	0,
	IHO Verwaltungs GmbH 144A <sup>(d)</sup>	USD	6,000 %	15/05/2027	183.021	0,
	INEOS Styrolution Group GmbH	EUR	2,250 %	16/01/2027	242.306	0,2
	Infineon Technologies AG <sup>(c)</sup>	EUR	2,875 %	Perp.	207.250	0,
	Mahle GmbH	EUR	2,375 %	14/05/2028	386.286	0,3
	Nidda Healthcare Holding GmbH	EUR	3,500 %	30/09/2024	547.481	0,
	Novelis Sheet Ingot GmbH	EUR	3,375 %	15/04/2029	205.672	0,
	PCF GmbH	EUR	4,750 %	15/04/2026	127.389	0,
	Peach Property Finance GmbH	EUR	4,375 %	15/11/2025	306.840	0,2
	ProGroup AG	EUR	3,000 %	31/03/2026	300.894	0,
	Renk AG Via Frankfurt am Main	EUR	5,750 %	15/07/2025	207.692	0,:
	Schaeffler AG	EUR	2,750 %	12/10/2025	106.081	0,
	Schaeffler AG	EUR	3,375 %	12/10/2028	222.818	0,
		EUR				
	Schenck Process Holding GmbH Via Darmstadt		5,375 %	15/06/2023	200.126	0,
	SGL Carbon S.E.	EUR	4,625 %	30/09/2024	202.758	0,
	Standard Profil Automotive GmbH	EUR	6,250 %	30/04/2026	214.959	0,2
	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH	EUR	6,000 %	30/07/2026	180.932	0,
	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH	EUR	2,000 %	15/07/2025	419.845	0,3
	Thyssenkrupp AG	EUR	1,875 %	06/03/2023	50.308	0,0
	Thyssenkrupp AG	EUR	2,875 %	22/02/2024	435.434	0,4
	TK Elevator Midco GmbH	EUR	4,375 %	15/07/2027	385.050	0,
250.000	TUI Cruises GmbH	EUR	6,500 %	15/05/2026	242.464	0,:
	WEPA Hygieneprodukte GmbH	EUR	2,875 %	15/12/2027	187.476	0,
	ZF Finance GmbH	EUR	3,000 %	21/09/2025	521.935	0,4
200.000	ZF Finance GmbH	EUR	2,000 %	06/05/2027	199.489	0,
300.000	ZF Finance GmbH	EUR	2,750 %	25/05/2027	306.916	0,
200.000	ZF Finance GmbH	EUR	2,250 %	03/05/2028	200.935	0,
300.000	ZF Finance GmbH	EUR	3,750 %	21/09/2028	324.048	0,3
					11.635.803	10,9
Precia	Piraeus Financial Holdings S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	8,750 %	Perp.	192.302	0,1
	Traded Financial Floratings O.A.V	LOIX	0,700 /0	reip.	132.302	
lungría 175.000	OTP Bank Nyrt <sup>(c)</sup>	EUR	2,875 %	15/07/2029	181.453	0,1
	•					-, -
landa						
landa 250.000	AIB Group Plc.(c)	EUR	2,875 %	30/05/2031	262.120	0,2

			Tipo de		Valor de mercado en	, % de
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	EUR	patrimonio
	Bank of Ireland Group Plc.(c)	EUR	1,375 %	11/08/2031	98.343	0,09
Bonos – (con	•					
Irlanda – (conti	•	EUD	6 000 0/	Dam	245.024	0.20
	Bank of Ireland Group Plc. (c)  James Hardie International Finance DAC	EUR EUR	6,000 % 3,625 %	Perp. 01/10/2026	215.924 101.788	0,20 0,10
	Motion Bondco DAC	EUR	4,500 %	15/11/2027	191.726	0,18
	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC	GBP	4,875 %	15/07/2028	117.458	0,11
	3				1.165.985	1,10
sla de Man						
	Playtech Plc.	EUR	3,750 %	12/10/2023	506.065	0,47
100.000	Playtech Plc.	EUR	4,250 %	07/03/2026	102.739	0,10
srael					608.804	0,57
	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	EUR	3,750 %	09/05/2027	315.587	0,30
talia			/	_		
	Assicurazioni Generali SpA <sup>(c)</sup>	EUR	4,596 %	Perp.	273.250	0,26
	Atlantia SpA	EUR	1,625 %	03/02/2025	306.423	0,29
	Autostrade per l'Italia SpA Autostrade per l'Italia SpA	EUR EUR	4,375 % 2,000 %	16/09/2025	227.155 571.494	0,21 0,54
	Autostrade per l'Italia SpA Autostrade per l'Italia SpA	EUR	2,000 % 2,000 %	04/12/2028 15/01/2030	260.376	0,52
		EUR			305.168	
	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA Banca Monte dei Paschi di Siena SpA <sup>(c)</sup>	EUR	3,625 % 5,375 %	24/09/2024 18/01/2028	212.250	0,29 0,20
	Banco BPM SpA <sup>(c)</sup>	EUR	5,000 %	14/09/2030	213.500	0,20
	Banco BPM SpA <sup>(c)</sup>	EUR		14/01/2031	100.403	0,20
	Banco BPM SpA <sup>(c)</sup>	EUR	3,250 % 6,125 %	Perp.	414.000	0,08
	Banco BPM SpA <sup>(c)</sup>	EUR	6,500 %	Perp.	213.500	0,38
	Brunello Bidco SpA	EUR	3,500 %	15/02/2028	198.184	0,19
	Centurion Bidco SpA	EUR	5,875 %	30/09/2026	280.292	0,26
	doValue SpA	EUR	3,375 %	31/07/2026	300.570	0,28
	EVOCA SpA <sup>(c)</sup>	EUR	4,250 %	01/11/2026	195.008	0,28
	Gamma Bidco SpA	EUR	5,125 %	15/07/2025	423.840	0,40
	IMA Industria Macchine Automatiche SpA	EUR	3,750 %	15/01/2028	196.553	0,19
	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	EUR	1,875 %	08/07/2026	208.236	0,20
	Intesa Sanpaolo SpA <sup>(c)</sup>	EUR	5,875 %	04/03/2029	109.750	0,10
	Intesa Sanpaolo SpA <sup>(c)</sup>	EUR	4,375 %	12/07/2029	215.000	0,20
	Intesa Sanpaolo SpA	GBP	5,148 %	10/06/2030	397.650	0,27
	Intesa Sanpaolo SpA <sup>(c)</sup>	EUR	6,250 %	Perp.	214.625	0,20
	Intesa Sanpaolo Vita SpA	EUR	2,375 %	22/12/2030	244.750	0,23
	Kedrion SpA	EUR	3,375 %	15/05/2026	197.963	0,19
	Leather 2 SpA <sup>(c)</sup>	EUR	4,500 %	30/09/2028	99.685	0,09
	Mooney Group SpA(c)	EUR	3,875 %	17/12/2026	174.796	0,17
	Nexi SpA	EUR	2,125 %	30/04/2029	682.762	0,64
	Sisal Group SpA	EUR	7,000 %	31/07/2023	138.864	0,13
	Telecom Italia SpA	EUR	2,750 %	15/04/2025	508.832	0,48
	Telecom Italia SpA	EUR	2,875 %	28/01/2026	202.374	0,19
	Telecom Italia SpA	EUR	1,625 %	18/01/2029	459.197	0,43
	Telecom Italia SpA	EUR	5,250 %	17/03/2055	210.695	0,20
	UniCredit SpA <sup>(c)</sup>	EUR	2,731 %	15/01/2032	202.250	0,19
	UniCredit SpA <sup>(c)</sup>	USD	5.459 %	30/06/2035	337.873	0,32
	UniCredit SpA <sup>(c)</sup>	EUR	6,625 %	Perp.	209.750	0,20
	Unipol Gruppo SpA	EUR	3,000 %	18/03/2025	217.222	0,20
	Verde Bidco SpA	EUR	4,625 %	01/10/2026	356.814	0,34
					10.081.054	9,49
Japón 650 000	SoftBank Group Corp.	EUR	3,125 %	19/09/2025	648.083	0,61
	SoftBank Group Corp.	EUR	3,125 %	06/07/2029	345.433	0,81
					993.516	0,93
Jersey						
	Adient Global Holdings Ltd.	EUR	3,500 %	15/08/2024	429.054	0,40
150.000	CPUK Finance Ltd.	GBP	4,875 %	28/08/2025	176.957	0,17
Luvamb					606.011	0,57
Luxemburgo 100.000	ADLER Group S.A.	EUR	3,250 %	05/08/2025	88.510	0,08
	ADLER Group S.A.	EUR	2,250 %	27/04/2027	602.350	0,57
	ADLER Group S.A.	EUR	2,250 %	14/01/2029	166.562	0,16
	Altice Financing S.A.	EUR	3,000 %	15/01/2028	514.723	0,48
			-,		3 · · · · = 0	0,40

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

					Valor de mercado	
enencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	en EUR	% de patrimoni
	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					
Bonos – (con .uxemburgo –	· (continuación)					
_	Altice Finco S.A.	EUR	4,750 %	15/01/2028	278.700	0,2
	Altice France Holding S.A.	EUR	8,000 %	15/05/2027	633.990	0,6
350.000	ARD Finance S.A.	EUR	5,000 %	30/06/2027	356.356	0,3
250.000	Arena Luxembourg Finance SARL	EUR	1,875 %	01/02/2028	234.920	0,2
100.000	B&M European Value Retail S.A.	GBP	4,000 %	15/11/2028	118.004	0,1
	Cidron Aida Finco SARL	EUR	5,000 %	01/04/2028	297.517	0,2
	Cidron Aida Finco SARL	GBP	6,250 %	01/04/2028	117.077	0,
	Cirsa Finance International SARL	EUR	4,500 %	15/03/2027	240.460	0,2
	Dana Financing Luxembourg SARL	EUR	3,000 %	15/07/2029	224.708	0,2
	InPost S.A. Kleopatra Holdings 2 S.C.A.	EUR EUR	2,250 % 6,500 %	15/07/2027 01/09/2026	294.036 258.965	0,2 0,2
	LHMC Finco 2 SARL	EUR	7,250 %	02/10/2025	449.180	0,2
	Lincoln Financing SARL	EUR	3,625 %	01/04/2024	552.200	0,5
	Matterhorn Telecom S.A.	EUR	3,125 %	15/09/2026	98.033	0,0
	Motion Finco SARL	EUR	7,000 %	15/05/2025	208.860	0,2
100.000	Picard Bondco S.A.	EUR	5,375 %	01/07/2027	97.977	0,0
300.000	Sani Via Ikos Financial Holdings 1 SARL	EUR	5,625 %	15/12/2026	300.994	0,2
565.000	Telecom Italia Finance S.A.	EUR	7,750 %	24/01/2033	738.240	0,6
100.000	Telenet Finance Luxembourg Notes SARL	EUR	3,500 %	01/03/2028	102.415	0,
200.000	Telenet Finance Luxembourg Notes SARL	USD	5,500 %	01/03/2028	181.702	0,
300.000	Vivion Investments SARL	EUR	3,000 %	08/08/2024	287.970	0,2
					7.589.038	7,
léxico						
200.000	Banco Mercantil del Norte S.A.(c)	USD	5,875 %	Perp.	172.671	0,
390.000	Banco Mercantil del Norte S.A.(c)	USD	6,875 %	Perp.	346.023	0,
					518.694	0,4
aíses Bajos						
-	Ashland Services BV	EUR	2,000 %	30/01/2028	307.036	0,3
175.000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV	EUR	3,750 %	15/01/2025	176.664	0,
100.000	Compact Bidco BV	EUR	5,750 %	01/05/2026	93.238	0,0
300.000	Energizer Gamma Acquisition BV	EUR	3,500 %	30/06/2029	287.475	0,3
300.000	Goodyear Europe BV	EUR	2,750 %	15/08/2028	304.497	0,2
	Intertrust Group BV	EUR	3,375 %	15/11/2025	355.848	0,3
	IPD 3 BV	EUR	5,500 %	01/12/2025	204.450	0,
	Kongsberg Actuation Systems BV	EUR	5,000 %	15/07/2025	301.928	0,
	OCI NV OI European Group BV	EUR EUR	3,625 % 3,125 %	15/10/2025 15/11/2024	206.140 358.522	0, 0,
	OI European Group BV	EUR	2,875 %	15/02/2025	100.378	0,
	Q-Park Holding I BV	EUR	1,500 %	01/03/2025	264.635	0,
	Q-Park Holding I BV	EUR	2,000 %	01/03/2027	95.180	0,0
	Repsol International Finance BV <sup>(c)</sup>	EUR	2,500 %	Perp.	198.360	0,
	Repsol International Finance BV <sup>(c)</sup>	EUR	3,750 %	Perp.	289.259	0,2
	Schoeller Packaging BV	EUR	6,375 %	01/11/2024	205.130	0,
200.000	Sensata Technologies BV	USD	4,000 %	15/04/2029	177.528	0,
400.000	Sigma Holdco BV	EUR	5,750 %	15/05/2026	369.546	0,3
	Telefonica Europe BV <sup>(c)</sup>	EUR	2,376 %	Perp.	189.676	0,
	Telefonica Europe BV <sup>(c)</sup>	EUR	2,502 %	Perp.	100.267	0,0
	Telefonica Europe BV <sup>(c)</sup>	EUR	3,875 %	Perp.	422.220	0,4
	Telefonica Europe BV <sup>(c)</sup>	EUR	4,375 %	Perp.	321.480	0,3
	Telefonica Europe BV – Serie NC5 <sup>(c)</sup>	EUR	3,000 %	Perp.	103.245	0,
	TenneT Holding BV <sup>(c)</sup>	EUR	2,374 %	Perp.	310.425	0,:
	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	EUR	4,500 %	01/03/2025	210.339	0,
	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	USD	3,150 % 5.125 %	01/10/2026	247.836	0,
	Titan Holdings II BV Trivium Packaging Finance BV	EUR EUR	5,125 % 3,750 %	15/07/2029 15/08/2026	124.306 250.589	0, 0,
	United Group BV	EUR	3,750 % 3,125 %	15/02/2026	624.897	0,.
	United Group BV	EUR	4,625 %	15/08/2028	149.250	0,
	Wintershall Dea Finance 2 BV – Serie NC8 <sup>(c)</sup>	EUR	3,000 %	Perp.	195.320	0,
	Wintershall Dea Finance BV – Serie NC5 <sup>(c)</sup>	EUR	2,499 %	Perp.	98.415	0,0
	Ziggo Bond Co. BV	EUR	3,375 %	28/02/2030	487.245	0,
	Ziggo BV	EUR	2,875 %	15/01/2030	99.255	0,0
					8.230.579	7,7
loruega						

			T:	,	Valor de mercado	0/ •
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en EUR	% de patrimoni
Bonos – (cor	<u> </u>					
Panamá						
100.000	Carnival Corp.	EUR	10,125 %	01/02/2026	111.856	0,1
100.000	Carnival Corp.	EUR	7,625 %	01/03/2026	104.632	0,1
					216.488	0,2
Portugal						
	Banco Comercial Portugues S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	3,871 %	27/03/2030	397.360	0,3
	Banco Comercial Portugues S.A.(c)	EUR	4,000 %	17/05/2032	196.550	0,1
300.000	DEDP - Energias de Portugal S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	1,700 %	20/07/2080	299.625	0,2
					893.535	0,8
Rumanía						
200.000	RCS & RDS S.A.	EUR	2,500 %	05/02/2025	197.036	0,1
España	D	EUD	5.050.0/	07/44/0004	440.000	
	Banco de Credito Social Cooperativo S.A. (c)	EUR	5,250 %	27/11/2031	416.930	0,3
	) Banco de Sabadell S.A.	EUR	5,625 %	06/05/2026	229.334	0,2
	) Banco de Sabadell S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	5,375 %	12/12/2028	323.400	0,3
	Banco de Sabadell S.A.(c)	EUR	2,000 %	17/01/2030	195.500	0,1
	Banco de Sabadell S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	5,000 %	Perp.	197.440	0,1
	CaixaBank S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	6,375 %	Perp.	213.582	0,2
	Cellnex Finance Co., S.A.	EUR	1,250 %	15/01/2029	480.060	0,4
	Cellnex Telecom S.A.	EUR	1,875 %	26/06/2029	200.399	0,1
300.000	Cellnex Telecom S.A.	EUR	1,750 %	23/10/2030	289.599	0,2
150.000	Gestamp Automocion S.A.	EUR	3,250 %	30/04/2026	151.016	0,1
400.000	Grifols Escrow Issuer S.A.	EUR	3,875 %	15/10/2028	399.666	0,3
100.000	Grifols S.A.	EUR	1,625 %	15/02/2025	99.822	0,0
300.000	Grifols S.A.	EUR	3,200 %	01/05/2025	300.360	0,2
200.000	Grifols S.A.	EUR	2,250 %	15/11/2027	200.254	0,1
100.000	Grupo Antolin-Irausa S.A.	EUR	3,375 %	30/04/2026	96.485	0,0
200.000	Grupo Antolin-Irausa S.A.	EUR	3,500 %	30/04/2028	186.516	0,1
200.000	) Ibercaja Banco S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	2,750 %	23/07/2030	201.160	0,1
200.000	) Iberdrola Finanzas S.A.(c)	EUR	1,575 %	Perp.	199.250	0,1
	International Consolidated Airlines Group S.A.	EUR	2,750 %	25/03/2025	578.961	0,5
	International Consolidated Airlines Group S.A.	EUR	1,500 %	04/07/2027	87.700	0,0
	Lorca Telecom Bondco S.A.	EUR	4,000 %	18/09/2027	657.364	0,6
	Via Celere Desarrollos Inmobiliarios S.A.	EUR	5,250 %	01/04/2026	255.969	0,2
					5.960.767	5,6
Supranaciona	ales					
•	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp. Via Atlas					
	Luxco 4 SARL	EUR	3,625 %	01/06/2028	313.248	0,2
350.000	<ul> <li>Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp. Via Atlas Luxco 4 SARL</li> </ul>	GBP	4,875 %	01/06/2028	396.412	0,3
375.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC Via Ardagh Metal Packaging					
	Finance Plc.	EUR	3,000 %	01/09/2029	366.157	0,3
	Ardagh Packaging Finance Plc. Via Ardagh Holdings USA, Inc.	EUR	2,125 %	15/08/2026	165.944	0,1
	Ardagh Packaging Finance Plc. Via Ardagh Holdings USA, Inc.	GBP	4,750 %	15/07/2027	235.248	0,2
400.000	Canpack S.A. Via Canpack US LLC	EUR	2,375 %	01/11/2027	400.882	0,3
225.000	Clarios Global LP Via Clarios US Finance Co.	EUR	4,375 %	15/05/2026	230.344	0,2
100.000	Clarios Global LP Via Clarios US Finance Co.	USD	8,500 %	15/05/2027	92.750	0,0
375.000	Paysafe Finance Plc. Via Paysafe Holdings US Corp.	EUR	3,000 %	15/06/2029	351.278	0,3
					2.552.263	2,4
Suecia						
300.000	Akelius Residential Property AB <sup>(c)</sup>	EUR	2,249 %	17/05/2081	291.795	0,2
525.000	Heimstaden Bostad AB <sup>(c)</sup>	EUR	3,625 %	Perp.	520.039	0,4
200.000	Heimstaden Bostad AB <sup>(c)</sup>	EUR	3,000 %	Perp.	189.960	0,1
	Intrum AB	EUR	3,125 %	15/07/2024	250.175	0,2
	Intrum AB	EUR	4,875 %	15/08/2025	387.092	0,3
	Intrum AB	EUR	3,500 %	15/07/2026	201.874	0,1
	Intrum AB	EUR	3,000 %	15/09/2027	97.753	0,0
	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB <sup>(c)</sup>	EUR	2,624 %	Perp.	299.464	0,2
200.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB <sup>(c)</sup>	EUR	2,875 %	Perp.	194.570	0,1
100.000	Verisure Holding AB	EUR	3,500 %	15/05/2023	100.930	0,1
	Verisure Holding AB <sup>(c)</sup>	EUR	4,751 %	15/04/2025	101.344	0,1
100.000		EUD	3,875 %	15/07/2026	407.864	0,3
	Verisure Holding AB	EUR	3,073 /0	.0.02020		0,0
400.000	)Verisure Holding AB )Verisure Holding AB	EUR	3,250 %	15/02/2027	323.604	0,3
400.000 325.000						

					Valor de mercado	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en EUR	% del patrimonio
Bonos - (con	itinuación)					
Reino Unido						
	Anglian Water Osprey Financing Plc.	GBP	5,000 %	30/04/2023	183.074	0,17
	Anglian Water Osprey Financing Plc.	GBP GBP	4,000 %	08/03/2026	127.162	0,12
	Barclays Plc. <sup>(c)</sup> BCP V Modular Services Finance II Plc.	EUR	5,875 %	Perp.	243.752	0,23 0,47
	BCP V Modular Services Finance II Fig. BCP V Modular Services Finance Plc.	EUR	4,750 % 6,750 %	30/11/2028 30/11/2029	498.750 96.959	0,47
	Bellis Acquisition Co. Plc.	GBP	4,500 %	16/02/2026	155.864	0,09
	Bellis Acquisition Co., Plc.	GBP	3,250 %	16/02/2026	723.457	0,68
	Bellis Finco Plc.	GBP	4,000 %	16/02/2027	190.825	0,18
	BUPA Finance Plc. (c)	GBP	4,000 %	Perp.	222.764	0,21
	Carnival Plc.	EUR	1,000 %	28/10/2029	73.716	0,07
300.000	Constellation Automotive Financing Plc.	GBP	4,875 %	15/07/2027	343.222	0,32
250.000	Deuce Finco Plc.	GBP	5,500 %	15/06/2027	292.922	0,28
475.000	EC Finance Plc.	EUR	3,000 %	15/10/2026	485.051	0,46
300.000	eG Global Finance Plc.	EUR	4,375 %	07/02/2025	295.536	0,28
200.000	eG Global Finance Plc.	EUR	6,250 %	30/10/2025	202.351	0,19
325.000	Ellaktor Value Plc.	EUR	6,375 %	15/12/2024	308.678	0,29
250.000	Gatwick Airport Finance Plc.	GBP	4,375 %	07/04/2026	290.302	0,27
	Heathrow Finance Plc.	GBP	6,250 %	03/03/2025	312.451	0,29
	Heathrow Finance Plc.(e)	GBP	4,375 %	01/03/2027	233.297	0,22
	INEOS Quattro Finance 2 Plc.	EUR	2,500 %	15/01/2026	172.749	0,16
	International Game Technology Plc.	EUR	3,500 %	15/07/2024	209.206	0,20
	International Game Technology Plc.	EUR	3,500 %	15/06/2026	152.670	0,14
	International Game Technology Plc.	EUR	2,375 %	15/04/2028	97.991	0,09
	Iron Mountain UK Plc.	GBP	3,875 %	15/11/2025	295.518	0,28
	Jaguar Land Rover Automotive Plc.	EUR	2,200 %	15/01/2024	500.086	0,47
	Jaguar Land Rover Automotive Plc.	EUR	4,500 %	15/07/2028	101.258	0,10
	Maison Finco Plc.	GBP	6,000 %	31/10/2027	239.425	0,23
	Matalan Finance Plc.	GBP	6,750 %	31/01/2023	464.597	0,44
	Matalan Finance Plc.	GBP	9,500 %	31/01/2024	87.153	0,08
	Miller Homes Group Holdings Plc.	GBP	5,500 %	15/10/2024	118.958	0,11
	Modulaire Global Finance Plc.	EUR	6,500 %	15/02/2023	405.664	0,38
	National Express Group Plc. <sup>(c)</sup> NGG Finance Plc. <sup>(c)</sup>	GBP EUR	4,250 %	Perp.	179.338	0,17
	Pinewood Finance Co., Ltd.	GBP	2,125 %	05/09/2082 30/09/2025	199.904 472.693	0,19 0,44
	Pinewood Finance Co., Ltd.	GBP	3,250 % 3,625 %	15/11/2027	116.843	0,44
	Pinnacle Bidco Plc.	EUR	5,500 %	15/02/2025	307.500	0,11
	Premier Foods Finance Plc.	GBP	3,500 %	15/10/2026	287.973	0,29
	Punch Finance Plc.	GBP	6,125 %	30/06/2026	324.003	0,30
	Rolls-Royce Plc.	EUR	0,875 %	09/05/2024	221.866	0,21
	Rolls-Royce Plc.	EUR	4,625 %	16/02/2026	221.626	0,21
	SIG Plc.	EUR	5,250 %	30/11/2026	350.950	0,33
	Standard Chartered Plc. (c)	USD	4,750 %	Perp.	171.595	0,16
	Stonegate Pub Co. Financing 2019 Plc.	GBP	8,250 %	31/07/2025	567.432	0,53
	Synthomer Plc.	EUR	3,875 %	01/07/2025	308.239	0,29
	Thames Water Kemble Finance Plc.	GBP	5,875 %	15/07/2022	120.205	0,11
100.000	Thames Water Kemble Finance Plc.	GBP	4,625 %	19/05/2026	120.956	0,11
375.000	TI Automotive Finance Plc.	EUR	3,750 %	15/04/2029	379.243	0,36
100.000	Travis Perkins Plc.	GBP	3,750 %	17/02/2026	121.656	0,11
	Very Group Funding Plc.	GBP	6,500 %	01/08/2026	233.560	0,22
	Virgin Media Secured Finance Plc.	GBP	5,000 %	15/04/2027	393.617	0,37
	Virgin Media Secured Finance Plc.	GBP	5,250 %	15/05/2029	122.832	0,12
	Virgin Money UK Plc. <sup>(c)</sup>	GBP	9,250 %	Perp.	260.537	0,25
400.000	Vmed O2 UK Financing I Plc.	GBP	4,000 %	31/01/2029	461.849	0,43
	Vmed O2 UK Financing I Plc.	EUR	3,250 %	31/01/2031	275.231	0,26
	Vmed O2 UK Financing I Plc.	GBP	4,500 %	15/07/2031	117.388	0,11
	Vodafone Group Plc.(c)	GBP	4,875 %	03/10/2078	685.566	0,65
	Vodafone Group Plc.(c)	EUR	2,625 %	27/08/2080	101.510	0,10
	Vodafone Group Plc.(c)	EUR	3,000 %	27/08/2080	100.930	0,10
100.000	William Hill Ltd.	GBP	4,875 %	07/09/2023	119.119	0,11
					15.469.569	14,56
Estados Unido		1105	4 605 0/	04/00/0000	400.004	0.40
	AdaptHealth LLC	USD	4,625 %	01/08/2029	128.861	0,12
	ADT Security Corp.	USD	4,125 %	01/08/2029	215.077	0,20
	Arches Buyer, Inc.	USD	6,125 %	01/12/2028	18.733	0,02
	Avantor Funding, Inc.	EUR	3,875 %	15/07/2028	302.119	0,28
	Ball Corp.	USD	2,875 %	15/08/2030	167.860	0,16
	Banff Merger Sub, Inc.	EUR	8,375 %	01/09/2026	104.935	0,10
	Belden, Inc.	EUR	3,875 %	15/03/2028	309.828	0,29
150.000	Belden, Inc.	EUR	3,375 %	15/07/2031	155.055	0,15

			Ti	,	/alor de mercado	0/
nencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	en EUR	% c patrimon
nos – (con	ntinuación)					
•	os – (continuación)					
150.000	Berry Global, Inc.	EUR	1,000 %	15/01/2025	150.804	0,
200.000	Boxer Parent Co., Inc.	EUR	6,500 %	02/10/2025	209.920	0
200.000	Catalent Pharma Solutions, Inc.	EUR	2,375 %	01/03/2028	199.572	0,
150.000	Colfax Corp.	EUR	3,250 %	15/05/2025	151.284	0
525.000	Coty, Inc.	EUR	4,000 %	15/04/2023	525.231	0
100.000	Crown Americas LLC Via Crown Americas Capital Corp. "V"	USD	4,250 %	30/09/2026	93.158	0
140.000	CrownRock LP Via CrownRock Finance, Inc. "F"	USD	5,000 %	01/05/2029	124.269	0
100.000	Encore Capital Group, Inc.	GBP	5,375 %	15/02/2026	121.507	0
100.000	Encore Capital Group, Inc.	GBP	4,250 %	01/06/2028	115.513	0
93.000	Ford Motor Co.	USD	3,250 %	12/02/2032	81.211	0
200.000	Ford Motor Credit Co., LLC	USD	4,140 %	15/02/2023	180.419	0
	Ford Motor Credit Co., LLC	GBP	2,748 %	14/06/2024	236.506	0
	Ford Motor Credit Co., LLC	EUR	1,744 %	19/07/2024	788.470	0
	Ford Motor Credit Co., LLC	EUR	3,250 %	15/09/2025	187.175	0
	Graphic Packaging International LLC	EUR	2,625 %	01/02/2029	100.907	0
	IQVIA, Inc.	EUR	2,250 %	15/01/2028	350.921	0
	IQVIA, Inc.	EUR	2,875 %	15/06/2028	306.687	0
	IQVIA, Inc.	EUR	2,250 %	15/03/2029	99.131	0
	Kraft Heinz Foods Co.	GBP	4,125 %	01/07/2027	130.405	0
	Kraft Heinz Foods Co.	USD	4,375 %	01/06/2046	481.276	0
	Kraton Polymers LLC Via Kraton Polymers Capital Corp.	EUR	5,250 %	15/05/2026	102.554	0
		EUR				
	Liberty Mutual Group, Inc. <sup>(c)</sup>		3,625 %	23/05/2059	205.500	0
	MasTec, Inc.	USD	4,500 %	15/08/2028	204.909	0
	Mauser Packaging Solutions Holding Co.	EUR	4,750 %	15/04/2024	248.333	0
	MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.	GBP	2,550 %	05/12/2023	209.234	0
	MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.	USD	4,625 %	01/08/2029	184.346	C
	MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.	GBP	3,375 %	24/04/2030	272.449	0
	MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.	USD	3,500 %	15/03/2031	69.862	0
	Netflix, Inc.	EUR	3,625 %	15/05/2027	856.657	0
425.000	Occidental Petroleum Corp.	USD	7,875 %	15/09/2031	487.432	0
	Olympus Water US Holding Corp.	EUR	3,875 %	01/10/2028	99.843	0
450.000	Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV	EUR	2,875 %	30/04/2028	452.293	0
	Primo Water Holdings, Inc.	EUR	3,875 %	31/10/2028	102.838	0
100.000	Scientific Games International, Inc.	EUR	3,375 %	15/02/2026	101.171	0
150.000	Scientific Games International, Inc.	EUR	5,500 %	15/02/2026	153.680	0
100.000	Silgan Holdings, Inc.	EUR	3,250 %	15/03/2025	100.819	0
200.000	Silgan Holdings, Inc.	EUR	2,250 %	01/06/2028	199.540	0
300.000	Spectrum Brands, Inc.	EUR	4,000 %	01/10/2026	306.054	0
500.000	Standard Industries, Inc.	EUR	2,250 %	21/11/2026	485.125	0
150.000	Talen Energy Supply LLC	USD	7,250 %	15/05/2027	122.929	0
	Tenet Healthcare Corp.	USD	6,125 %	01/10/2028	127.945	0
	Tenneco, Inc.	USD	5,125 %	15/04/2029	107.110	0
300.000	UGI International LLC	EUR	2,500 %	01/12/2029	296.319	0
	WMG Acquisition Corp.	EUR	2,750 %	15/07/2028	206.210	0
	WMG Acquisition Corp.	EUR	2,250 %	15/08/2031	189.232	0
	Yum! Brands, Inc.	USD	4.625 %	31/01/2032	179.725	0
200.000	Tall Stands, Inc.	002		0.00.02002	12.108.943	11.
TAL DE BO	NOS	,			12.100.040	• • • • • • • • • • • • • • • • • • • •
ste EUR 99					99.891.629	94
					Valor de mercado en	%
nencias	Descripción del valor				EUR	patrimo
ndos de in	versión – 2,47 %					
anda						
	Goldman Sachs Euro Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de	acumulación X) <sup>(f)</sup>	(g)		2.617.117	2
TAL DE FO	NDOS DE INVERSIÓN 618.252)				2.617.117	2

March   Marc	Tenencias	Descripción del valor		Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>()</sup>	Valor de mercado en EUR	% de
Storost - 1,4 2	Valores mobi	· · · · ·	ercado regulado					•
March   Marc		-	o.ou.uo .ogu.uuo					
Name	Italia							
Page	400.000	Intesa Sanpaolo SpA 144A(c)(d)		USD	4,198 %	01/06/203	2 351.582 	0,33
Pales   Bailon	Luxemburgo	Talanat Financa I amanda ama Na	0.0 DL 4.44.0 (d)	LIOD	5 500 W	04/00/000	. 404.700	0.45
Total De   De   De   De   De   De   De   De		Telenet Finance Luxembourg No	otes SARL 144A(4)	090	5,500 %	01/03/202	8 181.702	0,17
		Diamond BC BV 144A <sup>(d)</sup>		USD	4.625 %	01/10/202	9 146.977	0,14
150000 Alien Media LL CVia Alien Media Co-lissue; Inc. 144A <sup>(0)</sup> USD 1,050 % 150022002 150.072 0, 0.275.00 (Clearway Energy Operating LLC HA4A <sup>(0)</sup> USD 3,750 % 15012032 228.663 0, 0.275.00 (Clearway Energy Operating LLC HA4A <sup>(0)</sup> USD 3,750 % 15012032 228.663 0, 0.275.00 http://doi.org/10.10000000000000000000000000000000000	Estados Unido							
275000   Clearway Energy Operating LLC V144H04   USD   3,75%   010042032   238,865   0.0     2500.00   HIF Pinancing SARL LLC Via Herbaldine International, inc. 144A <sup>(1)</sup>   USD   5,75%   01062032   239,005   0.0     2500.00   HIF Pinancing SARL LLC Via Herbaldine International, inc. 144A <sup>(1)</sup>   USD   5,750 %   1509/2031   121,005   0.0     2500.00   HIF Pinancing SARL LLC Via Herbaldine International, inc. 144A <sup>(1)</sup>   USD   5,750 %   1509/2031   121,005   0.0     2500.00   HIF Pinancing SARL LLC Via Herbaldine International Inc. 144A <sup>(1)</sup>   USD   5,750 %   1509/2031   121,005   0.0     2500.00   HIF Pinancing SARL LLC Via Herbaldine International Inc. 144A <sup>(1)</sup>   USD   5,750 %   1509/2031   121,005   0.0     2500.00   HIF Pinancing SARL LLC Via Herbaldine International Inc. 144A <sup>(1)</sup>   USD   15,750 %   1509/2031   121,005   0.0     2500.00   HIF Pinancing SARL LLC Via Herbaldine International Inc. 144A <sup>(1)</sup>   USD   15,750 %   1509/2031   121,005   0.0     2500.00   HIF Pinancing SARL LLC Via Herbaldine International Inc. 144A <sup>(1)</sup>   USD   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/2031   15,907/20			a Co-Issuer, Inc. 144A(d)	USD	10,500 %	15/02/202	8 146.779	0,14
2000   H.F. Financial SARCLLC Via Heficialite International, Inc. 144A <sup>(6)</sup> USD 5,750 % 1509/2021 2105 50 0.0 142 200 PennyMac Financial Services, Inc. 144A <sup>(6)</sup> USD 5,750 % 1509/2021 1205 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0 1509/2021 2105 50 0.0	129.000	Arches Buyer, Inc. 144A <sup>(d)</sup>		USD	6,125 %	01/12/202	8 115.072	0,11
142 000 PennyMare Financial Services. Inc. 144A® USD 5,750 15092031 121053 0.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.0 525.470 5.					3,750 %			0,22
TOTAL DE BONOS   1,509,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731   1,109,731		-						0,20
Total DE BONS   Total DE BONS   Total DE BLONS   Total DE WALDES MOBILIARIOS NEGOLADOS EN OTRO MERCADO REGULADO   Total DE WALDES MOBILIARIOS NEGOLADOS EN OTRO MERCADO REGULADO   Total DE WALDES MOBILIARIOS NEGOLADOS EN OTRO MERCADO REGULADO   Total DE WALDES HASA3)   Total DE WALDES HASA3)   Total DE WALDES HASA3	142.000	PennyMac Financial Services, Ir	nc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,750 %	15/09/203	1 121.053	0,11
							829.470	0,78
							1.509.731	1,42
VALIOR DE MERCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS   104.018.477   97.1			ADOS EN OTRO MERCADO REGUL	ADO			1 509 731	1 45
Contratos de Intura - (0,10 %)   Contratos (1,10 %)   C	<u>`</u>		EXCLUYENDO DERIVADOS				1.309.731	1,42
Numero de Contratos   Descripción del valor   Para de Les Signatos   Para de Les Signato			EXCECTENDO DENIVADOS				104.018.477	97,91
Nomination of contration         contration         contration         de la singuacida (specification)         stante or patriation         % of patriation           USD         (569) 385         (569) 385         (13,622)         (0,00)         (3,00)         (218,501)         (34,000)         (0,00)         (0,00)         (3,00)         (218,501)         (34,000)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00)         (0,00	Contratos de fu	turos – (0,10 %)						
Secripide del valor								
	Número de contratos	Descripción del valor						% de patrimonio
(19) Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Corta (2.188.501) (3.4 060) (0.0 (3.5 uturos sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022 Corta (577.466) (2.040) (0.0 (17) Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022 Corta (1.818.183) (18.842) (0.0 (17) Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022 Corta (1.550.127) (6.063) (0.0 (12) Futuros sobre ponos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022 Corta (1.550.127) (29.908) (0.0 (12) Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022 Corta (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908) (0.0 (1.550.127) (29.908		USD						
(3) Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022 Cota (577.466) (2.040) (0.0 (17) Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022 Cota (1.818.183) (18.942) (0.0 (17) Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022 Cota (1.75.550) (6.063) (0.0 (12) Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022 Cota (1.75.550) (6.063) (0.0 (12) Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022 Cota (1.550.127) (29.908) (0.0 (6.879.212) (104.535) (0.1 (1.550.127) (29.908) (0.0 (6.879.212) (104.535) (0.1 (1.550.127) (29.908) (0.0 (6.879.212) (104.535) (0.1 (1.550.127) (29.908) (0.0 (6.879.212) (104.535) (0.1 (1.550.127) (1.550.127) (1.0 (1.550.127) (1.0 (1.550.127) (1.0 (1.550.127) (1.0 (1.550.127) (1.0 (1.550.127) (1.0 (1.550.127) (1.0 (1.550.127) (1.0 (1.550.127) (1.0 (1.550.127) (1.0 (1.550.127) (1.0 (1.0 (1.550.127) (1.0 (1.0 (1.0 (1.550.127) (1.0 (1.0 (1.0 (1.0 (1.0 (1.0 (1.0 (1.0			• .			,	, , ,	(0,01)
Contractos de divisas a plazo − 0,19   Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a funy largo plazo 22/03/2022   Corta (1.818.183) (18.842) (0.00 (17.550) (17.550) (6.063) (0.00 (17.550) (17.550) (6.063) (0.00 (17.550) (17.550) (6.063) (0.00 (17.550) (17.550) (17.550) (0.00 (17.550) (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550) (0.00 (17.550)						•		(0,03)
Tuturos sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022   Corta (175.550) (6.063) (0.0 (12) Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022   Corta (1.550.127) (29.908) (0.0 (0.0 (6.879.212) (104.535) (0.1 (1.550.127) (29.908) (0.0 (6.879.212) (104.535) (0.1 (1.550.127) (29.908) (0.0 (6.879.212) (104.535) (0.1 (1.550.127) (29.908) (0.0 (6.879.212) (104.535) (0.1 (1.550.127) (29.908) (0.0 (6.879.212) (104.535) (0.1 (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.550.127) (1.						•		(0,00
(12) Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022  (29 08) (0.0 (6.879.212) (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0.1 (104.535) (0				2022		•	, , ,	
						•		(0,01)
MINUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATUS DE FUTUROS   (0,1)	(:=)	r diarec cobre pagarec del 1000.	o do EE. OO. a may laigo placo a 10	4.100 22/00/2022				,
Contratos de divisas a plazo - 0,19 %   Compra   Divisa   Venta   Ve	MINUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRATOS	DE FUTUROS			(0.073.212	, ,	(0,10)
Divisa   Compra   Divisa   Venta   Venta   Divisa   Venta   Venta   Divisa   Venta   Divi	Contratos de	divisas a plazo – 0 19 %			,		( ,	(-, -,
Divisa         Compra         Divisa         Venta         de vencimiento         EUR         % de vencimiento         % de							Plusvalía	
EUR 12.112.713 GBP 10.236.999 21/01/2022 105.122 0.0 EUR 8.266.483 USD 9.310.829 10/02/2022 102.250 0.7  PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO  Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones - (0,19 %)  Divisa Compra Divisa Venta Fecha de vencimiento EUR Plusvalía latente en EUR 7.847 GBP 6.688 21/01/2022 2 0,0  PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA 2 0,0  PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA 2 0,0  EUR 148.949 SEK 1.531.017 20/01/2022 (283) (0,0  SEK 5.128.507 EUR 513.470 20/01/2022 (283) (0,0  GGBP 299.754 EUR 354.693 21/01/2022 (3.093) (0,0  PLN 4.856.814 EUR 1.039.195 10/02/2022 (181.046) (0,1  USD 17.832.690 EUR 15.817.704 10/02/2022 (181.046) (0,1	Distan	•					a latente en	% del
EUR   8.266.483   USD   9.310.829   10/02/2022   102.250   0.75		<u>-</u>						
PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO   Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones - (0,19 %)								0,09
Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones - (0,19 %)   Divisa   Compra   Divisa   Venta   Venta   Eur   Plusvalia de vencimiento   Plusvalia de venc				029		10/02/202		•
Divisa   Compra   Divisa   Venta   Venta   EUR   Plusvalia latente en patrimon   EUR   7.847   GBP   6.688   21/01/2022   2 0,000				0/)			201.312	0,13
Divisa   Compra   Divisa   Venta   Divisa   Divisa   Venta   Divisa   Divis	Contratos de	uivisas a piazo especificos o	ie una ciase de acciones - (0,19	70)			Pluevalía	
EUR   7.847   GBP   6.688   21/01/2022   2 0,0	Diviso	Comme Divis	en ve	onto			a latente en	% de
PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA   2 0,0								-
Divisa         Compra         Divisa         Venta         Eecha de vencimiento         Minusvalia latente en EUR         % de vencimiento           EUR         148.949         SEK         1.531.017         20/01/2022         (283)         (0,0           SEK         5.128.507         EUR         513.470         20/01/2022         (13.583)         (0,0           GBP         299.754         EUR         354.693         21/01/2022         (3.093)         (0,0           PLN         4.856.814         EUR         1.039.195         10/02/2022         (7.047)         (0,0           USD         17.832.690         EUR         15.817.704         10/02/2022         (181.046)         (0,1					COBERTURA	2 1/0 1/202		0,00
Divisa         Compra         Divisa         Venta         Fecha de vencimiento         latente en patrimon         % de vencimiento           EUR         148.949         SEK         1.531.017         20/01/2022         (283)         (0,0           SEK         5.128.507         EUR         513.470         20/01/2022         (13.583)         (0,0           GBP         299.754         EUR         354.693         21/01/2022         (3.093)         (0,0           PLN         4.856.814         EUR         1.039.195         10/02/2022         (7.047)         (0,0           USD         17.832.690         EUR         15.817.704         10/02/2022         (181.046)         (0,1							·	2,00
EUR       148.949       SEK       1.531.017       20/01/2022       (283)       (0,0         SEK       5.128.507       EUR       513.470       20/01/2022       (13.583)       (0,0         GBP       299.754       EUR       354.693       21/01/2022       (3.093)       (0,0         PLN       4.856.814       EUR       1.039.195       10/02/2022       (7.047)       (0,0         USD       17.832.690       EUR       15.817.704       10/02/2022       (181.046)       (0,1	Divisa	Compra Divis	ta V	onta			a latente en	% de
SEK         5.128.507         EUR         513.470         20/01/2022         (13.583)         (0,0           GBP         299.754         EUR         354.693         21/01/2022         (3.093)         (0,0           PLN         4.856.814         EUR         1.039.195         10/02/2022         (7.047)         (0,0           USD         17.832.690         EUR         15.817.704         10/02/2022         (181.046)         (0,1		<del>-</del>						•
GBP 299.754 EUR 354.693 21/01/2022 (3.093) (0,0 PLN 4.856.814 EUR 1.039.195 10/02/2022 (7.047) (0,0 PLN 17.832.690 EUR 15.817.704 10/02/2022 (181.046) (0,1 PLN 17.832.690 EUR 15.817.704							` '	
PLN 4.856.814 EUR 1.039.195 10/02/2022 (7.047) (0,0 USD 17.832.690 EUR 15.817.704 10/02/2022 (181.046) (0,1								(0,02
USD 17.832.690 EUR 15.817.704 10/02/2022 (181.046) (0,1	PLN						` ,	(0,00
MINUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA (205.052) (0,1	USD						. ,	(0,17
	MINUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRATOS	DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADO	OS CON FINES DE	COBERTURA		(205.052)	(0,19

Contratos de permutas financieras – (0	U,U2 %)
----------------------------------------	---------

Importe teórico local neto	de pen	mutas financieras – (0,02 %) A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en EUR	% del patrimonio
		Permutas de tipos de interés				-	
1.8	800.000	Fijo 0,000 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2028	9.027	0,01
PLUSVALÍA	A LATEN	ITE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE	INTERÉS			9.027	0,01
		LÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS				9.027	0,01
Immorto							
Importe teórico						Minusvalía	
local						latente en	% del
neto		A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	EUR	patrimonio
		Permutas de tipos de interés					
6.7	750.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2023	(5.676)	(0,01)
4.7	770.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2024	(6.659)	(0,01)
1.8	840.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2026	(11.465)	(0,01)
4	420.000	Fijo 0,000 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2031	(3.492)	(0,00)
(	610.000	Fijo 0,250 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2024	(2.449)	(0,00)
DE INTERÉ	S	NTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS VALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS				(29.741)	(0,03)
		IANCIERAS				(29.741)	(0,03)
VALOR DE (coste EUR		DO DE LAS INVERSIONES 0.493)				103.895.550	97,79
OTROS AC	TIVOS	PASIVOS				2.346.105	2,21
PATRIMON	IIO					106.241.655	100,00
TOTAL DE	INVERS	IONES				Valor de mercado en EUR	% del patrimonio
Total inversi	iones ex	cluyendo derivados (coste EUR 103.510	.493)			104.018.477	97,91
		obre contratos de futuros				(104.535)	(0,10)
Plusvalía la	itente sol	ore contratos de divisas a plazo				207.372	0,19
Plusvalía la	itente sol	ore contratos de divisas a plazo celebrac	los con fines de cobertura			2	0,00
Minusvalía	latente s	obre contratos de divisas a plazo celebra	ados con fines de cobertura			(205.052)	(0,19)
Plusvalía la	tente sol	ore contratos de permutas financieras				9.027	0,01
Minusvalía	latente s	obre contratos de permutas financieras				(29.741)	(0,03)
Otros activo	os y pasiv	vos				2.346.105	2,21
Patrimonio	)					106.241.655	100,00

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs International.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co.

International Plc., Natwest Markets Plc. y State Street Bank & Trust.

La contraparte de los contratos de permutas financieras fue Credit Suisse.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,10 %.

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (d) 144A. La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (e) Este título tiene un cupón escalonado que pasará al segundo tipo en una fecha determinada del futuro.
- (f) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- $^{(g)}\,$  EI rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del (0,627) %.

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - 87,52	liarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial 2 %					
Argentina 200.000	Bonos internacionales del Estado de Argentina <sup>(c)</sup>	USD	0,500 %	09/07/2030	63.000	0,15
Armenia						
200.000	Bono internacional de Armenia	USD	3,600 %	02/02/2031	184.146	0,43
Australia	Maranasia Barah (d)	HOD	2.050.0/	00/00/0000	407.000	0.40
	Macquarie Bank Ltd. <sup>(d)</sup> Westpac Banking Corp. <sup>(d)</sup>	USD USD	3,052 % 2,894 %	03/03/2036 04/02/2030	197.906 51.393	0,46 0,12
30.000	Westpac Banking Corp.	OOD	2,004 /0	04/02/2000	249.299	0,58
Benín						
100.000	Bonos internacionales del Estado de Benín	EUR	4,875 %	19/01/2032	108.949	0,25
Bermudas						
	NCL Corp., Ltd.	USD	3,625 %	15/12/2024	106.375	0,25
200 000	Banco do Brasil S.A. <sup>(d)</sup>	USD	6,250 %	Perp.	192.490	0,45
	BRF S.A.	USD	4,875 %	24/01/2030	196.706	0,45
			·		389.196	0,90
Islas Vírgenes						
	Fortune Star BVI Ltd.	USD	6,750 %	02/07/2023	203.500	0,47
200.000	Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	USD	2,125 %	30/09/2023	194.750 398.250	0,45
Camerún					396.230	0,92
	Bonos internacionales de Camerún	EUR	5,950 %	07/07/2032	137.474	0,32
Canadá	A: 0		0.075.0/	45/00/0000	70.000	0.40
	Air Canada	USD	3,875 %	15/08/2026	70.263	0,16
	Bank of Nova Scotia	GBP	1,250 %	17/12/2025	166.045	0,39
	Bausch Health Cos., Inc. Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc. Via Intelligent Packaging Ltd.	USD	5,000 %	30/01/2028	147.004	0,34
	Co-Issuer LLC	USD	6,000 %	15/09/2028	107.231	0,25
					490.543	1,14
Islas Caimán 195 213	Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	USD	4,350 %	05/04/2036	208.999	0,49
	Noble Finance Co.	USD	11,000 %	15/02/2028	10.831	0,02
	Transocean Poseidon Ltd.	USD	6,875 %	01/02/2027	85.360	0,20
	Transocean, Inc.	USD	11,500 %	30/01/2027	327.750	0,76
					632.940	1,47
Chile						
-	Inversiones CMPC S.A.	USD	3,000 %	06/04/2031	193.130	0,45
Dinamarca	Danske Bank A/S <sup>(d)</sup>	EUR	(0,018 %)	10/11/2024	113.903	0,27
	Danske Bank A/S <sup>(d)</sup>	EUR	1,375 %	12/02/2030	345.353	0,27
			·		459.256	1,07
República Don						
150.000	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	4,875 %	23/09/2032	149.693	0,35
Egipto	Person intermediate del 5 / 1 / 5 / 1		F 075 **	معتمد عدد	170 000	¥
	Bonos internacionales del Estado de Egipto Bonos internacionales del Estado de Egipto	USD USD	5,875 % 8,875 %	16/02/2031 29/05/2050	170.000 173.500	0,40 0,40
200.000	Bonos internacionales del Estado de Egipto	OOD		29/03/2030	343.500	0,40
Finlandia					3.0.000	3,00
	Citycon OYJ <sup>(d)</sup>	EUR	3,625 %	Perp.	109.569	0,25
Francia	Altica France C A	HOD	E 405 0/	45/07/0000	404 500	0
	Altice France S.A. CNP Assurances	USD EUR	5,125 % 0,375 %	15/07/2029 08/03/2028	191.500 110.118	0,44 0,26
	Électricité de France S.A. (d)	EUR	5,000 %	06/03/2026 Perp.	125.903	0,20
	La Mondiale SAM	EUR	0,750 %	20/04/2026	228.071	0,53

			Tipo de		Valor de mercado	% del
Bonos – (con	Descripción del valor utinuación)	Divisa	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en USD	patrimonio
Alemania						
100.000	ADLER Real Estate AG	EUR	3,000 %	27/04/2026	103.633	0,24
	Cheplapharm Arzneimittel GmbH	EUR	4,375 %	15/01/2028	233.718	0,54
50.000	Commerzbank AG	EUR	4,000 %	23/03/2026	62.838	0,15
	Commerzbank AG <sup>(d)</sup>	EUR	1,375 %	29/12/2031	111.652	0,26
150.000	Deutsche Bank AG <sup>(d)</sup>	USD	2,222 %	18/09/2024	152.557	0,35
300.000	Deutsche Bank AG <sup>(d)</sup>	USD	2,129 %	24/11/2026	300.894	0,70
205.000	Deutsche Bank AG <sup>(d)</sup>	USD	3,729 %	14/01/2032	210.654	0,49
200.000	Deutsche Bank AG <sup>(d)</sup>	EUR	4,625 %	Perp.	227.975	0,53
150.000	Deutsche Bank AG – Serie E	USD	0,962 %	08/11/2023	150.009	0,35
100.000	TUI Cruises GmbH	EUR	6,500 %	15/05/2026	110.355	0,26
100.000	Vonovia S.E.	EUR	0,625 %	14/12/2029	112.596	0,26
					1.776.881	4,13
India			/			
	Bharti Airtel Ltd.	USD	3,250 %	03/06/2031	408.810	0,95
Indonesia 200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III	USD	2,550 %	09/06/2031	201.125	0,47
Irlanda						
	AIB Group Plc. <sup>(d)</sup>	EUR	2,875 %	30/05/2031	119.301	0,28
200.000	AIB Group Plc. <sup>(d)</sup>	EUR	6,250 %	Perp.	247.253	0,57
100.000	Bank of Ireland Group Plc. (d)	EUR	1,375 %	11/08/2031	111.900	0,26
					478.454	1,11
Isla de Man		1105	0.075.0/	04/44/0000	400.000	2.42
	AngloGold Ashanti Holdings Plc.	USD	3,375 %	01/11/2028	198.000	0,46
200.000	Gohl Capital Ltd.	USD	4,250 %	24/01/2027	208.883	0,48
					406.883	0,94
200.000	Leviathan Bond Ltd. 144A <sup>(e)</sup>	USD	6,750 %	30/06/2030	210.616	0,49
Italia						
125.000	Aeroporti di Roma SpA	EUR	1,750 %	30/07/2031	145.879	0,34
100.000	Brunello Bidco SpA	EUR	3,500 %	15/02/2028	112.752	0,26
100.000	Enel SpA – Serie 6,5 a <sup>(d)</sup>	EUR	1,375 %	Perp.	110.886	0,26
250.000	Intesa Sanpaolo SpA	EUR	1,350 %	24/02/2031	279.829	0,65
					649.346	1,51
Costa de Marf						
-	Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	USD	6,375 %	03/03/2028	215.596	0,50
Kazajistán 200.000	KazMunayGas National Co., JSC	USD	3,500 %	14/04/2033	204.500	0,47
Luxemburgo						
100.000	Altice France Holding S.A.	EUR	8,000 %	15/05/2027	120.231	0,28
200.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR	2,200 %	24/07/2025	240.136	0,56
100.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR	1,625 %	20/04/2030	114.233	0,26
100.000	Helvetia Europe S.A.(d)	EUR	2,750 %	30/09/2041	123.208	0,29
100.000	Highland Holdings SARL	EUR	(0,081 %)	12/11/2023	114.005	0,26
117.000	Intelsat Jackson Holdings S.A.	USD	5,500 %	01/08/2023	58.500	0,14
100.000	Kleopatra Holdings 2 S.C.A.	EUR	6,500 %	01/09/2026	98.221	0,23
200.000	Logicor Financing SARL	EUR	3,250 %	13/11/2028	260.258	0,60
200.000	MHP Lux S.A.	USD	6,950 %	03/04/2026	200.477	0,46
100.000	Motion Finco SARL	EUR	7,000 %	15/05/2025	118.826	0,28
					1.448.095	3,36
México						
	Banco Mercantil del Norte S.A. <sup>(d)</sup>	USD	7,625 %	Perp.	215.281	0,50
	BBVA Bancomer S.A. <sup>(d)</sup>	USD	5,125 %	18/01/2033	203.700	0,47
	Mexico City Airport Trust	USD	5,500 %	31/10/2046	193.540	0,45
	Bonos internacionales del Estado de México	USD	2,659 %	24/05/2031	385.811	0,90
200.000	Trust Fibra Uno	USD	4,869 %	15/01/2030	212.949	0,49
Manus					1.211.281	2,81
Marruecos 200.000	Bonos internacionales del Estado de Marruecos	USD	3,000 %	15/12/2032	186.750	0,43
Países Bajos						·
200.000	ABN AMRO Bank NV <sup>(d)</sup>	EUR	4,375 %	Perp.	239.611	0,56

			Tipo de	(h)	Valor de mercado	% del
Tenencias Bonos – (con	Descripción del valor	Divisa	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en USD	patrimonio
•	(muacion) - (continuación)					
-	Cooperatieve Rabobank UA <sup>(d)</sup>	EUR	3,250 %	Perp.	229.898	0,53
75.000	Deutsche Telekom International Finance BV	USD	8,750 %	15/06/2030	110.090	0,26
90.000	Elastic NV	USD	4,125 %	15/07/2029	88.425	0,21
	Heimstaden Bostad Treasury BV	EUR	1,625 %	13/10/2031	171.924	0,40
	IHS Netherlands Holdco BV	USD	8,000 %	18/09/2027	211.254	0,49
	ING Groep NV <sup>(d)</sup>	EUR	1,099 %	16/11/2032	112.763	0,26
	Metinvest BV	USD	7,650 %	01/10/2027	195.422	0,45
	MV24 Capital BV	USD	6,748 %	01/06/2034	191.540	0,45
	NE Property BV	EUR	3,375 %	14/07/2027	249.758	0,58
	Prosus NV	EUR EUR	2,031 % 1.125 %	03/08/2032	337.088	0,78
	Technip Energies NV United Group BV	EUR	4,625 %	28/05/2028 15/08/2028	115.157 113.216	0,27 0,26
	Volkswagen International Finance NV <sup>(d)</sup>	EUR	3,500 %	Perp.	121.257	0,28
	Volkswagen International Finance NV <sup>(d)</sup>	EUR	4,625 %	Perp.	128.858	0,30
	Ziggo BV	EUR	2,875 %	15/01/2030	225.875	0,52
200.000		-	2,0.0 70	10/01/2000	2.842.136	6,60
Omán					2.042.100	
	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	6,250 %	25/01/2031	209.750	0,49
Pakistán						
360.000	Bonos internacionales del Estado de Pakistán	USD	6,000 %	08/04/2026	356.400	0,83
Panamá		1105	4 000 0/	44/00/0044	040.000	0.40
	Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.	USD	4,000 %	11/08/2041	213.098	0,49
Rumanía 200.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,875 %	26/05/2028	244.922	0,57
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,625 %	02/12/2040	30.317	0,07
		-			275.239	0,64
Rusia						
200.000	Bonos extranjeros rusos – Eurobono	USD	4,750 %	27/05/2026	220.700	0,51
Senegal						
120.000	Bonos internacionales del Estado de Senegal	EUR	5,375 %	08/06/2037	126.131	0,29
España						
	Abertis Infraestructuras S.A.	EUR	2,375 %	27/09/2027	123.828	0,29
	Banco Santander S.A.	USD	2,706 %	27/06/2024	207.832	0,48
	Banco Santander S.A.	EUR	1,625 %	22/10/2030	229.086	0,53
	Banco Santander S.A. <sup>(d)</sup>	GBP	2,250 %	04/10/2032	131.696	0,31
	Cellnex Finance Co., S.A.	EUR	1,500 %	08/06/2028	112.007	0,26
300.000	FCC Aqualia S.A.	EUR -	2,629 %	08/06/2027	376.815	0,87
					1.181.264	2,74
Supranacional		USD	3,798 %	17/05/2031	203.238	0.47
	African Export-Import Bank		•		86.123	0,47
	American Airlines, Inc. Via AAdvantage Loyalty IP Ltd.	USD	5,750 %	20/04/2029		0,20
	Banque Ouest Africaine de Developpement	EUR USD	2,750 % 7.750 %	22/01/2033 15/04/2026	227.877 178.222	0,53
176.000	Titan Acquisition Ltd. Via Titan Co-Borrower LLC	- 09D	7,750 %	15/04/2026		0,42
					695.460	1,62
Suecia 100.000	Heimstaden Bostad AB	EUR	1,125 %	21/01/2026	116.088	0,27
	Heimstaden Bostad AB <sup>(d)</sup>	EUR	3,625 %	Perp.	281.774	0,65
	Heimstaden Bostad AB <sup>(d)</sup>	EUR	3,000 %	Perp.	108.073	0,25
	Verisure Midholding AB	EUR	5,250 %	15/02/2029	232.048	0,54
	· ·	-			737.983	1,71
Suiza						
300.000	Credit Suisse Group AG <sup>(d)</sup>	USD	4,500 %	Perp.	288.177	0,67
Turquía						
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	7,625 %	26/04/2029	204.405	0,48
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	6,500 %	20/09/2033	221.100	0,51
	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO	USD	6,500 %	08/01/2026	194.500	0,45
200.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS	USD	7,875 %	22/01/2031	197.000	0,46
					817.005	1,90
Ucrania	Pages internacionales del Catada da Usarria	1100	7.750.0/	04/00/0000	000.040	0.47
200.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	7,750 %	01/09/2026	200.242	0,47

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos – (con Emiratos Árab	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					
	NBK Tier 1 Financing Ltd. (d)	USD	3,625 %	Perp.	396.250	0,92
Reino Unido	(d)					
	Aviva Plc. <sup>(d)</sup>	GBP	6,125 %	14/11/2036	157.666	0,37
	Barclays Plc.	USD	3,650 %	16/03/2025	212.824	0,49
	BP Capital Markets Plc. <sup>(d)</sup>	EUR	3,250 %	Perp.	240.387	0,56
	Legal & General Group Plc.(d)	GBP	3,750 %	26/11/2049	140.313	0,33
	Nationwide Building Society <sup>(d)</sup>	USD	4,302 %	08/03/2029	222.954	0,52
	NatWest Group Plc.(d)	EUR	0,780 %	26/02/2030	280.469	0,65
	Pension Insurance Corp., Plc.	GBP	4,625 %	07/05/2031	148.280	0,34
	Santander UK Group Holdings Plc. (d)	USD	1,532 %	21/08/2026	396.116	0,92
	Virgin Money UK Plc. (d)	EUR	0,375 %	27/05/2024	114.355	0,26
200.000	Virgin Money UK Plc. (d)	GBP	9,250 %	Perp.	296.453	0,69
75.000	Vodafone Group Plc. (d)	USD	7,000 %	04/04/2079	89.437	0,21
					2.299.254	5,34
Estados Unido	os					
	Acadia Healthcare Co., Inc.	USD	5,000 %	15/04/2029	25.469	0,06
	Acrisure LLC Via Acrisure Finance, Inc.	USD	6,000 %	01/08/2029	86.400	0,20
	AdaptHealth LLC	USD	5,125 %	01/03/2030	49.750	0,12
	Air Lease Corp.	USD	2,875 %	15/01/2026	231.784	0,54
65.000	Allen Media LLC Via Allen Media Co-Issuer, Inc.	USD	10,500 %	15/02/2028	70.038	0,16
50.000	Alliant Holdings Intermediate LLC Via Alliant Holdings Co-Issuer	USD	6,750 %	15/10/2027	50.473	0,12
58.000	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp.	USD	9,750 %	15/07/2027	60.936	0,14
80.000	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp.	USD	6,000 %	01/06/2029	76.100	0,18
75.000	Ambience Merger Sub, Inc.	USD	7,125 %	15/07/2029	72.375	0,17
100.000	APX Group, Inc.	USD	5,750 %	15/07/2029	98.125	0,23
128.000	Arches Buyer, Inc.	USD	6,125 %	01/12/2028	129.920	0,30
160.000	Arcosa, Inc.	USD	4,375 %	15/04/2029	162.200	0,38
80.000	Aretec Escrow Issuer, Inc.	USD	7,500 %	01/04/2029	82.030	0,19
63.000	Asbury Automotive Group, Inc.	USD	4,625 %	15/11/2029	63.603	0,15
35.000	Asbury Automotive Group, Inc.	USD	5,000 %	15/02/2032	35.438	0,08
10.000	AssuredPartners, Inc.	USD	5,625 %	15/01/2029	9.725	0,02
25.000	AutoNation, Inc.	USD	1,950 %	01/08/2028	24.528	0,06
110.000	BCPE Empire Holdings, Inc.	USD	7,625 %	01/05/2027	110.275	0,26
	Bonanza Creek Energy, Inc.	USD	5,000 %	15/10/2026	59.475	0,14
	Broadcom, Inc.	USD	3,625 %	15/10/2024	132.969	0,31
	Broadcom, Inc.	USD	3,137 %	15/11/2035	99.040	0,23
	Broadcom, Inc.	USD	3,187 %	15/11/2036	123.817	0,29
	BroadStreet Partners, Inc.	USD	5,875 %	15/04/2029	132.918	0,31
	California Resources Corp.	USD	7,125 %	01/02/2026	67.600	0,16
	Cargo Aircraft Management, Inc. – Serie APRI	USD	4,750 %	01/02/2028	35.569	0,08
	Carvana Co.	USD	5,500 %	15/04/2027	25.072	0,06
	Carvana Co.	USD	4,875 %	01/09/2029	191.000	0,44
	Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications	USD	4,500 %	01/02/2024	106.721	0,25
125.000	Operating Capital Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications	USD	4,908 %	23/07/2025	138.286	0,32
105.000	Operating Capital	LICD	2.250.0/	31/01/2032	100 701	0.00
	Cheniere Energy Partners LP	USD	3,250 %		120.781	0,28
	CHS Via Community Health Systems, Inc.	USD	8,000 %	15/03/2026	30.414	0,07
	Citigroup, Inc.	GBP	2,750 %	24/01/2024	137.945	0,32
	Citigroup, Inc. (d)	USD	0,776 %	30/10/2024	49.781	0,12
	Citigroup, Inc. <sup>(d)</sup>	USD	3,106 %	08/04/2026	105.065	0,24
	Citigroup, Inc.	USD	4,450 %	29/09/2027	111.529	0,26
	Citigroup, Inc.(d)	USD	3,875 %	Perp.	49.750	0,12
	Citigroup, Inc. – Serie V <sup>(d)</sup>	USD	4,700 %	Perp.	50.750	0,12
	Citigroup, Inc. – Serie W <sup>(d)</sup>	USD	4,000 %	Perp.	25.000	0,06
	Clarivate Science Holdings Corp.	USD	4,875 %	01/07/2029	117.512	0,27
	Cleveland-Cliffs, Inc.	USD	4,875 %	01/03/2031	30.188	0,07
	CMS Energy Corp. (d)	USD	3,750 %	01/12/2050	24.591	0,06
	CNX Midstream Partners LP	USD	4,750 %	15/04/2030	54.416	0,13
	Cornerstone Building Brands, Inc.	USD	6,125 %	15/01/2029	97.882	0,23
	CP Atlas Buyer, Inc.	USD	7,000 %	01/12/2028	174.600	0,41
103.000	DaVita, Inc.	USD	3,750 %	15/02/2031	96.047	0,22
69.000	Dealer Tire LLC Via DT Issuer LLC	USD	8,000 %	01/02/2028	70.725	0,16
28.000	Dealer Tire LLC Via DT Issuer LLC – Serie DEC	USD	8,000 %	01/02/2028	28.700	0,07
	DIRECTV Holdings LLC Via DIRECTV Financing Co., Inc.	USD	5,875 %	15/08/2027	183.150	0,43
	DuPont de Nemours, Inc.	USD	4,493 %	15/11/2025	55.411	0,13
				15/02/2029	194.647	0,45
211.000	Endure Digital, Inc.	บอบ	0,000.76			
	Endure Digital, Inc. Expedia Group, Inc.	USD USD	6,000 % 5,000 %	15/02/2029	56.024	0,43

			Tipo de		or de mercado	% del
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en USD	patrimonio
Bonos - (con	tinuación) s – (continuación)					
	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC – Serie DEC	USD	6,500 %	01/10/2025	41.974	0,10
	Freedom Mortgage Corp.	USD	6,625 %	15/01/2027	122.200	0,28
	Frontier Communications Holdings LLC	USD	5,000 %	01/05/2028	18.000	0,04
	General Electric Co. – Serie D <sup>(d)</sup>	USD	3,446 %	Perp.	174.006	0,40
	General Motors Co.	USD	5,150 %	01/04/2038	30.157	0,07
	General Motors Financial Co., Inc. Genesis Energy LP Via Genesis Energy Finance Corp.	USD USD	5,650 % 7,750 %	17/01/2029 01/02/2028	119.175 55.090	0,28 0,13
	Getty Images, Inc.	USD	9,750 %	01/03/2027	179.562	0,13
	Global Infrastructure Solutions, Inc.	USD	5,625 %	01/06/2029	131.625	0,31
	Global Partners LP Via GLP Finance Corp.	USD	6,875 %	15/01/2029	201.925	0,47
58.000	Gray Television, Inc.	USD	7,000 %	15/05/2027	61.661	0,14
	GYP Holdings III Corp.	USD	4,625 %	01/05/2029	49.471	0,11
	H&E Equipment Services, Inc.	USD	3,875 %	15/12/2028	19.525	0,05
	Hewlett Packard Enterprise Co.	USD	4,450 %	02/10/2023	52.981	0,12
	Hewlett Packard Enterprise Co. Hexion, Inc.	USD USD	6,350 % 7,875 %	15/10/2045 15/07/2027	83.950 54.124	0,19 0,13
	H-Food Holdings LLC Via Hearthside Finance Co., Inc.	USD	8,500 %	01/06/2026	164.457	0,13
	Hilcorp Energy I LP Via Hilcorp Finance Co.	USD	6,000 %	01/02/2031	75.375	0,38
	Hillenbrand, Inc.	USD	3,750 %	01/03/2031	135.287	0,31
	Hilton Domestic Operating Co., Inc.	USD	4,000 %	01/05/2031	115.026	0,27
	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC Via Hilton Grand					
111 000	Vacations Borrower Escrow	USD	5,000 %	01/06/2029	179.100	0,42
	HLF Financing SARL LLC Via Herbalife International, Inc.	USD USD	4,875 %	01/06/2029	105.034	0,24 0,36
	Howmet Aerospace, Inc. Imola Merger Corp.	USD	5,950 % 4,750 %	01/02/2037 15/05/2029	154.605 240.130	0,56
	IRB Holding Corp.	USD	6,750 %	15/02/2026	112.419	0,36
	ITT Holdings LLC	USD	6,500 %	01/08/2029	58.350	0,20
	JPMorgan Chase & Co.	USD	3,625 %	01/12/2027	269.070	0,62
	Kraft Heinz Foods Co.	USD	6,875 %	26/01/2039	151.487	0,35
130.000	LCM Investments Holdings II LLC	USD	4,875 %	01/05/2029	130.975	0,30
35.000	LD Holdings Group LLC	USD	6,500 %	01/11/2025	33.950	0,08
	LD Holdings Group LLC	USD	6,125 %	01/04/2028	50.703	0,12
	LGI Homes, Inc.	USD	4,000 %	15/07/2029	96.625	0,22
	LifePoint Health, Inc.	USD	5,375 %	15/01/2029	48.500	0,11
	Madison IAQ LLC	USD USD	4,125 %	30/06/2028	9.763	0,02
	Marriott Ownership Resorts, Inc. Marriott Ownership Resorts, Inc.	USD	4,750 % 4,500 %	15/01/2028 15/06/2029	84.735 34.344	0,20 0,08
	Match Group Holdings II LLC	USD	3,625 %	01/10/2031	47.563	0,00
	Mercer International, Inc.	USD	5,125 %	01/02/2029	104.414	0,24
	Meritor, Inc.	USD	6,250 %	01/06/2025	30.305	0,07
75.000	Morgan Stanley(d)	USD	2,484 %	16/09/2036	72.358	0,17
145.000	Mozart Debt Merger Sub, Inc.	USD	3,875 %	01/04/2029	142.644	0,33
	Mozart Debt Merger Sub, Inc.	USD	5,250 %	01/10/2029	19.900	0,05
	Nabors Industries, Inc.	USD	9,000 %	01/02/2025	119.502	0,28
	Nabors Industries, Inc.	USD	7,375 %	15/05/2027	9.938	0,02
	National Retail Properties, Inc.	USD USD	3,900 %	15/06/2024	53.247	0,12
	Nationstar Mortgage Holdings, Inc. Navient Corp.	USD	5,500 % 5,000 %	15/08/2028 15/03/2027	67.168 170.267	0,16 0,40
	NCR Corp.	USD	5,125 %	15/04/2029	166.665	0,39
	NFP Corp. – Serie SEP	USD	6,875 %	15/08/2028	135.972	0,32
	NGL Energy Operating LLC Via NGL Energy Finance Corp.	USD	7,500 %	01/02/2026	70.437	0,16
	NuStar Logistics LP	USD	6,375 %	01/10/2030	72.590	0,17
32.000	Occidental Petroleum Corp.	USD	6,625 %	01/09/2030	38.800	0,09
178.000	Pactiv LLC	USD	8,375 %	15/04/2027	196.690	0,46
	Penske Automotive Group, Inc.	USD	3,750 %	15/06/2029	103.294	0,24
	Pike Corp.	USD	5,500 %	01/09/2028	228.542	0,53
	Radiate Holdco LLC Via Radiate Finance, Inc.	USD	6,500 %	15/09/2028	71.780	0,17
	Real Hero Merger Sub 2, Inc. Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp.	USD USD	6,250 % 5,750 %	01/02/2029 15/01/2029	65.325 137.870	0,15 0,32
	Realty Income Corp.	USD	3,400 %	15/01/2028	188.678	0,32
	Scripps Escrow II, Inc.	USD	5,375 %	15/01/2031	104.780	0,24
	Scripps Escrow, Inc.	USD	5,875 %	15/07/2027	130.880	0,30
	Sealed Air Corp.	USD	6,875 %	15/07/2033	97.597	0,23
	SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	USD	5,250 %	15/08/2029	235.000	0,55
	Shift4 Payments LLC Via Shift4 Payments Finance Sub, Inc.	USD	4,625 %	01/11/2026	15.544	0,04
	Sonic Automotive, Inc.	USD	4,625 %	15/11/2029	44.325	0,10
	Sonic Automotive, Inc.	USD	4,875 %	15/11/2031	49.470	0,11
	Southwestern Energy Co.	USD	5,375 %	01/02/2029	126.747	0,29
	Spirit AeroSystems, Inc.	USD	5,500 %	15/01/2025	18.520	0,04
	Spirit AeroSystems, Inc. SRS Distribution, Inc.	USD USD	4,600 % 6,125 %	15/06/2028 01/07/2029	209.550 227.709	0,49 0,53
441.000	Site Distribution, inc.	JJJ	U, IZJ 70	01/0//2029	221.109	0,55

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (cor	ntinuación)					
	os – (continuación)					
	Summit Midstream Holdings LLC Via Summit Midstream Finance Corp.	USD	5,750 %	15/04/2025	111.562	0,26
	Summit Midstream Holdings LLC Via Summit Midstream Finance Corp.	USD	8,500 %	15/10/2026	237.937	0,55
	SWF Escrow Issuer Corp.	USD	6,500 %	01/10/2029	91.437	0,21
	Tallgrass Energy Partners LP Via Tallgrass Energy Finance Corp.	USD	6,000 %	01/09/2031	138.450	0,32
	Tenet Healthcare Corp.	USD	6,125 %	01/10/2028	82.600	0,19
	Terrier Media Buyer, Inc.	USD	8,875 %	15/12/2027	43.563	0,10
	T-Mobile USA, Inc.	USD	3,750 %	15/04/2027	80.940	0,19
	Townsquare Media, Inc.	USD	6,875 %	01/02/2026	153.982	0,36
	TransDigm, Inc.	USD	5,500 %	15/11/2027	157.170	0,36
	TransDigm, Inc.	USD	4,625 %	15/01/2029	9.575	0,02
	Triumph Group, Inc.	USD	7,750 %	15/08/2025	136.000	0,32
	Unifrax Escrow Issuer Corp.	USD	5,250 %	30/09/2028		0,11
	Unisys Corp.	USD	6,875 %	01/11/2027	65.651	0,15
	United Natural Foods, Inc.	USD	6,750 %	15/10/2028	155.160	0,36
	United Wholesale Mortgage LLC	USD	5,500 %	15/11/2025	39.900	0,09
	United Wholesale Mortgage LLC	USD	5,500 %	15/04/2029	105.600	0,24
	Urban One, Inc.	USD	7,375 %	01/02/2028	125.306	0,29
	US Foods, Inc.	USD	4,750 %	15/02/2029	79.790	0,18
	USA Compression Partners LP Via USA Compression Finance Corp.	USD	6,875 %	01/04/2026	210.635	0,49
	Valero Energy Corp.	USD	3,400 %	15/09/2026	26.588	0,06
	Valvoline, Inc.	USD	3,625 %	15/06/2031	14.288	0,03
	Vertiv Group Corp.	USD	4,125 %	15/11/2028	132.330	0,31
183.000	Waste Pro USA, Inc.	USD	5,500 %	15/02/2026	182.085	0,42
100.000	Wells Fargo & Co. <sup>(d)</sup>	USD	2,188 %	30/04/2026	102.302	0,24
65.000	Wheel Pros, Inc.	USD	6,500 %	15/05/2029	63.253	0,15
	Wolverine Escrow LLC	USD	8,500 %	15/11/2024	160.225	0,37
90.000	WR Grace Holdings LLC	USD	5,625 %	15/08/2029	90.450	0,21
40.000	ZoomInfo Technologies LLC Via ZoomInfo Finance Corp.	USD	3,875 %	01/02/2029	39.100	0,09
					14.568.937	33,84
Uzbekistán						
	Bonos internacionales de Uzbekistán	USD	3,700 %	25/11/2030	187.500	0,44
TOTAL DE BO (coste USD 38					37.684.775	87,52
Tenencias	Descripción del valor				Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Fondos de in	versión – 1,66 %					•
Irlanda 745 040	Orldren Orch 1100 Tressure Limit Descript Found (Class de acciona	: 4	- V)(f)(a)		745.040	4.00
	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de accione: NDOS DE INVERSIÓN	s de distribució	n X)(1)(9)		715.246	1,66
(coste USD 71					715.246	1,66
TOTAL DE VAI	LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE 1.306 423)	VALORES O	FICIAL		38.400.021	89,18
(******						
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	iarios negociados en otro mercado regulado	0/				
Estados Unido	con garantía de activos emitidos o garantizados por agencias – 7,18 os	70				
2.000.000	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	2,000 %	20/12/2051	2.029.479	4,72
1.000.000	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	4,500 %	20/12/2051	1.060.135	2,46
					3.089.614	7,18
	LIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O					
(coste USD 3.0	OS POR AGENCIAS 084.844)				3.089.614	7,18
Obligaciones	s con garantía de activos no emitidos ni garantizados por					
•	<u>## /U</u>					
Islas Caimán						
	Bain Capital Credit CLO 2019-1X "DR"(d)	USD	3,574 %	19/04/2034	250.904	0,58
500 000						
	Bain Capital Credit CLO 2021-2X "D"(d)	USD	3,272 %	16/07/2034	497.401	1,16
	Bain Capital Credit CLO 2021-2X "D" <sup>(d)</sup> LCM LP 32X "D" <sup>(d)</sup>	USD	3,272 % 3,532 %	16/07/2034 20/07/2034	497.401 497.374	1,16 1,16

Tenencias	Descripción del valor			Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
agencias - (	s con garantía de activo continuación)	s no emitidos	s ni garantizados por					
	<ul> <li>(continuación)</li> <li>Neuberger Berman Loan</li> </ul>	Advisers CLO	31 Ltd. 2019-31X "DR" <sup>(d)</sup>	USD	3,382 %	20/04/2031	250.179	0,58
	250.000 Neuberger Berman Loan Advisers CLO 31 Ltd. 2019-31X "DR" (d) 750.000 Pikes Peak CLO 6 2020-6X "DR2" (d)			USD	3,260 %	18/05/2034	751.233	1,74
							2.247.091	5,22
	BLIGACIONES CON GARA DOS POR AGENCIAS 250.000)	NTÍA DE ACTI	VOS NO EMITIDOS NI				2.247.091	5,22
TOTAL DE VA (coste USD 5.		GOCIADOS EI	OTRO MERCADO REGULADO				5.336.705	12,40
VALOR DE MI (coste USD 44	ERCADO DE LAS INVERS 4.641.267)	IONES EXCLU	YENDO DERIVADOS				43.736.726	101,58
Contratos de	e futuros – 0,06 %							
Número de contratos	Descripción del valor					Compromiso Valor de mercado USD	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
	CAD							
3	3 Futuros sobre bonos del	Estado de Cana	adá a 10 años 22/03/2022		Larga	332.785	6.283	0,02
	USD B. Futuros sobre bonos del 1	Tesoro de EE I	JU. a largo plazo 22/03/2022		Larga	485.906	11.482	0,03
			. UU. a 10 años 22/03/2022		Larga	2.228.063	34.586	0,08
10	Futuros sobre pagarés de	el Tesoro de EE	. UU. a 2 años 31/03/2022		Larga	2.190.234	5.433	0,01
8	3 Futuros sobre pagarés de	el Tesoro de EE	. UU. a 5 años 31/03/2022		Larga	973.563	10.187	0,02
	·					5.877.766	61.688	0,14
PLUSVALIA L	ATENTE SOBRE CONTRA	TOS DE FUTU	ROS				67.971	0,16
Número de contratos	Descripción del valor					Compromiso Valor de mercado USD	Minusvalía latente en USD	% del patrimonio
	EUR							
(4)	<ul><li>) Futuros sobre bonos de la 08/12/2021</li></ul>	a República Fe	deral de Alemania a 10 años		Corta	(785.345)	(7.919)	(0,02)
(20	) Futuros sobre bonos de la 08/12/2021	a República Fe	deral de Alemania a 5 años		Corta	,	, ,	, ,
	00/12/2021					(3.086.761)	(20.208)	(0,03)
	USD					(0.072.100)	(20.200)	(0,00)
	) Futuros sobre bonos del		JU. a muy largo plazo 22/03/2022		Corta	(399.500)	(9.117)	(0,02)
(5	<ul> <li>) Futuros sobre pagarés de años 22/03/2022</li> </ul>	el Tesoro de EE	. UU. a muy largo plazo a 10		Corta	(734.922)	(14.180)	(0,03)
						(1.134.422)	(23.297)	(0,05)
MINUSVALÍA	LATENTE SOBRE CONTR	ATOS DE FUT	UROS				(43.505)	(0,10)
Contratos de	e divisas a plazo – (0,05	%)						
							Plusvalía	
Divisa	Compra	Divisa	Venta			Fecha de vencimiento	latente en USD	% del patrimonio
JPY	27.531.792	USD	241.817			15/12/2021	2.741	0,01
USD	391.512	EUR	329.889			15/12/2021	15.981	0,04
USD	250.080	JPY	27.531.792			15/12/2021	5.521	0,01
USD USD	701 1.502.353	NZD GBP	988 1.090.956			15/12/2021 21/01/2022	26 43.630	0,00 0,10
USD	46.417	CAD	57.776			31/01/2022	1.153	0,00
PLUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRA	TOS DE DIVIS	AS A PLAZO				69.052	0,16
							Minusvalía	
Divisa	Compra	Divisa	Venta			Fecha de vencimiento	latente en USD	% del patrimonio
EUR	329.889	USD	377.922			15/12/2021	(2.390)	(0,01)
NZD	987	USD	694			15/12/2021	(19)	(0,00)
GBP USD	213.705 9.566.124	USD EUR	288.431 8.463.948			21/01/2022 10/02/2022	(2.685) (86.512)	(0,00) (0,20)
						10/02/2022		
MINUSVALIA	LATENTE SOBRE CONTR	ATOS DE DIVI	SAS A PLAZO				(91.606)	(0,21)

Contratos de div	visas a plazo específi	icos de una clas	e de acciones - 0,14 %		Fecha de	Plusvalía latente	% del
Divisa	Compra	Divisa	Venta		vencimiento	en USD	patrimonio
USD	578	AUD	801		31/01/2022	5	0,00
EUR	6.601.137	USD	7.454.635	DTUDA	10/02/2022	73.573	0,17
PLUSVALIA LATE	ENTE SOBRE CONTRA	IOS DE DIVISAS	A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBE	RIUKA		73.578	0,17
Divisa	Compra	Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	Minusvalía latente en USD	% del patrimonio
GBP	211.106	USD	290.502		21/01/2022	(8.231)	(0,02)
AUD	147.968	USD	109.571		31/01/2022	(3.532)	(0,01)
SGD USD	146.934 7.247	USD EUR	108.876 6.425		07/02/2022 10/02/2022	(1.165) (81)	(0,00) (0,00)
				CDTUDA	10/02/2022		
MINUSVALIA LAI	ENTE SUBRE CONTRA	ATOS DE DIVISAS	S A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COE	BERTURA		(13.009)	(0,03)
•	ermutas financieras –	0,12 %					
Importe teórico						Plusvalía latente	% del
local neto	A pagar		A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	en USD	patrimonio
	Permutas de tipos de	interés					
470.000 930.000		eses en EUD)	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR Fijo 0,000 %	R) EUR EUR	15/12/2024 15/12/2026	2.305 3.841	0,00 0,01
1.040.000	variable (LIBOIX a 0 III	leses en Lory	Variable (EURIBOR a 6 meses en	EUR	15/12/2028	10.526	0,01
	Fijo 0,000 %		EUR)				,
280.000	Fijo 0,000 %		Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2031	2.889	0,01
10.000	Variable (EURIBOR a	6 meses en EUR)	Fijo 0,250 %	EUR	15/12/2051	288	0,00
PLUSVALÍA LATE	NTE SOBRE PERMUTA	AS DE TIPOS DE	INTERÉS			19.849	0,04
	Permutas de incump						
15.000	•		Variable (Transocean, Inc.)	USD	20/12/2022	839	0,00
2.975.000		DX North America					
7.600.000	Investment Grade 34 I Variable (The Markit C	,	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2025	35.377	0,08
7.600.000	Investment Grade 36 \		Fijo 1,000 %	USD	20/06/2026	1.125	0,01
PLUSVALÍA LATE	NTE SOBRE PERMUTA	AS DE INCUMPLI	MIENTO CREDITICIO (CDS)			37.341	0,09
TOTAL DE PLUS	VALÍA LATENTE SOBR	E CONTRATOS D	E PERMUTAS FINANCIERAS			57.190	0,13
Importe teórico						Minusvalía latente	% del
local neto	A pagar		A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	en USD	patrimonio
	Permutas de tipos de	interés					
100.000	Fii- 0 500 0/		Variable (EURIBOR a 6 meses en	EUR	15/12/2041	(235)	(0,00)
390.000	Fijo 0,500 % Fijo 0,500 %		EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2026	(2.349)	(0,01)
-	ENTE SOBRE PERMU	TAS DE TIPOS DE				(2.584)	(0,01)
	SVALÍA LATENTE SOBI					(2.004)	(0,01)
PERMUTAS FINA		RE CONTRATOS I	JE			(2.584)	(0,01)
VALOR DE MERO (coste USD 44.64	ADO DE LAS INVERSI 1.267)	ONES				43.853.813	101,85
OTROS ACTIVOS	(795.556)	(1,85)					
PATRIMONIO						43.058.257	100,00
						Valor de	
TOTAL DE INVER	SIONES					mercado en USD	% del patrimonio
Total inversiones excluyendo derivados (coste USD 44.641.267)						43.736.726	101,58
Plusvalía latente sobre contratos de futuros						67.971 (43.505)	0,16
Minusvalía latente sobre contratos de futuros Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo							(0,10) 0,16
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo						69.052 (91.606)	(0,21)
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura						73.578	0,17
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura						(13.009)	(0,03)
	obre contratos de permu					57.190	0,13
Otros activos y pas	sobre contratos de pern sivos	nutas iiridiiCieraS				(2.584) (795.556)	(0,01) (1,85)
						,,	(.,55)

43.058.257

100,00

Patrimonio

El Comisionista de futuros fue Morgan Stanley & Co., Inc.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Australia & New Zealand Banking Group Ltd., Bank of America N.A., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Royal Bank of Canada, Standard Chartered Bank y State Street Bank & Trust.

La contraparte de los contratos de permutas financieras fue Morgan Stanley.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,16 %.

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) Este título tiene un cupón escalonado que pasará al segundo tipo en una fecha determinada del futuro.
- (d) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (e) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (f) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- (g) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.
- (h) Los valores TBA (por confirmar) se compran sobre una vez suscrito un compromiso a plazo con un importe de principal aproximado (por lo general +/-2,5 %) y sin fecha definitiva de vencimiento. El importe real del principal y la fecha de vencimiento se determinarán tras la liquidación cuando se asignen los "pools" de hipotecas específicos.

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en GBP	% de patrimonio
	· ·					
vaiores mobil Bonos – 90,7′ Australia	liarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial 1 %					
	APT Pipelines Ltd.	GBP	3,500 %	22/03/2030	221.280	0,78
	Australia & New Zealand Banking Group Ltd.(c)	GBP	1,809 %	16/09/2031	98.131	0,76
	Macquarie Bank Ltd.	GBP	1,125 %	15/12/2025	173.360	0,61
170.000	madquane Bank Eta.	OD.	1,120 %	10/12/2020	492.771	1,74
Austria						•
	Volksbank Wien AG	EUR	0,875 %	23/03/2026	85.718	0,30
Bélgica						
250.000	Anheuser-Busch InBev S.A./NV	GBP	2,250 %	24/05/2029	261.618	0,92
50.000	Anheuser-Busch InBev S.A./NV	GBP	2,850 %	25/05/2037	54.913	0,19
100.000	KBC Group NV <sup>(c)</sup>	GBP	1,250 %	21/09/2027	98.225	0,35
					414.756	1,46
Bermudas						
	Hiscox Ltd.(c)	GBP	6,125 %	24/11/2045	112.584	0,40
Canadá 100.000	Bank of Nova Scotia	GBP	1,250 %	17/12/2025	99.432	0,35
Dinamarca	34 6. 1.614 666.14		1,200 %			0,00
	Danske Bank A/S <sup>(c)</sup>	GBP	2,250 %	14/01/2028	151.731	0,53
República Don	ninicana					
150.000	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	4,875 %	23/09/2032	112.049	0,39
Finlandia	Cityan OV I(C)	EUD	2.625.0/	Dom	92.046	0.20
	Citycon OYJ <sup>(c)</sup>	EUR	3,625 %	Perp.	82.016	0,29
Francia	AXA S.A.(c)	GBP	5,625 %	16/01/2054	185.239	0,65
		GBP				
	BNP Paribas S.A.		3,375 %	23/01/2026	375.084	1,32
	BPCE S.A.	GBP	5,250 %	16/04/2029	240.812	0,85
	Crédit Agricole S.A. (c) Electricite de France S.A.	GBP GBP	1,874 %	09/12/2031	98.196	0,35
	Electricite de France S.A.	USD	6,250 %	30/05/2028	256.822 170.777	0,90 0,60
	Electricite de France S.A.		4,500 %	21/09/2028		
	Electricite de France S.A.	GBP GBP	5,875 %	18/07/2031 17/10/2041	169.268 151.086	0,60
	Électricité de France S.A.  Électricité de France S.A.	GBP	5,500 % 5,875 %	Perp.	111.025	0,53 0,39
	Electricite de France S.A.	GBP	5,125 %	22/09/2050	80.524	0,39
	Électricité de France S.A. (c)	EUR	4,000 %	Perp.	90.282	0,32
	Loxam SAS	EUR	3,250 %	14/01/2025	85.315	0,32
	Orange S.A.	GBP	8,125 %	20/11/2028	173.614	0,50
121.000	Crange S.A.	GBF	0,123 /0	20/11/2020	2.188.044	7,70
Alemania					2.100.044	7,70
	Commerzbank AG	GBP	1,750 %	22/01/2025	99.797	0,35
200.000	Commerzbank AG <sup>(c)</sup>	EUR	6,125 %	Perp.	184.184	0,65
200.000	Deutsche Bank AG	GBP	2,625 %	16/12/2024	205.250	0,72
100.000	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	GBP	1,875 %	22/12/2028	98.257	0,35
200.000	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	EUR	4,625 %	Perp.	170.646	0,60
					758.134	2,67
Irlanda	AIR Croup Pla (C)	EUD	6.050.0/	Da	105.076	0.05
	AIB Group Plc. <sup>(c)</sup> GE Capital UK Funding Unlimited Co.	EUR GBP	6,250 % 6,250 %	Perp. 05/05/2038	185.076 133.121	0,65 0,47
	GE Capital UK Funding Unlimited Co.	GBP	8,000 %	14/01/2039	92.541	0,33
30.000	GE Capital ON I untilling drillinited Co.	GBF	0,000 /6	14/01/2039		
Italia					410.738	1,45
Italia 100.000	Intesa Sanpaolo SpA	GBP	2,500 %	15/01/2030	102.033	0,36
	Intesa Sanpaolo SpA	GBP	5,148 %	10/06/2030	112.895	0,40
	Bonos internacionales del Estado de Italia	GBP	6,000 %	04/08/2028	98.901	0,35
					313.829	1,11
Jersey					-	
	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,940 %	30/09/2040	148.396	0,52
	· ·					
100.000	Heathrow Funding Ltd.	EUR	1,500 %	12/10/2025	88.493	0,31
100.000 100.000	· ·	EUR GBP GBP	1,500 % 2,750 % 6,450 %	12/10/2025 13/10/2029 10/12/2031	88.493 103.940 67.940	0,31 0,37 0,24

			Tipo de		Valor de mercado en	% de
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	GBP	patrimonio
Bonos – (con	itinuación)					
Jersey - (cont	•					
	Heathrow Funding Ltd.	GBP	5,875 %	13/05/2041	173.039	0,61
	Porterbrook Rail Finance Ltd.	GBP	7,125 %	20/10/2026	63.533	0,22
100.000	Porterbrook Rail Finance Ltd.	GBP _	4,625 %	04/04/2029	763.452	0,42 2,69
V!!-44					763.452	2,08
Kazajistán 200.000	KazMunayGas National Co., JSC	USD	3,500 %	14/04/2033	153.075	0,54
Luxemburgo	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					
•	ADLER Group S.A.	EUR	2,250 %	14/01/2029	70.932	0,25
	Aroundtown S.A.	GBP	3,000 %	16/10/2029	105.515	0,37
	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	GBP	2,625 %	20/10/2028	254.633	0,90
	Lincoln Financing SARL	EUR	3,625 %	01/04/2024	85.512	0,30
	Logicor Financing SARL	GBP	2,750 %	15/01/2030	209.298	0,74
200.000	Logisti Financing of the	-	2,.00 /0	10/0 // 2000	725.890	2,56
México					. 20.000	2,00
	Mexico City Airport Trust	USD	3,875 %	30/04/2028	153.915	0,54
	Bonos internacionales del Estado de México	EUR	1,350 %	18/09/2027	86.343	0,30
	Bonos internacionales del Estado de México	USD	2,659 %	24/05/2031	144.395	0,50
		-	,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,		384.653	1,35
D-( D-!					004.000	1,00
Países Bajos	Congrations Bahahank IIA	GBP	5,250 %	14/09/2027	240.787	0,85
	Cooperatieve Rabobank UA	GBP		23/05/2029	117.039	0,65
	Cooperatieve Rabobank UA		4,625 %			
	Deutsche Telekom International Finance BV	GBP	2,250 %	13/04/2029	78.424	0,28
	E.ON International Finance BV	GBP	6,250 %	03/06/2030	134.934	0,48
	E.ON International Finance BV	GBP	6,375 %	07/06/2032	213.375	0,75
	Enel Finance International NV	GBP	1,000 %	20/10/2027	97.686	0,35
	Enel Finance International NV	GBP	5,750 %	14/09/2040	153.288	0,54
	Heimstaden Bostad Treasury BV	EUR	1,625 %	13/10/2031	128.690	0,45
100.000	ING Groep NV	GBP	3,000 %	18/02/2026	106.183	0,37
100.000	Koninklijke KPN NV	GBP	5,000 %	18/11/2026	114.317	0,40
200.000	Volkswagen International Finance NV	GBP _	3,375 %	16/11/2026	216.244	0,76
					1.600.967	5,64
Catar	Octor France	USD	2.425.0/	12/07/2011	450 200	0.52
	Qatar Energy	030	3,125 %	12/07/2041	150.380	0,53
Rumanía	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	3,624 %	26/05/2030	9.239	0,03
			•			
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,000 %	28/01/2032	55.372	0,19
20.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR -	3,375 %	28/01/2050	15.981	0,06
					80.592	0,28
España 100.000	Dance Centender C A	CDD	4.500.07	44/04/0000	00.000	0.05
	Banco Santander S.A.	GBP	1,500 %	14/04/2026	99.226	0,35
	Banco Santander S.A. Banco Santander S.A.(c)	GBP	1,750 %	17/02/2027	99.759	0,35
		GBP	2,250 %	04/10/2032	98.579	0,35
	Banco Santander S.A.(c)	EUR	4,375 %	Perp.	173.154	0,61
	CaixaBank S.A. <sup>(c)</sup>	GBP	1,500 %	03/12/2026	296.838	1,04
	Cellnex Finance Co., S.A.	EUR	2,000 %	15/02/2033	81.379	0,29
150.000	Telefonica Emisiones S.A.	GBP -	5,445 %	08/10/2029	189.900	0,67
					1.038.835	3,66
Supranacional						_
	Ardagh Packaging Finance Plc. Via Ardagh Holdings USA, Inc.	GBP	4,750 %	15/07/2027	100.183	0,35
710.000	Banco Europeo de Inversiones	GBP -	5,000 %	15/04/2039	1.144.094	4,03
					1.244.277	4,38
Suecia				_		_
	Heimstaden Bostad AB(c)	EUR	3,625 %	Perp.	84.367	0,30
100.000	Heimstaden Bostad AB <sup>(c)</sup>	EUR -	3,000 %	Perp.	80.896	0,28
					165.263	0,58
Suiza						
125.000	Credit Suisse AG	GBP	1,125 %	15/12/2025	123.026	0,43

			Tine de		Valor de mercado en	% de
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	mercado en GBP	% de patrimonio
Bonos – (con	tinuación)					
Suiza – (contin	•					
100.000	Crédit Suisse Group AG <sup>(c)</sup>	GBP	2,125 %	12/09/2025	101.078	0,36
250.000	Crédit Suisse Group AG(c)	GBP	2,250 %	09/06/2028	252.180	0,89
					476.284	1,68
Jcrania						
110.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	EUR	4,375 %	27/01/2030	80.244	0,28
Reino Unido						
	Annington Funding Plc.	GBP	2,646 %	12/07/2025	260.192	0,92
	Annington Funding Plc.	GBP	3,184 %	12/07/2029	322.695	1,14
	Assura Financing Plc.	GBP	1,625 %	30/06/2033	98.961	0,35
	Aviva Plc. (c) Barclays Plc. (c)	GBP GBP	6,125 %	14/11/2036	153.423	0,54
	Barclays Pic.	GBP	2,375 % 3,250 %	06/10/2023 12/02/2027	202.246 212.774	0,71 0,75
	Barclays Pic. (c)	GBP	3,750 %	22/11/2030	211.212	0,73
	BP Capital Markets Plc.(c)	EUR	3,625 %	Perp.	114.295	0,40
	BP Capital Markets Plc.(c)	GBP	4,250 %	Perp.	156.605	0,55
	Centrica Plc.	GBP	4,375 %	13/03/2029	117.244	0,41
200.000	Direct Line Insurance Group Plc.(c)	GBP	4,750 %	Perp.	202.416	0,71
	DWR Cymru Financing UK Plc.	GBP	1,625 %	31/03/2026	379.504	1,34
	Eversholt Funding Plc.	GBP	2,742 %	30/06/2040	102.551	0,36
100.000	Gatwick Airport Finance Plc.	GBP	4,375 %	07/04/2026	98.902	0,35
100.000	Heathrow Finance Plc.	GBP	6,250 %	03/03/2025	106.448	0,37
208.000	HSBC Holdings Plc.	GBP	5,750 %	20/12/2027	247.148	0,87
325.000	HSBC Holdings Plc.(c)	GBP	3,000 %	22/07/2028	342.264	1,21
50.000	HSBC Holdings Plc.	GBP	7,000 %	07/04/2038	74.901	0,26
	HSBC Holdings Plc.	GBP	6,000 %	29/03/2040	85.247	0,30
	InterContinental Hotels Group Plc.	GBP	2,125 %	24/08/2026	201.668	0,71
	Iron Mountain UK Plc.	GBP	3,875 %	15/11/2025	100.679	0,35
	Just Group Plc.(c)	GBP	5,000 %	Perp.	194.076	0,68
	Legal & General Group Plc.(c)	GBP	3,750 %	26/11/2049	157.544	0,55
	Legal & General Group Plc.(c)	GBP	5,625 %	Perp.	219.202	0,77
	Lloyds Bank Plc.	GBP	7,625 %	22/04/2025	202.335	0,71
	Lloyds Banking Group Plc.(c)	GBP GBP	1,875 %	15/01/2026	353.755	1,25
	London & Quadrant Housing Trust	GBP	3,125 %	28/02/2053 06/04/2030	130.200 201.280	0,46
	London Stock Exchange Group Plc.  M&G Plc. (c)	GBP	1,625 % 6,340 %	19/12/2063	244.235	0,71 0,86
	National Express Group Plc.(c)	GBP	4,250 %	Perp.	101.830	0,36
	National Grid Electricity Transmission Plc.	GBP	2,000 %	17/04/2040	150.146	0,53
	Natwest Group Plc. <sup>(c)</sup>	GBP	2,875 %	19/09/2026	104.324	0,33
	NatWest Group Plc.(c)	GBP	5,125 %	Perp.	208.080	0,73
	NatWest Markets Plc. (c)	GBP	5,625 %	Perp.	100.870	0,36
	Notting Hill Genesis	GBP	3,250 %	12/10/2048	127.775	0,45
	Pension Insurance Corp. Plc.	GBP	8,000 %	23/11/2026	127.808	0,45
200.000	Pension Insurance Corp., Plc.(c)	GBP	7,375 %	Perp.	236.924	0,83
100.000	Phoenix Group Holdings Plc.	GBP	5,625 %	28/04/2031	118.622	0,42
100.000	Pinewood Finance Co., Ltd.	GBP	3,250 %	30/09/2025	100.650	0,35
200.000	RI Finance Bonds No 3 Plc.	GBP	6,125 %	13/11/2028	242.952	0,86
300.000	Santander UK Group Holdings Plc. (c)	GBP	2,920 %	08/05/2026	312.357	1,10
	Scottish Widows Ltd.	GBP	5,500 %	16/06/2023	105.965	0,37
	SSE Plc.	GBP	8,375 %	20/11/2028	121.077	0,43
	Stagecoach Group Plc.	GBP	4,000 %	29/09/2025	161.397	0,57
	Telereal Secured Finance Plc.	GBP	4,010 %	10/12/2031	267.298	0,94
	Telereal Securitisation Plc. – Serie A8	GBP	4,974 %	10/09/2027	113.196	0,40
	Telereal Securitisation Plc. – Serie B5	GBP	5,425 %	10/12/2031	102.311	0,36
	Telereal Securitisation Plc. – Serie B6 <sup>(c)</sup>	GBP	0,803 %	10/09/2031	143.459	0,50
	Tesco Property Finance 3 Plc.	GBP	5,744 %	13/04/2040	185.917	0,65
	Thames Water Utilities Finance Plc.	GBP	2,375 %	03/05/2023	338.330	1,19
	Thames Water Utilities Finance Plc. (c)	GBP GBP	5,750 %	13/09/2030	190.120	0,67
	Transport for London Transport for London	GBP	2,125 % 3,875 %	24/04/2025 23/07/2042	155.094 133.505	0,55 0,47
	Virgin Money UK Plc. <sup>(c)</sup>	GBP	3,875 % 3,375 %	24/04/2026	133.505 104.069	0,47
	Virgin Money UK Plc. <sup>(c)</sup>	GBP	4,000 %	25/09/2026	106.936	0,37
	Vmed O2 UK Financing I Plc.	GBP	4,000 %	31/01/2029	98.341	0,36 0,35
	Vodafone Group Plc.	GBP	3,375 %	08/08/2049	178.302	0,55
	Western Power Distribution Plc.	GBP	3,625 %	06/11/2023	156.972	0,55
. 33.330		32.		55.12520	10.088.629	35,52
Estados Unido	s				10.000.023	33,32
	Ashland LLC	USD	3,375 %	01/09/2031	26.002	0,09
	AT&T, Inc.	GBP	5,500 %	15/03/2027	299.867	1,05

	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en GBP	% del patrimonio
Bonos - (cor	ntinuación)					
	os – (continuación)					
	AT&T, Inc.	GBP	4,375 %	14/09/2029	179.971	0,63
	AT&T, Inc.	GBP	4,375 %	14/09/2029	118.402	0,42
	AT&T, Inc.	GBP	4,250 %	01/06/2043	128.584	0,45
	Bank of America Corp.	GBP	2,300 %	25/07/2025	129.746	0,46
	Becton Dickinson and Co.	GBP	3,020 %	24/05/2025	158.493	0,56
	Centene Corp.	USD	2,625 %	01/08/2031	21.685	0,08
	Cheniere Energy Partners LP	USD	3,250 %	31/01/2032	21.698	0,08
	Citigroup, Inc.	GBP	5,875 %	01/07/2024	166.449	0,59
	Citigroup, Inc.	GBP	5,150 %	21/05/2026	253.530	0,89
	EQT Corp.	USD	3,625 %	15/05/2031	3.822	0,01
	Ford Motor Credit Co., LLC	GBP	2,748 %	14/06/2024	100.718	0,35
	General Electric Co.	GBP	5,250 %	07/12/2028	219.051	0,77
	General Motors Financial Co., Inc.	GBP	2,250 %	06/09/2024	127.311	0,45
	General Motors Financial Co., Inc.	GBP	2,350 %	03/09/2025	230.022	0,81
	Howmet Aerospace, Inc.	USD	3,000 %	15/01/2029	32.421	0,11
	JPMorgan Chase & Co. <sup>(c)</sup>	GBP	0,991 %	28/04/2026	123.200	0,43
	MasTec, Inc.	USD	4,500 %	15/08/2028	19.392	0,07
	Morgan Stanley <sup>(c)</sup>	USD	2,484 %	16/09/2036	36.108	0,13
	MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.	GBP	2,550 %	05/12/2023	101.833	0,36
	OneMain Finance Corp.	USD	3,500 %	15/01/2027	8.007	0,03
150.000	Realty Income Corp.	GBP	1,125 %	13/07/2027	147.663	0,52
15.000	Sirius XM Radio, Inc.	USD	3,125 %	01/09/2026	11.046	0,04
100.000	Time Warner Cable LLC	GBP	5,250 %	15/07/2042	135.909	0,48
175.000	Verizon Communications, Inc.	GBP	1,125 %	03/11/2028	169.837	0,60
75.000	Verizon Communications, Inc.	USD	2,550 %	21/03/2031	56.783	0,20
174.000	Verizon Communications, Inc.	GBP	4,750 %	17/02/2034	226.952	0,80
175.000	Wells Fargo & Co.	GBP	2,500 %	02/05/2029	182.835	0,64
100.000	Welltower, Inc.	GBP	4,500 %	01/12/2034	124.343	0,44
					3.561.680	12,54
Venezuela						
	Petroleos de Venezuela S.A.	USD	6,000 %	28/10/2022	24.693	0,09
824.700						
TOTAL DE BO	NOS				25.760.716	90.71
	NOS				25.760.716 Valor de mercado en	90,71
TOTAL DE BO	NOS					90,71 % del patrimonio
TOTAL DE BO (coste GBP 25 Tenencias Fondos de in	NOS 3.317.025)				Valor de mercado en	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·
TOTAL DE BO (coste GBP 25 Tenencias Fondos de in Irlanda	NOS i.317.025) Descripción del valor eversión – 4,11 %	cciones de acun	nulación X) <sup>(d)(e)</sup>		Valor de mercado en GBP	% del patrimonio
TOTAL DE BO (coste GBP 25 Tenencias Fondos de in Irlanda	NOS i.317.025) Descripción del valor	cciones de acun	nulación X) <sup>(d)(e)</sup>		Valor de mercado en	·
TOTAL DE BO (coste GBP 25 Tenencias Fondos de in Irlanda	NOS i.317.025)  Descripción del valor aversión – 4,11 %  Goldman Sachs - Sterling Liquid Reserves Fund (Clase de a	cciones de acun	nulación X) <sup>(d)(e)</sup>		Valor de mercado en GBP	% del patrimonio
TOTAL DE BO (coste GBP 25 Tenencias Fondos de in Irlanda 117 TOTAL DE FO (coste GBP 1. TOTAL DE VA	NOS i.317.025)  Descripción del valor iversión – 4,11 %  Goldman Sachs - Sterling Liquid Reserves Fund (Clase de a  NDOS DE INVERSIÓN 168.095)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA			AL.	1.168.140	% del patrimonio 4,11
TOTAL DE BO (coste GBP 25 Tenencias Fondos de in Irlanda 117 TOTAL DE FO (coste GBP 1. TOTAL DE VA	NOS i.317.025)  Descripción del valor iversión – 4,11 %  Goldman Sachs - Sterling Liquid Reserves Fund (Clase de a  NDOS DE INVERSIÓN 168.095)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA		LORES OFICIA	AL.	1.168.140 1.168.140 26.928.856	% del patrimonio 4,11 4,11 94,82
TOTAL DE BO (coste GBP 25 Tenencias Fondos de in Irlanda 117 TOTAL DE FO (coste GBP 1.	NOS i.317.025)  Descripción del valor iversión – 4,11 %  Goldman Sachs - Sterling Liquid Reserves Fund (Clase de a  NDOS DE INVERSIÓN 168.095)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA			NL Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	1.168.140	% del patrimonio 4,11 4,11 94,82 % de
TOTAL DE BO (coste GBP 25 Tenencias Fondos de in Irlanda 117 TOTAL DE FO (coste GBP 1. TOTAL DE VA (coste GBP 26 Tenencias	NOS i.317.025)  Descripción del valor iversión – 4,11 %  Goldman Sachs - Sterling Liquid Reserves Fund (Clase de a NDOS DE INVERSIÓN 168.095)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA i.485.120)	BOLSA DE VA	LORES OFICIA		1.168.140  1.68.140  26.928.856  Valor de mercado en GBP	% del patrimonio
TOTAL DE BO (coste GBP 25  Tenencias  Fondos de in Irlanda  117  TOTAL DE FO (coste GBP 1.  TOTAL DE VA (coste GBP 26  Tenencias  Valores mobil	NOS i.317.025)  Descripción del valor iversión – 4,11 %  Goldman Sachs - Sterling Liquid Reserves Fund (Clase de a NDOS DE INVERSIÓN 168.095)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA 6.485.120)  Descripción del valor	BOLSA DE VA	LORES OFICIA Tipo de interés <sup>(a)</sup>		1.168.140  1.68.140  26.928.856  Valor de mercado en GBP	% del patrimonio 4,11 4,11 94,82 % de
TOTAL DE BO (coste GBP 25  Tenencias  Fondos de in Irlanda  117  TOTAL DE FO (coste GBP 1.  TOTAL DE VA (coste GBP 26  Tenencias  Valores mobil	NOS i.317.025)  Descripción del valor iversión – 4,11 %  Goldman Sachs - Sterling Liquid Reserves Fund (Clase de a NDOS DE INVERSIÓN 168.095)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA 6.485.120)  Descripción del valor iarios negociados en otro mercado regulado	BOLSA DE VA	LORES OFICIA Tipo de interés <sup>(a)</sup>		1.168.140  1.68.140  26.928.856  Valor de mercado en GBP	% del patrimonio 4,11 4,11 94,82 % de
TOTAL DE BO (coste GBP 25  Tenencias  Fondos de in Irlanda  117  TOTAL DE FO (coste GBP 1.  TOTAL DE VA (coste GBP 26  Tenencias  Valores mobil Obligaciones Reino Unido	NOS i.317.025)  Descripción del valor iversión – 4,11 %  Goldman Sachs - Sterling Liquid Reserves Fund (Clase de a NDOS DE INVERSIÓN 168.095)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA 6.485.120)  Descripción del valor iarios negociados en otro mercado regulado	BOLSA DE VA	LORES OFICIA Tipo de interés <sup>(a)</sup>		1.168.140  1.68.140  26.928.856  Valor de mercado en GBP	% del patrimonio 4,11 4,11 94,82 % de
TOTAL DE BO (coste GBP 25 Tenencias Fondos de in Irlanda 117 TOTAL DE FO (coste GBP 1. TOTAL DE VA (coste GBP 25 Tenencias Valores mobil Obligaciones Reino Unido 92.700	NOS i.317.025)  Descripción del valor iversión – 4,11 %  Goldman Sachs - Sterling Liquid Reserves Fund (Clase de a NDOS DE INVERSIÓN 168.095)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA 6.485.120)  Descripción del valor iarios negociados en otro mercado regulado son garantía de activos no emitidos ni garantizados  Canary Wharf Finance II Plc. "A1"	BOLSA DE VA  Divisa  por agencias -	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	1.168.140  1.168.140  26.928.856  Valor de mercado en GBP	% del patrimonio 4,11 4,11 94,82 % de patrimonio
TOTAL DE BO (coste GBP 25  Tenencias  Fondos de in Irlanda  117  TOTAL DE FO (coste GBP 1.  TOTAL DE VA (coste GBP 25  Tenencias  Valores mobil Obligaciones Reino Unido 92.700  Estados Unido	NOS i.317.025)  Descripción del valor iversión – 4,11 %  Goldman Sachs - Sterling Liquid Reserves Fund (Clase de a NDOS DE INVERSIÓN 168.095)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA 6.485.120)  Descripción del valor iarios negociados en otro mercado regulado son garantía de activos no emitidos ni garantizados  Canary Wharf Finance II Plc. "A1"	BOLSA DE VA  Divisa  por agencias -	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	1.168.140  1.168.140  26.928.856  Valor de mercado en GBP	% del patrimonio 4,11 4,11 94,82 % de patrimonio
TOTAL DE BO (coste GBP 25 Tenencias Fondos de in Irlanda 117 TOTAL DE FO (coste GBP 1. TOTAL DE VA (coste GBP 26 Tenencias Valores mobil Obligaciones Reino Unido 92.700 Estados Unide 190.529	Descripción del valor  IVERSIÓN  GOIdman Sachs - Sterling Liquid Reserves Fund (Clase de a  NDOS DE INVERSIÓN  168.095)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA  3.485.120)  Descripción del valor  iarios negociados en otro mercado regulado  s con garantía de activos no emitidos ni garantizados  Canary Wharf Finance II Plc. "A1"	BOLSA DE VA  Divisa  por agencias -  GBP	Tipo de interés(a)  - 0,94 %  6,455 %	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup> 22/10/2033	1.168.140  1.168.140  26.928.856  Valor de mercado en GBP	% del patrimonio 4,11 4,11 94,82 % de patrimonio 0,40
TOTAL DE BO (coste GBP 25 Tenencias Fondos de in Irlanda 117 TOTAL DE FO (coste GBP 1. TOTAL DE VA (coste GBP 26 Tenencias Valores mobil Obligaciones Reino Unido 92.700 Estados Unide 190.529 26.764	Descripción del valor  IVERSIÓN  Goldman Sachs - Sterling Liquid Reserves Fund (Clase de a NDOS DE INVERSIÓN 168.095)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA 3.485.120)  Descripción del valor idiarios negociados en otro mercado regulado e con garantía de activos no emitidos ni garantizados  Canary Wharf Finance II Plc. "A1"  DS  1 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2007-4 "1A1"  DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR6 "2A1A"(c)	Divisa  Por agencias -  GBP  USD USD	Tipo de interés(a) - 0,94 % 6,455 % 6,000 % 0,669 %	22/10/2033 25/05/2037 19/10/2045	1.168.140  1.168.140  26.928.856  Valor de mercado en GBP  113.026  97.525 19.536	% del patrimonio  4,11  94,82  % de patrimonio  0,40  0,34  0,07
TOTAL DE BO (coste GBP 25  Tenencias  Fondos de in Irlanda  117  TOTAL DE FO (coste GBP 1.  TOTAL DE VA (coste GBP 26  Tenencias  Valores mobil Obligaciones Reino Unido 92.700  Estados Unide 190.529 26.764	Descripción del valor  IVERSIÓN  GOIDMAN SACHS - Sterling Liquid Reserves Fund (Clase de a NDOS DE INVERSIÓN 168.095)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA 3.485.120)  Descripción del valor idiarios negociados en otro mercado regulado e con garantía de activos no emitidos ni garantizados  Canary Wharf Finance II Plc. "A1"  DESCRIPCIÓN DESCRI	Divisa  por agencias -  GBP  USD	Tipo de interés(a) - 0,94 % 6,455 % 6,000 %	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup> 22/10/2033 25/05/2037	1.168.140  1.168.140  26.928.856  Valor de mercado en GBP  113.026  97.525 19.536 36.779	% del patrimonio 4,11 94,82 % de patrimonio 0,40 0,34 0,07 0,13
TOTAL DE BO (coste GBP 25 Tenencias Fondos de in Irlanda 117 TOTAL DE FO (coste GBP 1. TOTAL DE VA (coste GBP 25 Tenencias Valores mobil Obligaciones Reino Unido 92.700 Estados Unida 190.529 26.764 73.881	Descripción del valor  IVERSIÓN  Goldman Sachs - Sterling Liquid Reserves Fund (Clase de a NDOS DE INVERSIÓN 168.095)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA 6.485.120)  Descripción del valor  iarios negociados en otro mercado regulado e con garantía de activos no emitidos ni garantizados  Canary Wharf Finance II Plc. "A1"  DS  CHL Mortgage Pass-Through Trust 2007-4 "1A1"  DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR6 "2A1A"(c)  RALI Serie 2006-QS12 Trust "1A1"	Divisa  Por agencias -  GBP  USD  USD  USD	Tipo de interés(a)  - 0,94 %  6,455 %  6,000 %  0,669 %  6,500 %	22/10/2033 25/05/2037 19/10/2045 25/09/2036	1.168.140  1.168.140  26.928.856  Valor de mercado en GBP  113.026  97.525 19.536	% del patrimonio  4,11  94,82  % de patrimonio  0,40  0,34  0,07  0,13
TOTAL DE BO (coste GBP 25 Tenencias Fondos de in Irlanda 117 TOTAL DE FO (coste GBP 1. TOTAL DE VA (coste GBP 25 Tenencias Valores mobil Obligaciones Reino Unido 92.700 Estados Unida 190.529 26.764 73.881	Descripción del valor  Goldman Sachs - Sterling Liquid Reserves Fund (Clase de a NDOS DE INVERSIÓN 168.095)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA 6.485.120)  Descripción del valor diarios negociados en otro mercado regulado e con garantía de activos no emitidos ni garantizados  Canary Wharf Finance II Plc. "A1"  DS  CHL Mortgage Pass-Through Trust 2007-4 "1A1"  DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR6 "2A1A"(c)  RALI Serie 2006-QS12 Trust "1A1"	Divisa  Por agencias -  GBP  USD  USD  USD	Tipo de interés(a)  - 0,94 %  6,455 %  6,000 %  0,669 %  6,500 %	22/10/2033 25/05/2037 19/10/2045 25/09/2036	1.168.140  1.168.140  26.928.856  Valor de mercado en GBP  113.026  97.525 19.536 36.779	% del patrimonio  4,11  94,82  % de patrimonio  0,40  0,34  0,07  0,13  0,54
TOTAL DE BO (coste GBP 25 Tenencias Fondos de in Irlanda 117 TOTAL DE FO (coste GBP 1. TOTAL DE VA (coste GBP 26 Tenencias Valores mobil Obligaciones Reino Unido 92.700 Estados Unida 190.529 26.764 73.881 TOTAL DE OB (coste GBP 54	Descripción del valor  Goldman Sachs - Sterling Liquid Reserves Fund (Clase de a NDOS DE INVERSIÓN 168.095)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA 6.485.120)  Descripción del valor diarios negociados en otro mercado regulado e con garantía de activos no emitidos ni garantizados  Canary Wharf Finance II Plc. "A1"  DS  CHL Mortgage Pass-Through Trust 2007-4 "1A1"  DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR6 "2A1A"(c)  RALI Serie 2006-QS12 Trust "1A1"	Divisa  Divisa  Por agencias -  GBP  USD  USD  USD  NI GARANTIZA	Tipo de interés(a)  - 0,94 %  6,455 %  6,000 %  0,669 %  6,500 %	22/10/2033 25/05/2037 19/10/2045 25/09/2036	1.168.140  1.168.140  26.928.856  Valor de mercado en GBP  113.026  97.525 19.536 36.779 153.840	% del patrimonio 4,11 4,11 94,82 % de patrimonio
TOTAL DE BO (coste GBP 25 Tenencias Fondos de in Irlanda 117 TOTAL DE FO (coste GBP 1. TOTAL DE VA (coste GBP 26 Tenencias Valores mobil Obligaciones Reino Unido 92.700 Estados Unida 190.529 26.764 73.881 TOTAL DE OB (coste GBP 54	Descripción del valor  IVERSIÓN  Goldman Sachs - Sterling Liquid Reserves Fund (Clase de a NDOS DE INVERSIÓN 168.095)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA 6.485.120)  Descripción del valor diarios negociados en otro mercado regulado e con garantía de activos no emitidos ni garantizados  Canary Wharf Finance II Plc. "A1"  DS  CHL Mortgage Pass-Through Trust 2007-4 "1A1"  DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR6 "2A1A"(c)  RALI Serie 2006-QS12 Trust "1A1"  LIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS NO EMITIDOS 15.705)  LORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO	Divisa  Divisa  Por agencias -  GBP  USD  USD  USD  NI GARANTIZA	Tipo de interés(a)  - 0,94 %  6,455 %  6,000 %  0,669 %  6,500 %	22/10/2033 25/05/2037 19/10/2045 25/09/2036	1.168.140  1.168.140  26.928.856  Valor de mercado en GBP  113.026  97.525 19.536 36.779 153.840	% del patrimonio  4,11  94,82  % de patrimonio  0,40  0,34  0,07  0,13  0,54
TOTAL DE BO (coste GBP 25 Tenencias Fondos de in Irlanda 117 TOTAL DE FO (coste GBP 1. TOTAL DE VA (coste GBP 26 Tenencias Valores mobil Obligaciones Reino Unido 92.700 Estados Unida 190.529 26.764 73.881  TOTAL DE OB (coste GBP 54 TOTAL DE VA (coste GBP 54	Descripción del valor  IVERSIÓN – 4,11 %  Goldman Sachs - Sterling Liquid Reserves Fund (Clase de a NDOS DE INVERSIÓN 168.095)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA 6.485.120)  Descripción del valor diarios negociados en otro mercado regulado 6 con garantía de activos no emitidos ni garantizados 10 Canary Wharf Finance II Plc. "A1"  DISCA Mortgage Pass-Through Trust 2007-4 "1A1"  DISLA Mortgage Loan Trust 2005-AR6 "2A1A"(c)  RALI Serie 2006-QS12 Trust "1A1"  LIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS NO EMITIDOS 15.705)  LORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO 15.705)  ERCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADO	Divisa  Divisa  Por agencias -  GBP  USD  USD  USD  USD  NI GARANTIZA	Tipo de interés(a)  - 0,94 %  6,455 %  6,000 %  0,669 %  6,500 %	22/10/2033 25/05/2037 19/10/2045 25/09/2036	1.168.140  1.168.140  26.928.856  Valor de mercado en GBP  113.026  97.525 19.536 36.779 153.840  266.866	% del patrimonio  4,11  94,82  % de patrimonio  0,40  0,34  0,07  0,13  0,54

Contratos	de futu	ıros – 0,07 %							
Número de contratos	Des	cripción del valor					Valor de mercado de la asignación GBP	Plusvalía latente en GBP	% del patrimonio
	AU	D							
		uros sobre bonos del T	esoro de Australia a	10 años 15/12/2021		Larga	74.697	772	0,00
	GB 19 Fut		Estado británico (gilts	s) a largo plazo 29/03/2022		Larga	2.408.060	32.090	0,11
	USI		LTagara da EE JUL	- 40 - <del></del>		Loren	1.569.669	24.254	0.00
		uros sobre pagarés del uros sobre bonos del T		muy largo plazo 22/03/2022		Larga Larga	149.519	24.351 5.364	0,09 0,02
							1.719.188	29.715	0,11
PLUSVAL	ÍA LATE	NTE SOBRE CONTRA	ATOS DE FUTUROS					62.577	0,22
Número de contratos	Des	cripción del valor					Valor de mercado de la asignación GBP	Minusvalía latente en GBP	% del patrimonio de los Accionistas
	EUI	R							
	. ,			de Alemania a 10 años 08/12/2 de Alemania a 2 años 08/12/20		Corta	(293.927) (191.543)	(2.964)	(0,01)
	` '		•	de Alemania a 2 años 08/12/20 de Alemania a 5 años 08/12/20		Corta Corta	(1.270.795)	(9) (5.059)	(0,00) (0,02)
							(1.756.265)	(8.032)	(0,03)
	US	D							
	. ,	uros sobre bonos del T uros sobre pagarés del		largo plazo 22/03/2022		Corta Corta	(363.716) (327.891)	(8.702)	(0,03) (0,00)
	. ,	uros sobre pagarés del uros sobre pagarés del				Corta	(728.742)	(1.158) (6.435)	(0,00)
	(9) Fut	uros sobre pagarés del	l Tesoro de EE. UU.	a muy largo plazo a 10 años 2	2/03/2022	Corta	(990.201)	(19.105)	(0,07)
							(2.410.550)	(35.400)	(0,12)
MINUSVAL	ÍA LATE	NTE SOBRE CONTRA	ATOS DE FUTUROS	3				(43.432)	(0,15)
Contratos	de divi	sas a plazo – (0,25 %	%)						
Divisa		Compra	Divisa	v	/enta		Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en GBP	% del patrimonio de los Accionistas
USD		94.567	EUR	79	.682		15/12/2021	2.889	0,01
USD		89.790	JPY	9.886			15/12/2021	1.478	0,00
USD		63.180	GBP		.818		21/01/2022	434	0,00
PLUSVALÍ	A LATEN	ITE SOBRE CONTRA	TOS DE DIVISAS A	PLAZO				4.801	0,01
Divisa		Compra	Divisa	v	'enta		Fecha de vencimiento		% del patrimonio de los Accionistas
CAD		41.768	USD		.150		15/12/2021	, ,	(0,00)
NZD SEK		48.256 340.015	USD USD		.252 .557		15/12/2021 15/12/2021	( /	(0,00) (0,01)
GBP		1.406.300	USD	1.938			21/01/2022	, ,	(0,01)
GBP		2.045.210	EUR	2.431	.454		10/02/2022	(28.670)	(0,10)
MINUSVAL	ÍA LATE	NTE SOBRE CONTRA	ATOS DE DIVISAS	A PLAZO				(74.704)	(0,26)
Opciones	- (0,03	%)					Plusvalía/	Valor de	% del
Tenencias		Descripción del valo	or					mercado en	patrimonio e los Accionistas
		Opciones adquirid	las						
	650.00	GBP	CONIA a 12 magas	Vence 09/00/2022	Precio de ciorcisio 0.22		(744)	157	0.00
	840.000	<ul><li>Call Swaption del S</li><li>Call Swaption del S</li></ul>		Vence 08/09/2022 Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,28 Precio de ejercicio 0,30		(744) (971)	157 215	0,00 0,00
	770.000	•		Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,42		(908)	305	0,00
	710.000	•		Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,46		(804)	318	0,00
	800.000	•		Vence 11/10/2022	Precio de ejercicio 0,92		(169)	1.431	0,01
	6∠0.00	O Call Swaption del S	ONIA a 12 meses	Vence 13/10/2022	Precio de ejercicio 0,93		(160)	1.137	0,00

Tononoico	Descripción del valo-			Plusvalía /(minusvalía) latente GBP	Valor de mercado en GBP	% de
Tenencias	Descripción del valor			GBP	GBP	patrimonio
	Opciones adquiridas – (continuación)					
770 000	GBP – (continuación) Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 15/11/2022	Propio do pioreigio 0.52	(967)	439	0.00
770.000	•		Precio de ejercicio 0,52	(867)		0,00
710.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,54	(770)	443	0,00
				(5.393)	4.445	0,01
COTAL DE OPC	ONES ADQUIRIDAS 38)				4.445	0,01
-	Opciones suscritas					
(00,000)	GBP	\/ 00/00/0000	Descis de circuicio 0.00	400	(000)	(0.00)
(60.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022 Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,36	199 231	(606)	(0,00)
(90.000) (80.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,40 Precio de ejercicio 0,38	291	(1.000) (932)	(0,00)
(70.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022 Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,38	175	, ,	(0,00)
	•	Vence 11/10/2022	•		(906)	(0,00)
(80.000) (70.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 13/10/2022	Precio de ejercicio 1,04 Precio de ejercicio 0,99	(1.842) (1.259)	(3.364)	(0,01)
	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 15/11/2022	•		(2.716)	(0,01)
(70.000) (80.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,55 Precio de ejercicio 0,60	(158) (320)	(1.307)	(0,01) (0,01)
(00.000)	Call Swaption del SONIA à 12 meses	Vence 10/11/2022	riedo de ejerdido 0,00	(2.683)	(1.642)	(0,04)
TOTAL DE OPC	IONES SUSCRITAS			(2.000)	(12.473)	(0,04)
(coste GBP (9.7					(12.473)	(0,04)
TOTAL DE OPC	IONES				(0.000)	(0.00)
(coste GBP 48)					(8.028)	(0,03)
Contratos de p	permutas financieras – 0,10 %					% del
					Plusvalia	patrimonio
Importe teórico					latente en	de los
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	GBP	Accionistas
	Permutas de tipos de interés					
90.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,400 %	BRL	02/01/2023	100	0,00
510.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,300 %	BRL	02/01/2024	653	0,00
554.300	Fijo 6,320 %	Variable (BRCDI a 1				
		mes en BRL)	BRL	02/01/2025	7.092	0,03
550.000	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 11,230 %	BRL	04/01/2027	329	0,00
590.000	Fijo 1,750 %	Variable (CDOR a 3				
		meses en CAD)	CAD	15/12/2026	607	0,00
310.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,500 %	CAD	14/10/2031	1.782	0,01
430.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,250 %	CAD	15/12/2051	4.925	0,02
450.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,000 %	CHF	16/03/2032	3.593	0,01
1.890.117	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,500 %	CNY	15/09/2023	138	0,00
810.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,750 %	CNY	15/09/2026	670	0,00
182.313	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2023	105	0,00
528.841	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2026	1.638	0,01
210.000	Fijo 0,000 %	Variable (EURIBOR a 6	EUD	15/12/2028	4.500	0.04
20.000	Variable (ELIBIBOD a 6 masses on ELIB)	meses en EUR)	EUR EUR		1.586 117	0,01 0,00
30.000 1.790.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2031	117	0,00
1.790.000	Fijo 0,750 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2028	31.168	0,11
1.090.000	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	Fijo 0,750 %	GBP	15/12/2031	2.908	0,01
850.000	Fijo 1,000 %	Variable (SONIA a 1	OBI	10/12/2001	2.000	0,01
000.000	1 10 1,000 70	mes en GBP)	GBP	15/12/2036	643	0,00
1.880.000	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	Fijo 1,000 %	GBP	15/12/2041	18.081	0,06
1.170.000	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	Fijo 0,750 %	GBP	15/12/2051	27.157	0,10
9.080.000	Variable (LIBOR a 3 meses en KRW)	Fijo 1,500 %	KRW	16/03/2024	22	0,00
1.179.632	Fijo 6,700 %	Variable (TIIE a 1 mes				•
		en MXN)	MXN	09/12/2026	1.072	0,00
325.000	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	Fijo 1,750 %	PLN	15/12/2023	260	0,00
323.000	Fijo 1,700 %	Variable (WIBOR a 6				
25.000		meses en PLN)	PLN	15/12/2026	250	0,00
25.000		Fijo 0,500 %	SEK	16/03/2024	1.055	0,00
25.000 5.610.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)		SEK	15/12/2031	987	0,00
25.000 5.610.000 2.680.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,750 %		05/07/0004	•	0,00
25.000 5.610.000 2.680.000 2.020.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Fijo 1,000 %	Fijo 1,000 %	USD	25/07/2024	8	0,00
25.000 5.610.000 2.680.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	•		25/07/2024 15/12/2031	4.506	0,02
25.000 5.610.000 2.680.000 2.020.000 510.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Fijo 1,000 %	Fijo 1,000 % Fijo 1,750 %	USD			
25.000 5.610.000 2.680.000 2.020.000 510.000 PLUSVALÍA LA	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Fijo 1,000 % Variable (LIBOR a 3 meses en USD) ATENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS D Permutas de incumplimiento crediticio	Fijo 1,000 % Fijo 1,750 % E INTERÉS (CDS)	USD		4.506	0,02
25.000 5.610.000 2.680.000 2.020.000 510.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Fijo 1,000 % Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	Fijo 1,000 % Fijo 1,750 % E INTERÉS	USD		4.506	0,02
25.000 5.610.000 2.680.000 2.020.000 510.000 PLUSVALÍA LA	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Fijo 1,000 % Variable (LIBOR a 3 meses en USD)  VEENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS D  Permutas de incumplimiento crediticio Variable (Bonos internacionales del	Fijo 1,000 % Fijo 1,750 % E INTERÉS (CDS)	USD USD	15/12/2031	4.506 111.452	0,02

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Importe teórico local neto						
local neto					Plusvalía latente en	% del patrimonio de los
	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	GBP	Accionistas
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)	1				
00.000	- (continuación)	F::- 4 000 %	HOD	00/40/0004	44.4	0.00
20.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Catar)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	114	0,00
1.050.000	Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 34 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2025	3.882	0,01
PLUSVALÍA L	ATENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMIE	NTO CREDITICIO (CDS)			6.050	0,02
	Permutas de inflación					
70.000	Fijo 2,250 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/10/2023	43	0,00
100.000	Fijo 3,250 %	Variable (LIBOR a 12 meses en USD)	USD	07/10/2022	868	0,00
PI USVAI ÍA I	ATENTE SOBRE PERMUTAS DE INFLACIÓN				911	0,00
	USVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE P	FRMUTAS FINANCIFRAS			118.413	0,41
TOTAL DETE	OUVALIA LA LA LA COBAL CONTRA CO DE T	ENIMO IAO I INANOIENAO			110.410	•
Importe					Minusvalía	% del patrimonio
teórico			<b>.</b>		latente en	de los
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	GBP	Accionistas
	Permutas de tipos de interés					
2.750.000	Variable (BBSW a 3 meses en AUD)	Fijo 0,190 %	AUD	22/02/2023	(3.509)	(0,01)
2.050.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 1,250 %	AUD	15/12/2026	(16.976)	(0,06)
460.000 80.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 2,000 % Fijo 10,565 %	AUD BRL	15/12/2031 02/01/2023	(4.318)	(0,02)
820.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (LIBOR a 1 mes en BRL)	Fijo 7,200 %	BRL	02/01/2023	(88) (4.156)	(0,00) (0,01)
365.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 4,930 %	BRL	02/01/2024	(4.340)	(0,01)
402.878	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 9,200 %	BRL	02/01/2024	(953)	(0,02)
470.000	Fijo 2,000 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2031	(4.215)	(0,01)
850.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2024	(1.736)	(0,01)
160.000	Fijo 0,900 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en	EUR	20/05/2029	(4.641)	(0,02)
30.000	Fijo 0,500 %	EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en	EUR	15/12/2041	(877)	(0,00)
90.000	Fijo 0,250 %	EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en	EUR	15/12/2051	(1.529)	(0,01)
1 110 000	Veriable (CONIA a 1 mas an CDD)	EUR)	CDD	45/40/0000	(40, 400)	(0.04)
1.140.000 340.000	Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	Fijo 0,250 % Fijo 0,250 %	GBP GBP	15/12/2023 15/12/2024	(10.480) (5.355)	(0,04) (0,02)
770.000	Fijo 0,500 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2024	(1.831)	(0,02)
40.000	Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)	Fijo 4,060 %	GBP	15/12/2028	(3.051)	(0,01)
48.280.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)	JPY	15/12/2031	(492)	(0,00)
2.460.000	Fijo 2,000 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	16/03/2027	(2.281)	(0,01)
2.590.000	Fijo 2,130 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	11/05/2031	(2.172)	(0,01)
680.000	Fijo 2,000 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	16/03/2032	(1.053)	(0,00)
340.000	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 1,250 %	NZD	15/12/2022	(324)	(0,00)
240.000	Fijo 2,000 %	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	NZD	15/12/2031	(402)	(0,00)
1.240.000	Fijo 0,250 %	Variable (WIBOR a 3 meses en PLN)	PLN	16/12/2021	(424)	(0,00)
2.200.000 390.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,250 %	SEK USD	15/12/2026 16/03/2024	(342)	(0,00) (0,00)
530.000	Fijo 0,250 % Fijo 1,000 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD) Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2027	(1.200) (1.402)	(0,00)
210.000	Fijo 1,750 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2052	(2.939)	(0,01)
MINUSVALÍA	LATENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE IN	TERÉS	-		(81.086)	(0,28)
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)	ή				
150.000	Variable (Unibail-Rodamco- Westfield S.E.)	Fijo 1,000 %	EUR	20/06/2024	(763)	(0,00)
1.800.000	Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 28 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2022	(19)	(0,00)
MINUSVALÍA	LATENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMI	ENTO CREDITICIO (CDS)			(782)	(0,00)
90.000	Permutas de inflación Fijo 1,920 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/11/2031	(508)	(0,00)
150.000	Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)	Fijo 4,170 %	GBP	15/11/2028	(8.677)	(0,03)
MINUSVALÍA	LATENTE SOBRE PERMUTAS DE INFLACIÓN				(9.185)	(0,03)
TOTAL DE MII PERMUTAS F	NUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE INANCIERAS				(91.053)	(0,31)
-	ERCADO DE LAS INVERSIONES				27.164.296	95,65
<u> </u>	/OS Y PASIVOS				1.234.320	4,35

28.398.616

100,00

PATRIMONIO

TOTAL DE INVERSIONES	Valor de mercado en GBP %	en BP % del patrimonio	
Total inversiones excluyendo derivados (coste GBP 27.030.825)	27.195.722	95,76	
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	62.577	0,22	
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(43.432)	(0,15)	
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	4.801	0,01	
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	(74.704)	(0,26)	
Valor de mercado de opciones compradas (coste GBP 9.838)	4.445	0,01	
Valor de mercado de opciones suscritas (coste GBP (9.790))	(12.473)	(0,04)	
Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	118.413	0,41	
Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	(91.053)	(0,31)	
Otros activos y pasivos	1.234.320	4,35	
Patrimonio	28.398.616	100,00	

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, JP Morgan Chase Bank N.A. y Royal Bank of Canada. Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Citibank N.A., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc. y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Credit Suisse y Merrill Lynch International.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,40 %.

<sup>(</sup>a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.

<sup>(</sup>b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.

<sup>(</sup>c) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.

<sup>(</sup>d) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

<sup>(</sup>e) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,039 %.

					Valor de mercado	0/ -1-
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	en USD	% de patrimonio
Valores mobi	liarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial					
Bonos – 74,8 Australia						
	APT Pipelines Ltd.	EUR	2,000 %	15/07/2030	1.514.963	0,10
	AusNet Services Holdings Pty Ltd. (c)	EUR	1,625 %	11/03/2081	1.653.563	0,11
	Australia & New Zealand Banking Group Ltd.(c)	GBP	1,809 %	16/09/2031	4.883.405	0,32
	Macquarie Bank Ltd.	GBP	1,125 %	15/12/2025	7.014.190	0,46
	•	EUR		17/09/2029	3.849.155	0,25
	Origin Energy Finance Ltd.		1,000 %			
3.950.000	Westpac Banking Corp. (c)	USD	2,668 %	15/11/2035	3.872.619	1,50
Austria					22.767.693	1,50
2.900.000	BAWAG Group AG <sup>(c)</sup>	EUR	2,375 %	26/03/2029	3.406.547	0,22
2.700.000	Raiffeisen Bank International AG(c)	EUR	2,875 %	18/06/2032	3.307.435	0,22
4.200.000	Volksbank Wien AG	EUR	0,875 %	23/03/2026	4.809.653	0,32
					11.523.635	0,76
Bélgica						
	Ageas S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	1,875 %	24/11/2051	2.971.991	0,20
	Anheuser-Busch InBev S.A./NV	EUR	3,700 %	02/04/2040	1.187.822	0,08
2.600.000	KBC Group NV <sup>(c)</sup>	GBP	1,250 %	21/09/2027	3.411.816	0,22
					7.571.629	0,50
Bermudas	Bacardi Ltd.	EUR	2,750 %	03/07/2023	8.430.003	0,55
	IHS Markit Ltd.	USD	3,625 %	03/07/2023	422.332	0,03
	IHS Markit Ltd.	USD	4,250 %	01/05/2029	1.194.154	0,03
1.030.000	INS WAINLEU.	030	4,250 %	01/05/2029		
Islas Vírgenes	Pritánicas				10.046.489	0,66
-	Huarong Finance 2017 Co., Ltd. <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	Perp.	267.300	0,02
	Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	USD	3,375 %	24/02/2030	195.825	0,02
	Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	5,000 %	19/11/2025	205.000	0,01
	TSMC Global Ltd.	USD	2,250 %	23/04/2031	680.462	0,05
000.000	Tolivio Global Eta.	OOD	2,230 70	20/04/2001	1.348.587	0,09
Canadá					1.340.367	0,03
	Bank of Nova Scotia	GBP	1,250 %	17/12/2025	5.280.238	0,35
	Canadian Pacific Railway Co.	USD	2,450 %	02/12/2031	1.922.914	0,13
	Suncor Energy, Inc.	USD	3,100 %	15/05/2025	2.628.850	0,17
	Teck Resources Ltd.	USD	3,900 %	15/07/2030	6.538.948	0,43
					16.370.950	1,08
Islas Caimán						
300.000	CK Hutchison International 19 II Ltd.	USD	2,750 %	06/09/2029	312.603	0,02
1.210.000	CK Hutchison International 20 Ltd.	USD	2,500 %	08/05/2030	1.235.095	0,08
2.220.000	CK Hutchison International 21 Ltd.	USD	2,500 %	15/04/2031	2.268.940	0,15
400.000	DP World Crescent Ltd.	USD	4,848 %	26/09/2028	449.000	0,03
500.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd.	USD	4,500 %	14/02/2022	502.974	0,03
2.660.000	Tencent Holdings Ltd.	USD	3,595 %	19/01/2028	2.850.164	0,19
					7.618.776	0,50
Chile	Ronos internacionales del Estado de Chilo	Hen	2 100 0/	22/04/2024	277 044	0.00
	Bonos internacionales del Estado de Chile GNL Quintero S.A.	USD	3,100 %	22/01/2061	277.814	0,02
2.912.073	GNL QUINTERO S.A.	USD	4,634 %	31/07/2029	3.102.486	0,20
Cupacis					3.380.300	0,22
1.350.000	Bonos internacionales del Estado de Croacia	EUR	1,500 %	17/06/2031	1.546.851	0,10
Dinamarca						
2.925.000	Danske Bank A/S <sup>(c)</sup>	EUR	(0,018 %)	10/11/2024	3.331.674	0,22
5.225.000	Danske Bank A/S <sup>(c)</sup>	EUR	1,375 %	12/02/2030	6.014.889	0,39
2.800.000	Nykredit Realkredit AS <sup>(c)</sup>	EUR	0,875 %	28/07/2031	3.164.954	0,21
					12.511.517	0,82
						-,

					en	% de
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	USD	patrimoni
Bonos – (cont	tinuación)					
Finlandia						
	Nordea Bank Abp <sup>(C)</sup>	GBP	1,625 %	09/12/2032	3.007.521	0,2
2.250.000	SBB Treasury OYJ	EUR	0,750 %	14/12/2028	2.454.864	0,1
					5.462.385	0,3
Francia	Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.	GBP	1,000 %	16/07/2026	5.248.413	0,3
	BNP Paribas S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	0,875 %	31/08/2033	4.736.923	0,3
	BPCE S.A.	GBP	1,000 %	22/12/2025	5.122.830	0,3
	BPCE S.A. – Serie NC5 <sup>(c)</sup>	EUR	1,500 %	13/01/2042	1.807.271	0,1
	CNP Assurances	EUR	0,375 %	08/03/2028	3.964.240	0,2
3.000.000	Crédit Agricole S.A.(c)	EUR	1,625 %	05/06/2030	3.504.182	0,2
2.000.000	Crédit Agricole S.A.(c)	GBP	1,874 %	09/12/2031	2.623.699	0,1
3.200.000	Électricité de France S.A.(c)	EUR	2,875 %	Perp.	3.732.150	0,2
2.000.000	La Mondiale SAM	EUR	2,125 %	23/06/2031	2.380.156	0,1
4.600.000	Société Générale S.A.(c)	EUR	1,125 %	30/06/2031	5.208.727	0,3
800.000	Terega SASU	EUR	0,625 %	27/02/2028	902.561	0,0
1.200.000	Valeo S.A.	EUR	1,000 %	03/08/2028	1.318.703	0,0
					40.549.855	2,6
Alemania	Alliana C.F.(C)	EUD	2.625.0/	Down	2 422 866	0.1
	Allianz S.E. (c) Allianz S.E. 144A(c)(d)	EUR USD	2,625 %	Perp.	2.422.866 1.509.978	0,1
			3,200 %	Perp. 23/09/2031	2.598.946	0,1
	Bayerische Landesbank <sup>(c)</sup>	EUR	1,184 %			0,1
	Commerzbank AG <sup>(c)</sup> Commerzbank AG <sup>(c)</sup>	EUR	4,000 %	05/12/2030	4.325.966	0,2
		EUR	1,375 %	29/12/2031	4.577.715	0,3
	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	USD	2,222 %	18/09/2024	2.390.067	0,1
	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup> Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	USD	2,129 %	24/11/2026	7.221.456	0,4
		EUR	1,750 %	19/11/2030	4.510.752	0,3
	Deutsche Bank AG – Serie E	USD	0,962 %	08/11/2023	2.550.153	0,1
	Landesbank Baden-Wuerttemberg	EUR	2,200 %	09/05/2029	3.114.231	0,2
	Schaeffler AG	EUR	2,750 %	12/10/2025	482.815	0,0
	Schaeffler AG	EUR	3,375 %	12/10/2028	2.788.870	0,1
1.200.000	Volkswagen Bank GmbH	EUR .	1,875 %	31/01/2024	1.415.491	0,0
					39.909.306	2,6
1 510 000	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	4,125 %	15/01/2025	1.637.470	0,1
	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	3,850 %	18/07/2027	2.629.000	0,1
	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	3,350 %	12/03/2071	645.150	0,0
					4.911.620	0,3
Irlanda						
4.725.000	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	6,500 %	15/07/2025	5.407.573	0,3
4.650.000	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	3,000 %	29/10/2028	4.691.897	0,3
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	3,300 %	30/01/2032	2.798.560	0,1
2.625.000	AIB Group Plc.(c)	EUR	1,875 %	19/11/2029	3.035.394	0,2
2.450.000	AIB Group Plc.(c)	EUR	2,875 %	30/05/2031	2.922.883	0,1
3.175.000	Bank of Ireland Group Plc. (c)	EUR	2,375 %	14/10/2029	3.712.982	0,2
3.375.000	Bank of Ireland Group Plc.(c)	EUR	1,375 %	11/08/2031	3.776.632	0,2
2.650.000	Dell Bank International DAC	EUR	1,625 %	24/06/2024	3.129.765	0,2
3.475.000	GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.	USD	4,418 %	15/11/2035	4.225.357	0,2
4.420.000	Perrigo Finance Unlimited Co.	USD	4,375 %	15/03/2026	4.682.194	0,3
2.125.000	STERIS Irish FinCo Unlimited Co.	USD	2,700 %	15/03/2031	2.159.064	0,1
2.750.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. (c)	USD	3,000 %	19/04/2051	2.646.325	0,1
					43.188.626	2,8
Israel 1 630 000	Bonos internacionales del Estado de Israel	USD	3,800 %	13/05/2060	1.863.567	0,1
1.630.000	DOTOS INTERNACIONALES DEL ESTADO DE ISTAEL	090	3,000 %	13/05/2060	1.003.507	0,1
	Aeroporti di Roma SpA	EUR	1,750 %	30/07/2031	4.055.452	0,2
	Enel SpA – Serie 6,5 a <sup>(c)</sup>	EUR	1,375 %	Perp.	5.793.784	0,3
	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	EUR	1,625 %	21/10/2028	3.037.604	0,2
2 625 000				- 1/ 10/2020	0.001.004	0,2
	UniCredit SpA <sup>(c)</sup>	EUR	2,731 %	15/01/2032	1.898.575	0,1

					Valor de mercado	
		<b>5</b>	<b>-</b> : (a)	(b)	en	, % del
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	USD	patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
Japón 2 725 000	Nomura Holdings, Inc.	USD	2,608 %	14/07/2031	2.693.772	0,18
	Norinchukin Bank 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,284 %	22/09/2026	4.997.563	0,10
			-		7.691.335	0,51
Jersey					7.001.000	0,01
	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,160 %	31/03/2034	194.550	0,01
	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,625 %	31/03/2036	195.500	0,01
4.400.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,940 %	30/09/2040	4.361.500	0,29
	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	3,250 %	30/09/2040	360.900	0,02
	Gatwick Funding Ltd.	GBP	2,500 %	15/04/2030	1.569.145	0,10
	Heathrow Funding Ltd.	EUR	1,500 %	12/10/2025	1.418.672	0,09
	Heathrow Funding Ltd.	GBP	2,750 %	13/10/2029	4.200.474	0,28
500.000	Porterbrook Rail Finance Ltd.	GBP	7,125 %	20/10/2026	848.762	0,06
					13.149.503	0,86
Kazajistán	KazMunayGas National Co., JSC	USD	5,375 %	24/04/2030	1.528.170	0,10
	Raziviuriayoas National Co., 30C	03D	5,375 %	24/04/2030	1.326.170	0,10
Luxemburgo 1.675.000	Aroundtown S.A.	GBP	3.000 %	16/10/2029	2.361.126	0,15
	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR	2,000 %	15/02/2024	4.180.667	0,27
2.584.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR	1,250 %	26/04/2027	2.965.756	0,19
2.825.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR	1,000 %	04/05/2028	3.144.353	0,21
2.550.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	GBP	2,625 %	20/10/2028	3.469.798	0,23
	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR	1,625 %	20/04/2030	4.512.218	0,30
	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.	USD	5,150 %	11/02/2026	1.609.500	0,11
	Helvetia Europe S.A.(c)	EUR	2,750 %	30/09/2041	3.018.586	0,20
	Highland Holdings SARL	EUR	(0,081 %)	12/11/2023	1.482.061	0,10
	Logicor Financing SARL	EUR	0,750 %	15/07/2024	893.369	0,06
1.350.000	Logicor Financing SARL	EUR	3,250 %	13/11/2028	1.756.744	0,11
					29.394.178	1,93
México	America Movil SAB de CV	MXN	6,450 %	05/12/2022	667.331	0,04
	Fomento Economico Mexicano SAB de CV	USD	3,500 %	16/01/2050	255.671	0,04
	Mexico City Airport Trust	USD	4,250 %	31/10/2026	658.608	0,02
	Mexico City Airport Trust	USD	3,875 %	30/04/2028	616.867	0,04
	Mexico City Airport Trust	USD	5,500 %	31/07/2047	386.400	0,03
	Mexico City Airport Trust 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,250 %	31/10/2026	221.292	0,01
	Mexico City Airport Trust 144A(d)	USD	3,875 %	30/04/2028	565.462	0,04
200.000	Mexico City Airport Trust 144A(d)	USD	5,500 %	31/10/2046	193.540	0,01
650.000	Mexico City Airport Trust 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,500 %	31/07/2047	627.900	0,04
210.000	Bonos internacionales del Estado de México	USD	4,500 %	22/04/2029	233.104	0,01
	Bonos internacionales del Estado de México	USD	4,280 %	14/08/2041	2.380.771	0,16
	Bonos internacionales del Estado de México	USD	3,771 %	24/05/2061	1.652.157	0,11
	Bonos internacionales del Estado de México	USD	3,750 %	19/04/2071	385.228	0,03
370.000	Trust Fibra Uno	USD	5,250 %	15/12/2024	402.552	0,03
					9.246.883	0,61
Países Bajos	ABN AMRO Bank NV <sup>(c)</sup>	EUR	4,375 %	Perp.	2.755.525	0,18
	ABN AMRO Bank NV 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,375 % 4,750 %	28/07/2025	5.049.788	0,16
	Airbus S.E.	EUR	2,375 %	09/06/2040	2.769.178	0,18
	Akelius Residential Property Financing BV	EUR	1,000 %	17/01/2028	2.439.896	0,16
	AT Securities BV <sup>(c)</sup>	USD	5,250 %	Perp.	2.073.300	0,14
	BAT Netherlands Finance BV	EUR	3,125 %	07/04/2028	4.314.365	0,28
1.800.000	Cooperatieve Rabobank UA(c)	EUR	3,250 %	Perp.	2.069.083	0,14
6.625.000	Heimstaden Bostad Treasury BV	EUR	1,625 %	13/10/2031	7.593.290	0,50
	Iberdrola International BV – Serie NC6 <sup>(c)</sup>	EUR	1,450 %	Perp.	3.748.073	0,25
	ING Groep NV	GBP	3,000 %	18/02/2026	7.234.614	0,48
	ING Groep NV <sup>(c)</sup>	EUR	2,125 %	26/05/2031	1.549.601	0,10
	ING Groep NV <sup>(c)</sup>	EUR	1,099 %	16/11/2032	3.608.425	0,24
	ING Groep NV <sup>(c)</sup>	USD	6,750 %	Perp.	2.208.875	0,15
	JAB Holdings BV	EUR USD	3,375 %	17/04/2035	2.752.187	0,18
	Lukoil International Finance BV Lukoil International Finance BV	USD	4,563 % 4,750 %	24/04/2023 02/11/2026	1.370.325 1.400.592	0,09 0,09
	Prosus NV	lien	3 680 %			
750.000	Prosus NV Prosus NV	USD USD	3,680 % 4.027 %	21/01/2030 03/08/2050	765.347 486.200	0,05 0.03
750.000 520.000	Prosus NV Prosus NV Prosus NV	USD USD USD	3,680 % 4,027 % 3,832 %	03/08/2050 08/02/2051	486.200 180.656	0,05 0,03 0,01

					Valor de mercado en	% de
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	USD	patrimoni
Bonos – (con	tinuación)					
•	· (continuación)					
2.500.000	Upjohn Finance BV	EUR	1,908 %	23/06/2032	2.994.681	0,20
1.400.000	Volkswagen Financial Services NV	GBP	4,250 %	09/10/2025	2.057.326	0,14
4.700.000	Volkswagen International Finance NV <sup>(c)</sup>	EUR	3,500 %	Perp.	5.699.094	0,3
2.300.000	Volkswagen International Finance NV <sup>(c)</sup>	EUR	4,625 %	Perp.	2.963.738	0,19
1.500.000	Wintershall Dea Finance BV	EUR	1,332 %	25/09/2028	1.750.691	0,1
1.800.000	WPC Eurobond BV	EUR	1,350 %	15/04/2028	2.090.282	0,14
1.000.000	WPC Eurobond BV	EUR	0,950 %	01/06/2030	1.112.101	0,0
					79.255.728	5,2
Panamá						
	Bonos internacionales del Estado de Panamá	USD	3,870 %	23/07/2060	193.180	0,0
Perú 20.000	Bonos internacionales del Estado de Perú	USD	2,780 %	01/12/2060	16.904	0,0
	Bonos internacionales del Estado de Perú	USD	3,230 %	28/07/2121	560.288	0,04
000.000	25.150 11.1611.1615 451 251.165 45 1 5.16		0,200 70	20,01,2121	577.192	0,04
Polonia					377.132	0,0
	mBank S.A.(c)	EUR	0,966 %	21/09/2027	3.600.159	0,24
Catar						
700.000	Qatar Energy	USD	2,250 %	12/07/2031	691.250	0,0
2.350.000	Qatar Energy	USD	3,125 %	12/07/2041	2.360.575	0,1
2.200.000	Qatar Energy	USD	3,300 %	12/07/2051	2.259.125	0,1
300.000	Bonos internacionales del Estado de Catar	USD	3,875 %	23/04/2023	312.900	0,02
670.000	Bonos internacionales del Estado de Catar	USD	5,103 %	23/04/2048	894.869	0,00
					6.518.719	0,43
Rumanía						
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,875 %	11/03/2029	204.799	0,0
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	3,624 %	26/05/2030	2.098.282	0,14
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	USD	3,000 %	14/02/2031	404.875	0,03
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,000 %	28/01/2032	126.813	0,0
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	3,375 %	28/01/2050	437.653	0,03
1.490.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	USD .	4,000 %	14/02/2051	1.453.681	0,09
					4.726.103	0,3
Arabia Saudí 1.360.000	Bonos internacionales del Estado saudí	USD	3,250 %	17/11/2051	1.325.320	0,0
España			.,			
•	Banco Santander S.A.	USD	2.746 %	28/05/2025	1.661.120	0,1
3.800.000	Banco Santander S.A.	GBP	1,500 %	14/04/2026	5.037.317	0,33
	Banco Santander S.A.	USD	2,749 %	03/12/2030	5.288.598	0,3
3.700.000	Banco Santander S.A.(c)	GBP	2,250 %	04/10/2032	4.872.775	0,3
	CaixaBank S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	0,375 %	18/11/2026	6.108.510	0,40
2.900.000	CaixaBank S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	0,750 %	26/05/2028	3.292.936	0,2
	Cellnex Finance Co., S.A.	EUR	1,500 %	08/06/2028	4.592.294	0,30
	Cellnex Finance Co., S.A.	EUR	1,250 %	15/01/2029	2.075.699	0,14
	Cellnex Finance Co., S.A.	EUR	2,000 %	15/02/2033	2.174.353	0,14
	Cellnex Finance Co., S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,875 %	07/07/2041	432.562	0,0
	Iberdrola Finanzas S.A. (c)	EUR	1,575 %	Perp.	3.967.543	0,26
	Telefonica Emisiones S.A.	USD	5,520 %	01/03/2049	3.756.389	0,2
		•			43.260.096	2,8
Supranacional	es					
	African Export-Import Bank	USD	2,634 %	17/05/2026	892.723	0,06
	African Export-Import Bank	USD	3,798 %	17/05/2031	1.168.619	0,08
200.000	African Export-Import Bank 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,634 %	17/05/2026	200.612	0,0
					2.261.954	0,1
Suecia	Scania CV AB	EUD	0.500.0/	06/10/2023	1 407 040	0.00
	Scania CV AB	EUR	0,500 %	00/10/2023	1.407.848	0,0
Suiza 1.950.000	Crédit Suisse Group AG <sup>(c)</sup>	EUR	1,250 %	17/07/2025	2.267.911	0,1
	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					
	Crédit Suisse Group AG <sup>(c)</sup>	GRP	2 125 %	12/09/2025	2.160.562	() 14
1.600.000	Crédit Suisse Group AG <sup>(c)</sup> Crédit Suisse Group AG <sup>(c)</sup>	GBP EUR	2,125 % 3,250 %	12/09/2025 02/04/2026	2.160.562 2.357.591	0,14 0,10

Tenencias   Descripción del valor					Valor de mercado	% d
Tailandia   370.000   Thaioil Treasury Cerest	alor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	en USD	patrimon
Tailandia   370.000   Thaioil Treasury Cereminatos Árabes Unidos   4.210.000   Abu Dhabi Crude Oi 400.000   DP World Plc. 100.000   DP World Plc. 144A   DP World Plc. 100.000   DP World Plc. 144A   DP World Plc. 1550.000   Barclays Plc. (e)						
Tailandia						
Tailandia   370.000   Thaioil Treasury Ceremiratos Árabes Unidos   4.210.000   Abu Dhabi Crude Oi	oup AG 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	2,593 %	11/09/2025	2.923.958	0,1
## STATES   Color	44A <sup>(c)(d)</sup>	USD	7,000 %	Perp.	2.418.750	0,1
### STATES   Color		•			17.113.287	1,1
## STATES   Color						*
Reino Unido	Center Co., Ltd.	USD	4,625 %	20/11/2028	408.120	0,0
4.210.000 Abu Dhabi Crude Oi 400.000 DP World Plc. 100.000 DP World Plc. 144A  Reino Unido 2.843.000 Annington Funding I 2.250.000 Barclays Plc. 2.950.000 Barclays Plc. 2.950.000 Barclays Plc. 2.950.000 Barclays Plc. 3.850.000 Barclays Plc. 6.525.000 Barclays Plc. 6.525.000 Barclays Plc. 6.525.000 Barclays Plc. 6.525.000 Braclays Plc. 6.525.000 HSBC Holdings Plc. 6.505.000 Nationwide Building 6.505.000 Nationwide Building 6.505.000 NatWest Group Plc. 6.505.000 Pension Insurance 6.605.000 Standard Chartered 6.705.000 Standard Chartered 6.705.000 Standard Chartered 6.705.000 Traceo Corporate Tre 6.705.000 Traceo Corporate Tre 7	56.1.6. 66., 2.u.		1,020 70	2071112020	100.120	
## A00.000 DP World Plc. 144A ## A00.000 DP World Plc. (6) ## A00.000 DP DP Co. (7) ## A00.000 DP DP Co. (8) ## A00.000 DP DP Co. (9) ## A00.000 DP DP Co. (9) ## A00.000 DP DP Co. (9) ## A00.000 DP Co. (10) ##	Oil Pineline I I C	USD	4,600 %	02/11/2047	4.925.700	0,3
Reino Unido	Oil Fipeline LLC	USD	5,625 %	25/09/2048	489.500	0,0
2.843.000 Annington Funding I 2.250.000 Barclays Plc. (c) 1.200.000 Barclays Plc. (c) 1.200.000 Barclays Plc. (c) 1.200.000 Barclays Plc. (c) 5.175.000 Barclays Plc. (c) 6.525.000 Barclays Plc. (c) 6.525.000 Barclays Plc. (c) 1.600.000 BAT International Fil 2.550.000 BP Capital Markets 1.400.000 BP Capital Markets 1.400.000 BP Capital Markets 1.450.000 Gazprom PJSC Via 6.650.000 HSBC Holdings Plc. 6.175.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 2.500.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 3.575.000 InterContinental Hot 800.000 Just Group Plc. (c) 1.325.000 M&G Plc. (c) 1.325.000 M&G Plc. (c) 1.325.000 Nationwide Building 1.050.000 Nationwide Building 1.050.000 Natiwest Group Plc. 2.569.000 Pension Insurance (c) 850.000 Pension Insurance (c) 850.000 Pension Insurance (c) 775.000 Finewood Finance (c) 775.000 Standard Chartered 2.400.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 2.025.000 Times Water Utiliti 2.975.000 Times Water Utiliti 2.975.000 Times Water Utiliti 2.975.000 Times Water Utiliti 2.975.000 Virgin Money UK Plc. 800.000 Vodafone Group Plc. 2.150.000 Western Power Dist	4A <sup>(d)</sup>	USD	6,850 %	02/07/2037	131.625	0,0
2.843.000 Annington Funding I 2.250.000 Barclays Plc. (c) 1.200.000 Barclays Plc. (c) 1.200.000 Barclays Plc. (c) 1.200.000 Barclays Plc. (c) 5.175.000 Barclays Plc. (c) 6.525.000 Barclays Plc. (c) 6.525.000 Barclays Plc. (c) 1.600.000 BAT International Fil 2.550.000 BP Capital Markets 1.400.000 BP Capital Markets 1.400.000 BP Capital Markets 1.450.000 Gazprom PJSC Via 6.650.000 HSBC Holdings Plc. 6.175.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 2.500.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 3.575.000 InterContinental Hot 800.000 Just Group Plc. (c) 1.325.000 M&G Plc. (c) 1.325.000 M&G Plc. (c) 1.325.000 Nationwide Building 1.050.000 Nationwide Building 1.050.000 Natiwest Group Plc. 2.569.000 Pension Insurance (c) 850.000 Pension Insurance (c) 850.000 Pension Insurance (c) 775.000 Finewood Finance (c) 775.000 Standard Chartered 2.400.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 2.025.000 Times Water Utiliti 2.975.000 Times Water Utiliti 2.975.000 Times Water Utiliti 2.975.000 Times Water Utiliti 2.975.000 Virgin Money UK Plc. 800.000 Vodafone Group Plc. 2.150.000 Western Power Dist					5.546.825	0,3
2.843.000 Annington Funding I 2.250.000 Barclays Plc. (c) 1.200.000 Barclays Plc. (c) 1.200.000 Barclays Plc. (c) 1.200.000 Barclays Plc. (c) 5.175.000 Barclays Plc. (c) 6.525.000 Barclays Plc. (c) 6.525.000 Barclays Plc. (c) 1.600.000 BAT International Fil 2.550.000 BP Capital Markets 1.400.000 BP Capital Markets 1.400.000 BP Capital Markets 1.450.000 Gazprom PJSC Via 6.650.000 HSBC Holdings Plc. 6.175.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 2.500.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 3.575.000 InterContinental Hot 800.000 Just Group Plc. (c) 1.325.000 M&G Plc. (c) 1.325.000 M&G Plc. (c) 1.325.000 Nationwide Building 1.050.000 Nationwide Building 1.050.000 Natiwest Group Plc. 2.569.000 Pension Insurance (c) 850.000 Pension Insurance (c) 850.000 Pension Insurance (c) 775.000 Finewood Finance (c) 775.000 Standard Chartered 2.400.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 2.025.000 Times Water Utiliti 2.975.000 Times Water Utiliti 2.975.000 Times Water Utiliti 2.975.000 Times Water Utiliti 2.975.000 Virgin Money UK Plc. 800.000 Vodafone Group Plc. 2.150.000 Western Power Dist					3.340.023	0,0
2.250.000 Annington Funding I 3.250.000 Barclays Plc. (c) 1.200.000 Barclays Plc. (c) 1.200.000 Barclays Plc. (c) 3.850.000 Barclays Plc. (c) 3.850.000 Barclays Plc. (c) 3.850.000 Barclays Plc. (c) 1.600.000 BAT International Fit 2.550.000 BP Capital Markets 1.400.000 BP Capital Markets 1.275.000 Direct Line Insurance 1.450.000 Gazprom PJSC Via 6.650.000 HSBC Holdings Plc. 6.175.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 2.500.000 HSBC Holdings Plc. 2.500.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 3.575.000 InterContinental Hot 800.000 Just Group Plc. (c) 1.350.000 M&G Plc. (c) 1.325.000 M&G Plc. (c) 1.325.000 Nationwide Building 1.050.000 Nationwide Building 1.050.000 Natiwest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 1.750.000 Pension Insurance (c) 850.000 Royalty Pharma Plc 1.000.000 Santander UK Group 1.925.000 Standard Chartered 2.400.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utiliti 2.050.000 Thames Water Utiliti 2.050.000 Vodafone Group Plc. 2.150.000 Western Power Dist	- Dia	OPP	0.040.0/	40/07/0005	0.050.055	0.0
3.250.000 Barclays Plc. (c) 1.200.000 Barclays Plc. (c) 1.200.000 Barclays Plc. (c) 5.175.000 Barclays Plc. (c) 6.525.000 Barclays Plc. (c) 6.525.000 Barclays Plc. (c) 6.525.000 Barclays Plc. (c) 6.525.000 BAT International File 2.550.000 BP Capital Markets 1.275.000 BP Capital Markets 1.275.000 Direct Line Insurance (approximately plc. (c) 6.650.000 HSBC Holdings Plc. (c) 6.175.000 HSBC Holdings Plc. (c) 6.175.000 HSBC Holdings Plc. (c) 7.500.000 HSBC Holdings Plc. (d) 7.500.000 HSBC Holdings Plc. (e) 7.500.000 HSBC Holdi	~	GBP GBP	2,646 % 3,184 %	12/07/2025 12/07/2029	3.952.955 3.233.283	0,2 0,2
2.950.000 Barclays Plc. (c) 1.200.000 Barclays Plc. (c) 5.175.000 Barclays Plc. (c) 3.850.000 Barclays Plc. (c) 1.600.000 Barclays Plc. (c) 1.600.000 BAT International Fit 2.550.000 BP Capital Markets 1.400.000 BP Capital Markets 1.275.000 Direct Line Insuranc 1.450.000 Gazprom PJSC Via 6.650.000 HSBC Holdings Plc. 5.825.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.575.000 HSBC Holdings Plc. 1.575.000 HSBC Holdings Plc. 1.500.000 Natforup Plc. 1.500.000 Natforup Plc. 1.500.000 HSBC Holdings Plc.	g Fic.	USD	3,650 %	16/03/2025	3.458.390	0,2
1.200.000 Barclays Plc. (c) 5.175.000 Barclays Plc. (c) 6.525.000 Barclays Plc. (c) 6.525.000 Barclays Plc. (c) 6.525.000 Barclays Plc. (c) 6.525.000 BAT International Fil 2.550.000 BP Capital Markets 1.275.000 Direct Line Insurance 1.450.000 Gazprom PJSC Via 6.650.000 HSBC Holdings Plc. 6.175.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 3.575.000 InterContinental Hot 800.000 Just Group Plc. (c) 1.150.000 Legal & General Gro 1.850.000 Lloyds Banking Gro 700.000 M&G Plc. (c) 3.150.000 Nationwide Building 3.550.000 Nationwide Building 3.550.000 Natwest Group Plc. 4.150.000 NatWest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 2.325.000 Pension Insurance (c) 850.000 Pension Insurance (c) 775.000 Pinewood Finance (c) 775.000 Standard Chartered 2.425.000 Standard Chartered 2.400.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 2.025.000 Tesco Corporate Tre 2.025.000 Trames Water Utilitit 2.975.000 Trigan Money UK Plc. 800.000 Vodafone Group Plc. 2.000 Vodafone Group Plc. 2.000 Vodafone Group Plc. 2.150.000 Western Power Dist		EUR	3,375 %	02/04/2025	3.602.635	0,2
3.850.000 Barclays Plc. (c) 6.525.000 Barclays Plc. (c) 1.600.000 BAT International Fit 2.550.000 BP Capital Markets 1.275.000 Direct Line Insurance 1.450.000 Gazprom PJSC Via 6.650.000 HSBC Holdings Plc. 6.175.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC		GBP	1,700 %	03/11/2026	1.603.348	0,
6.525.000 Barclays Plc. (c) 1.600.000 BAT International Fi 2.550.000 BP Capital Markets 1.400.000 BP Capital Markets 1.275.000 Direct Line Insuranc 1.450.000 Gazprom PJSC Via 6.650.000 HSBC Holdings Plc. 6.175.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.575.000 InterContinental Hot 800.000 Just Group Plc. (c) 1.150.000 Legal & General Group Plc. 1.325.000 M&G Plc. (c) 1.325.000 M&G Plc. (c) 1.325.000 Nationwide Building 1.050.000 NatWest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 2.325.000 Pension Insurance (c) 1.550.000 Pension Insurance (c) 1.550.000 Phoenix Group Hold 1.950.000 Santander UK Group 1.425.000 Standard Chartered 1.275.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utilitit 1.975.000 Times Water Utilitit 1.975.000 Virgin Money UK Plc. 1.900.000 Vodafone Group Plc. 1.9000.000 Vodafone Group Plc. 1.90000 Vodafone Group Plc. 1.900000 Vodafone Group Plc. 1.9000000 Vodafone Group Plc. 1.9000000 Vodafone Group Plc. 1.9000000 Vodafone Group Plc. 1.900000000 Vodafone Group Plc. 1.900000000000000000000000000000000000		USD	2,279 %	24/11/2027	5.194.717	0,3
1.600.000 BAT International Fit 2.550.000 BP Capital Markets 1.275.000 BP Capital Markets 1.275.000 Direct Line Insurance 1.450.000 Gazprom PJSC Via 6.650.000 HSBC Holdings Plc. 5.825.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.500.000 HS		EUR	0,577 %	09/08/2029	4.284.305	0,2
2.550.000 BP Capital Markets 1.400.000 BP Capital Markets 1.275.000 Direct Line Insurance 1.450.000 Gazprom PJSC Via 6.650.000 HSBC Holdings Plc. 6.175.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.150.000 Legal & General Gro 1.850.000 HSBC Holdings Plc. 1.850.000 M&G Plc.(©) 1.325.000 M&G Plc.(©) 1.325.000 Nationwide Building 1.050.000 Nationwide Building 1.050.000 Natiwest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 1.700.000 Pension Insurance (Pension I	Finance Die	GBP	3,750 %	22/11/2030	9.205.753	0,0
1.400.000 BP Capital Markets 1.275.000 Direct Line Insurance 1.450.000 Gazprom PJSC Via 6.650.000 HSBC Holdings Plc. 5.825.000 HSBC Holdings Plc. 2.500.000 HSBC Holdings Plc. 2.500.000 HSBC Holdings Plc. 1.500.000 Nationwide Building 1.050.000 Nationwide Building 1.050.000 Nationwide Building 1.050.000 NatWest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 1.500.000 Pension Insurance 0 1.550.000 Pension Insurance 0 1.550.000 Pension Insurance 0 1.550.000 Phoenix Group Hold 1.000.000 Royalty Pharma Plc 1.000.000 Santander UK Grou 1.925.000 Standard Chartered 1.925.000 Standard Chartered 1.925.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utiliti 1.050.000 Vodafone Group Plc 1.000.000 Vodafone Group Plc		GBP EUR	2,250 % 3,250 %	26/06/2028 Perp.	2.113.943 3.064.933	0, <sup>2</sup>
1.275.000 Direct Line Insurance 1.450.000 Gazprom PJSC Via 6.650.000 HSBC Holdings Plc. 5.825.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 MSG Plc.(©) 1.325.000 Nationwide Building 1.9500.000 Natiwest Group Plc. 1.900.000 NatWest Group Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 Natwest Group Plc. 1.900.000 Pension Insurance (0) 1.900.000 Pension Insurance (0) 1.900.000 Royalty Pharma Plc 1.900.000 Royalty Pharma Plc 1.900.000 Santander UK Group 1.925.000 Standard Chartered 1.925.000 Standard Chartered 1.925.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utiliti 1.900.000 Vodafone Group Plc.		EUR	3,625 %	Perp.	1.710.155	0,2
1.450.000 Gazprom PJSC Via 6.650.000 HSBC Holdings Plc. 5.825.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC HOLDING HSBC HOLDING HSBC HSBC HSBC HSBC HSBC HSBC HSBC HSBC		GBP	4,000 %	05/06/2032	1.870.655	0,
6.175.000 HSBC Holdings Plc. 5.825.000 HSBC Holdings Plc. 2.500.000 HSBC Holdings Plc. 1.500.000 Lloyds Banking Grover Plc. 1.500.000 M&G Plc. (©) 1.325.000 M&G Plc. (©) 1.325.000 Nationwide Building 1.050.000 Nationwide Building 1.050.000 Natiwest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 1.700.000 Pension Insurance (Pension Insuran		USD	3,250 %	25/02/2030	1.402.926	0,0
5.825.000 HSBC Holdings Plc. 2.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 1.850.000 Legal & General Grd 1.850.000 Lloyds Banking Grod 700.000 M&G Plc. (c) 1.325.000 Nationwide Building 1.050.000 Natiwest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 1.700.000 Pension Insurance (d) 1.550.000 Pension Insurance (d) 1.550.000 Pinewood Finance (d) 700.000 Royalty Pharma Plc 1.000.000 Royalty Pharma Plc 1.000.000 Santander UK Group 1.950.000 Standard Chartered 1.950.000 Standard Chartered 1.950.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utiliti 1.975.000 Tinames Water Utiliti 1.975.000 Virgin Money UK Plc. 1.900.000 Vodafone Group Plc	Plc. <sup>(c)</sup>	USD	3,803 %	11/03/2025	7.019.075	0,4
2.900.000 HSBC Holdings Plc. 2.500.000 HSBC Holdings Plc. 3.575.000 InterContinental Hot 800.000 Just Group Plc. (c) 1.150.000 Legal & General Gro 1.850.000 Lloyds Banking Gror 700.000 M&G Plc. (c) 3.255.000 Nationwide Building 1.050.000 Nationwide Building 1.050.000 Nationwide Building 1.050.000 NatWest Group Plc. 4.150.000 NatWest Group Plc. 2.3400.000 NatWest Group Plc. 2.569.000 Pension Insurance (c) 850.000 Pension Insurance (c) 700.000 Royalty Pharma Plc 1.000.000 Royalty Pharma Plc 1.000.000 Santander UK Group 2.425.000 Standard Chartered 6.275.000 Standard Chartered 6.275.000 Tesco Corporate Tre 2.025.000 Tesco Corporate Tre 2.025.000 Thames Water Utiliti 2.975.000 Virgin Money UK Plc. 800.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Vedafone Group Plc 2.150.000 Vedefone Group Plc 2.150.000 Vedefone Group Plc 2.150.000 Vedefone Group Plc 2.150.000 Vedefone Group Plc		USD	1,645 %	18/04/2026	6.160.303	0,4
2.500.000 HSBC Holdings Plc. 1.900.000 HSBC Holdings Plc. 3.575.000 InterContinental Hot 800.000 Just Group Plc.(c) 1.150.000 Legal & General Grd 1.850.000 Lloyds Banking Gro 700.000 M&G Plc.(c) 3.150.000 Nationwide Building 3.550.000 Nationwide Building 3.550.000 Nationwide Building 3.550.000 NatWest Group Plc. 3.400.000 NatWest Group Plc. 2.569.000 Pension Insurance (c) 850.000 Pension Insurance (c) 775.000 Pinewood Finance (c) 775.000 Royalty Pharma Plc 1.000.000 Royalty Pharma Plc 1.000.000 Santander UK Grou 2.425.000 Standard Chartered 6.275.000 Standard Chartered 6.275.000 Standard Chartered 6.275.000 Tesco Corporate Tre 2.025.000 Tesco Corporate Tre 2.025.000 Tesco Corporate Tre 2.025.000 Thames Water Utiliti 2.050.000 Thames Water Utiliti 2.975.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Western Power Dist		USD	4,375 %	23/11/2026	6.382.802	0,4
1.900.000 HSBC Holdings Plc. 3.575.000 InterContinental Hot 800.000 Just Group Plc.(c) 1.150.000 Legal & General Gro 700.000 M&G Plc.(c) 1.325.000 M&G Plc.(c) 1.325.000 Nationwide Building 1.050.000 Nationwide Building 3.550.000 NatWest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 2.325.000 Pension Insurance (2.325.000 Pension Insurance (3.325.000 Pension Insurance (		GBP USD	1,750 %	24/07/2027	3.840.278 2.808.725	0,2
3.575.000 InterContinental Hot 800.000 Just Group Plc. (©) 1.150.000 Legal & General Group 1.650.000 M&G Plc. (©) 1.325.000 M&G Plc. (©) 1.325.000 M&G Plc. (©) 1.325.000 Nationwide Building 1.550.000 Natiwest Group Plc. (1.50.000 Natiwest Group Plc. (1.50.000 Natwest Group Plc. (1.50.000 Natwest Group Plc. (1.50.000 Natwest Group Plc. (1.50.000 Pension Insurance (		USD	4,583 % 6,375 %	19/06/2029 Perp.	2.038.719	0, <sup>2</sup>
800.000 Just Group Plc. (c)  1.150.000 Legal & General Gro 1.850.000 M&G Plc. (c)  3.25.000 M&G Plc. (c)  3.150.000 Nationwide Building 1.050.000 Nationwide Building 3.550.000 NatWest Group Plc. 4.150.000 NatWest Group Plc. 3.400.000 NatWest Group Plc. 2.569.000 Pension Insurance (c) 850.000 Pension Insurance (c) 750.000 Royalty Pharma Plc 1.000.000 Royalty Pharma Plc 1.000.000 Santander UK Group 3.850.000 Santander UK Group 3.850.000 Santander UK Group 3.850.000 Standard Chartered 6.275.000 Standard Chartered 6.275.000 Tesco Corporate Tre 2.025.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utiliti 2.975.000 Virgin Money UK Plc 800.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Western Power Dist		EUR	1,625 %	08/10/2024	4.212.101	0,2
1.850.000 Lloyds Banking Groi 700.000 M&G Plc. (c) 1.325.000 M&G Plc. (c) 3.150.000 Nationwide Building 3.550.000 Natiwest Group Plc. 4.150.000 NatWest Group Plc. 2.569.000 Pension Insurance 0.850.000 Pension Insurance 0.1550.000 Phoenix Group Hoc. 2.325.000 Phoenix Group Hoc. 2.325.000 Phoenix Group Hoc. 2.325.000 Phoenix Group Hodio Phoenix Group Plc 2.275.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utiliti 2.975.000 Tritax EuroBox Plc. 2.275.000 Vigrin Money UK Plc. 800.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Western Power Dist		GBP	5,000 %	Perp.	1.037.103	0,0
700.000 M&G PIc. (c)  1.325.000 M&G PIc. (c)  3.150.000 Nationwide Building 1.050.000 NatWest Group PIc. 4.150.000 NatWest Group PIc. 1.700.000 NatWest Group PIc. 2.569.000 Pension Insurance (c) 850.000 Pension Insurance (c) 850.000 Pension Insurance (c) 775.000 Pinewood Finance (c) 775.000 Royalty Pharma PIc 1.000.000 Royalty Pharma PIc 1.000.000 Royalty Pharma PIc 1.000.000 Santander UK Grou 2.425.000 Standard Chartered 2.400.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 2.025.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utiliti 2.975.000 Tridax EuroBox PIc. 2.275.000 Virgin Money UK PIc. 800.000 Vodafone Group PIc 2.150.000 Western Power Dist	Group Plc. <sup>(c)</sup>	GBP	3,750 %	26/11/2049	1.613.605	0,
1.325.000 M&G Plc. (c) 3.150.000 Nationwide Building 1.050.000 Nationwide Building 3.550.000 NatWest Group Plc. 4.150.000 NatWest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 2.569.000 Pension Insurance (c) 850.000 Pension Insurance (c) 775.000 Pinewood Finance (c) 700.000 Royalty Pharma Plc 1.000.000 Royalty Pharma Plc 3.950.000 Santander UK Group 2.425.000 Standard Chartered 2.400.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utiliti 2.050.000 Vigrin Money UK Plc. 800.000 Vodafone Group Plc 800.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Western Power Dist	roup Plc. <sup>(c)</sup>	USD	7,500 %	Perp.	2.085.875	0,
3.150.000 Nationwide Building 1.050.000 Nationwide Building 3.550.000 NatWest Group Plc. 4.150.000 NatWest Group Plc. 3.400.000 NatWest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 2.569.000 Pension Insurance ( 850.000 Pension Insurance ( 750.000 Phoenix Group Hold 775.000 Phoenix Group Hold 775.000 Royalty Pharma Plc 1.000.000 Santander UK Group 3.950.000 Santander UK Group 3.850.000 Standard Chartered 6.275.000 Standard Chartered 6.275.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 2.025.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utiliti 2.975.000 Tritax EuroBox Plc. 2.275.000 Virgin Money UK Plc 800.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Western Power Dist		GBP	3,875 %	20/07/2049	975.536	0,0
1.050.000 Nationwide Building 3.550.000 NatWest Group Plc. 4.150.000 NatWest Group Plc. 3.400.000 NatWest Group Plc. 2.569.000 Pension Insurance ( 850.000 Pension Insurance ( 705.000 Phoenix Group Hold 775.000 Phoenix Group Hold 775.000 Royalty Pharma Plc 1.000.000 Royalty Pharma Plc 3.950.000 Santander UK Group 2.425.000 Stagecoach Group 8 3.850.000 Standard Chartered 6.275.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 2.025.000 Tesco Corporate Tre 2.025.000 Thames Water Utiliti 2.975.000 Tritax EuroBox Plc. 2.755.000 Virgin Money UK Plc 800.000 Vodafone Group Plc 800.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Western Power Dist	na Casisty 111A(C)(d)	GBP	6,340 %	19/12/2063	2.275.418	0,
3.550.000 NatWest Group Plc. 3.400.000 NatWest Group Plc. 3.400.000 NatWest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 2.569.000 Pension Insurance ( 850.000 Pension Insurance ( 1.550.000 Pension Insurance ( 775.000 Pinewood Finance ( 700.000 Royalty Pharma Plc 1.000.000 Royalty Pharma Plc 3.950.000 Santander UK Grou 2.425.000 Standard Chartered 2.400.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 2.025.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utiliti 2.975.000 Tritax EuroBox Plc. 2.275.000 Virgin Money UK Plc 800.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Western Power Dist		USD USD	4,302 % 3,960 %	08/03/2029 18/07/2030	3.511.526 1.162.865	0,2
4.150.000 NatWest Group Plc. 3.400.000 NatWest Group Plc. 1.700.000 NatWest Group Plc. 2.569.000 Pension Insurance ( 850.000 Pension Insurance ( 850.000 Pension Insurance ( 775.000 Pinewood Finance ( 700.000 Royalty Pharma Plc 3.950.000 Santander UK Group 2.425.000 Standard Chartered 6.275.000 Standard Chartered 2.400.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utiliti 2.050.000 Thames Water Utiliti 2.975.000 Virgin Money UK Plc 800.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Western Power Dist		USD	1,642 %	14/06/2027	3.503.992	0,2
1.700.000 NatWest Group Plc. 2.569.000 Pension Insurance ( 850.000 Pension Insurance ( 850.000 Pension Insurance ( 1.550.000 Phoenix Group Hold 775.000 Royalty Pharma Plc 1.000.000 Santander UK Group 2.425.000 Standard Chartered 6.275.000 Standard Chartered 6.275.000 Tesco Corporate Tre 2.025.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utiliti 2.975.000 Tritax EuroBox Plc. 2.275.000 Virgin Money UK Plc 800.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Western Power Dist		USD	3,073 %	22/05/2028	4.338.244	0,2
2.569.000 Pension Insurance (2.325.000 Pension Insurance (3.550.000 Pension Insurance (3.550.000 Pinewood Finance (3.550.000 Pinewood	lc. <sup>(c)</sup>	GBP	2,105 %	28/11/2031	4.466.784	0,2
2.325.000 Pension Insurance ( 850.000 Pension Insurance ( 1.550.000 Phoenix Group Hold 775.000 Pinewood Finance ( 700.000 Royalty Pharma Plc 1.000.000 Royalty Pharma Plc 3.950.000 Santander UK Grou 2.425.000 Standard Chartered 6.275.000 Standard Chartered 2.400.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utiliti 2.050.000 Tritax EuroBox Plc. 2.275.000 Virgin Money UK Plc 800.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Western Power Dist	lc. <sup>(c)</sup>	EUR	1,043 %	14/09/2032	1.896.771	0,
850.000 Pension Insurance (1.550.000 Phoenix Group Hold 775.000 Pinewood Finance (1.000.000 Royalty Pharma Plc 1.000.000 Santander UK Group 1.925.000 Standard Chartered 2.400.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utiliti 2.975.000 Tritax EuroBox Plc. 2.275.000 Virgin Money UK Plc 800.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Western Power Dist	• •	GBP	6,500 %	03/07/2024	3.831.410	0,2
1.550.000 Phoenix Group Hold 775.000 Pinewood Finance (1) 700.000 Royalty Pharma Plc 1.000.000 Santander UK Group 1.3.950.000 Santander UK Group 1.3.850.000 Standard Chartered 6.275.000 Standard Chartered 2.400.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utilit 2.050.000 Tritax EuroBox Plc. 2.275.000 Virgin Money UK Plc 800.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Western Power Dist		GBP	4,625 %	07/05/2031	3.447.505	0,2
775.000 Pinewood Finance C 700.000 Royalty Pharma Plc 3.950.000 Santander UK Group 2.425.000 Standard Chartered 6.275.000 Standard Chartered 2.400.000 Tesco Corporate Tre 2.025.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utiliti 2.975.000 Virgin Money UK Plc 800.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Western Power Dist	• •	GBP GBP	7,375 % 5.625 %	Perp. 28/04/2031	1.345.204 2.456.332	0,0 0, <i>1</i>
700.000 Royalty Pharma Plc 1.000.000 Royalty Pharma Plc 3.950.000 Santander UK Grou 2.425.000 Stagecoach Group I 3.850.000 Standard Chartered 6.275.000 Standard Chartered 2.400.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utiliti 2.050.000 Tritax EuroBox Plc. 2.275.000 Virgin Money UK Plc 800.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Western Power Dist	S .	GBP	3,250 %	30/09/2025	1.042.091	0,
1.000.000 Royalfy Pharma Plc 3.950.000 Santander UK Grou, 2.425.000 Stagecoach Group I 3.850.000 Standard Chartered 6.275.000 Standard Chartered 2.400.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utiliti 2.050.000 Tritax EuroBox Plc. 2.275.000 Virgin Money UK Plc 800.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Western Power Dist		USD	1,200 %	02/09/2025	688.996	0,0
2.425.000 Stagecoach Group I 3.850.000 Standard Chartered 2.400.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 2.025.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utiliti 2.075.000 Tritax EuroBox Plc. 2.275.000 Virgin Money UK Plc 800.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Western Power Dist		USD	1,750 %	02/09/2027	980.960	0,0
3.850.000 Standard Chartered 6.275.000 Standard Chartered 2.400.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utiliti 2.050.000 Tritax EuroBox Plc. 2.775.000 Virgin Money UK Plc 800.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Western Power Dist	oup Holdings Plc. <sup>(c)</sup>	USD	1,532 %	21/08/2026	3.911.646	0,
6.275.000 Standard Chartered 2.400.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utilit 2.050.000 Thames Water Utilit 2.975.000 Tritax EuroBox Plc. 2.275.000 Virgin Money UK Plc 800.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Western Power Dist		GBP	4,000 %	29/09/2025	3.485.830	0,2
2.400.000 Swiss Re Finance U 1.925.000 Tesco Corporate Tre 2.025.000 Tesco Corporate Tre 1.850.000 Thames Water Utiliti 2.975.000 Tritax EuroBox Plc. 2.275.000 Virgin Money UK Plc 800.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Western Power Dist		EUR	1,200 %	23/09/2031	4.344.759	0,2
1.925.000 Tesco Corporate Tre     2.025.000 Tesco Corporate Tre     1.850.000 Thames Water Utiliti     2.975.000 Tritax EuroBox Plc.     2.275.000 Virgin Money UK Plt     800.000 Vodafone Group Plc     2.150.000 Western Power Dist		USD EUR	1,456 %	14/01/2027 04/06/2052	6.102.751 2.947.588	0, 0,
2.025.000 Tesco Corporate Tre     1.850.000 Thames Water Utilit     2.050.000 Thames Water Utilit     2.975.000 Tritax EuroBox Plc.     2.275.000 Virgin Money UK Plc     800.000 Vodafone Group Plc     2.150.000 Western Power Dist		GBP	2,714 % 1,875 %	02/11/2028	2.577.284	0,
1.850.000 Thames Water Utiliti     2.050.000 Thames Water Utiliti     2.975.000 Tritax EuroBox Plc.     2.275.000 Virgin Money UK Plc     800.000 Vodafone Group Plc     2.150.000 Western Power Dist		GBP	2,750 %	27/04/2030	2.845.947	0,
2.975.000 Tritax EuroBox Plc. 2.275.000 Virgin Money UK Plc 800.000 Vodafone Group Plc 2.150.000 Western Power Dist		GBP	2,375 %	03/05/2023	2.496.074	0,
2.275.000 Virgin Money UK Plo 800.000 Vodafone Group Plo 2.150.000 Western Power Dist		GBP	5,750 %	13/09/2030	2.829.787	0,
800.000 Vodafone Group Plo 2.150.000 Western Power Dist		EUR	0,950 %	02/06/2026	3.407.481	0,:
2.150.000 Western Power Dist		GBP	5,125 %	11/12/2030	3.301.820	0,:
		USD GBP	5,000 %	30/05/2038	1.001.552	0,
		GBP	3,625 % 1,500 %	06/11/2023 15/09/2029	3.005.797 2.500.351	0,2 0,1
· ·	,,	OBF .	1,000 /0	13/03/2029		
					162.578.885	10,6
Estados Unidos						

					Valor de mercado	
T	Description delicates	Distric	Ti (a)	Fhdiit(h)	en	% del
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	USD	patrimonio
Bonos – (con	tinuación) s – (continuación)					
	AbbVie, Inc.	USD	4,875 %	14/11/2048	227.423	0,01
	AbbVie, Inc.	USD	4,250 %	21/11/2049	5.102.532	0,34
	Agree LP	USD	2,900 %	01/10/2030	770.198	0,05
1.300.000	Air Lease Corp.	USD	3,000 %	15/09/2023	1.341.158	0,09
2.825.000	Air Lease Corp.	USD	2,875 %	15/01/2026	2.910.174	0,19
8.225.000	Air Lease Corp.	USD	3,750 %	01/06/2026	8.762.504	0,58
1.000.000	Alexandria Real Estate Equities, Inc.	USD	3,800 %	15/04/2026	1.092.380	0,07
1.000.000	American Homes 4 Rent LP	USD	4,900 %	15/02/2029	1.168.190	0,08
	American Homes 4 Rent LP	USD	2,375 %	15/07/2031	692.363	0,05
1.350.000	American International Group, Inc.	USD	4,200 %	01/04/2028	1.526.729	0,10
	American International Group, Inc.	USD	4,375 %	30/06/2050	2.766.544	0,18
	American Tower Corp.	USD	4,000 %	01/06/2025	1.993.468	0,13
	American Tower Corp.	USD	2,100 %	15/06/2030	2.454.783	0,16
	Amgen, Inc.	USD	4,400 %	01/05/2045	2.344.114	0,15
	Anheuser-Busch Cos., LLC Via Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	USD	4,900 %	01/02/2046	5.453.991	0,36
	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	USD	5,450 %	23/01/2039	3.011.022	0,20
	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	USD	4,600 %	15/04/2048	2.639.017	0,17
	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	USD	5,550 %	23/01/2049	3.803.965	0,25
	Arch Capital Finance LLC	USD	4,011 %	15/12/2026	3.439.698	0,23
5.375.000		USD	2,750 %	01/06/2031 01/02/2032	5.469.869	0,36
9.275.000		USD	2,250 %		8.951.673	0,59
1.225.000	•	USD	4,900 %	15/06/2042	1.504.925 624.223	0,10 0,04
	AT&T, Inc. AT&T, Inc.	USD	4,300 % 4,350 %	15/12/2042 15/06/2045	681.678	0,04
	AT&T, Inc.	USD	4,850 %	15/07/2045	977.768	0,04
	AT&T, Inc.	USD	4,750 %	15/05/2046	729.180	0,00
1.900.000		USD	5,450 %	01/03/2047	2.520.426	0,03
1.050.000		USD	4,500 %	09/03/2048	1.242.329	0,08
	AT&T, Inc.	USD	5,150 %	15/02/2050	514.552	0,03
3.075.000		USD	3,650 %	01/06/2051	3.204.365	0,21
	AutoNation, Inc.	USD	1,950 %	01/08/2028	269.808	0,02
	AutoNation, Inc.	USD	4,750 %	01/06/2030	5.924.211	0,39
	Bank of America Corp.(c)	USD	3,458 %	15/03/2025	2.467.241	0,16
	Bank of America Corp. (c)	USD	3,366 %	23/01/2026	5.873.121	0,39
	Bank of America Corp.(c)	USD	3,970 %	05/03/2029	2.475.675	0,16
	Bank of America Corp. (c)	EUR	3,648 %	31/03/2029	2.828.100	0,19
2.300.000	Bank of America Corp.	USD	5,875 %	07/02/2042	3.289.782	0,22
4.100.000	BAT Capital Corp.	USD	2,259 %	25/03/2028	4.017.508	0,26
3.398.000	Becton Dickinson and Co.	USD	3,363 %	06/06/2024	3.570.279	0,23
1.575.000	Becton Dickinson and Co.	USD	3,700 %	06/06/2027	1.712.450	0,11
499.000	Berkshire Hathaway Energy Co.	USD	6,125 %	01/04/2036	684.803	0,04
1.575.000	Boeing Co.	USD	4,875 %	01/05/2025	1.728.358	0,11
3.850.000	Boeing Co.	USD	2,700 %	01/02/2027	3.938.357	0,26
	Boeing Co.	USD	5,150 %	01/05/2030	5.146.806	0,34
	Boeing Co.	USD	3,250 %	01/02/2035	301.257	0,02
	Boeing Co.	USD	5,705 %	01/05/2040	768.030	0,05
	Boeing Co.	USD	3,625 %	01/03/2048	100.459	0,01
	Boeing Co.	USD	3,850 %	01/11/2048	99.285	0,01
	Boeing Co.	USD	5,805 %	01/05/2050	3.721.451	0,24
	Burlington Northern Santa Fe LLC	USD	5,750 %	01/05/2040	2.096.385	0,14
	Capital One Financial Corp.	EUR	0,800 %	12/06/2024	6.167.926	0,41
	Centene Corp.	USD	3,000 %	15/10/2030	1.148.908	0,08
4.900.000	Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications Operating Capital	USD	4,500 %	01/02/2024	5.229.329	0,34
6 125 000	Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications	USD	4,500 %	01/02/2024	5.229.529	0,34
0.125.000	Operating Capital	USD	4,908 %	23/07/2025	6.776.026	0,45
2 700 000	Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications	OOD	4,000 70	20/01/2020	0.770.020	0,40
2.700.000	Operating Capital	USD	4,800 %	01/03/2050	3.060.558	0,20
3.825.000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC	USD	3,700 %	15/11/2029	4.099.405	0,27
	Citigroup, Inc.	GBP	2,750 %	24/01/2024	1.310.476	0,09
	Citigroup, Inc.(c)	USD	0,776 %	30/10/2024	3.061.531	0,20
	Citigroup, Inc.	USD	3,200 %	21/10/2026	4.169.645	0,27
	Citigroup, Inc.	USD	4,450 %	29/09/2027	2.788.225	0,18
2.400.000	Citigroup, Inc.(c)	USD	3,668 %	24/07/2028	2.593.080	0,17
	Citigroup, Inc.(c)	USD	4,412 %	31/03/2031	10.689.948	0,70
3.400.000	Citrix Systems, Inc.	USD	3,300 %	01/03/2030	3.452.190	0,23
1.675.000	CMS Energy Corp.(c)	USD	3,750 %	01/12/2050	1.647.564	0,11
1.350.000	Constellation Brands, Inc.	USD	2,875 %	01/05/2030	1.388.516	0,09
1.175.000	CVS Health Corp.	USD	4,780 %	25/03/2038	1.435.180	0,09
	CVS Health Corp.	USD	5,050 %	25/03/2048	726.561	0,05
10.200.000	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	6,020 %	15/06/2026	11.944.914	0,79

					Valor de mercado	
Tenencias	Descripción del valor	Divies	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en USD	% del patrimonio
	<u> </u>	Divisa	ripo de interes.	recha de vencimiento.	035	patrinonio
Bonos – (conf Estados Unido	s – (continuación)					
	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	4,900 %	01/10/2026	538.470	0,04
4.325.000	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	5,300 %	01/10/2029	5.155.011	0,34
300.000	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	6,200 %	15/07/2030	381.762	0,02
	Dentsply Sirona, Inc.	USD	3,250 %	01/06/2030	2.303.455	0,15
	Devon Energy Corp.	USD	5,850 %	15/12/2025	230.194	0,02
	Devon Energy Corp.	USD	5,600 %	15/07/2041	820.567	0,05
	Devon Energy Corp.	USD USD	4,750 %	15/05/2042	459.784	0,03
	Devon Energy Corp. Diamondback Energy, Inc.	USD	5,000 % 4,750 %	15/06/2045 31/05/2025	546.300 384.664	0,04 0,03
	Diamondback Energy, Inc.	USD	3,500 %	01/12/2029	5.871.590	0,03
	DTE Energy Co. – Serie F	USD	1,050 %	01/06/2025	2.124.178	0,14
	Elanco Animal Health, Inc.	USD	5,272 %	28/08/2023	4.677.182	0,31
1.050.000	Energy Transfer LP	USD	4,950 %	15/06/2028	1.189.619	0,08
850.000	Energy Transfer LP	USD	5,300 %	01/04/2044	978.716	0,06
	Energy Transfer LP	USD	5,300 %	15/04/2047	173.940	0,01
	Energy Transfer LP	USD	5,400 %	01/10/2047	770.153	0,05
	Energy Transfer LP	USD	6,000 %	15/06/2048	438.585	0,03
	Energy Transfer LP	USD	5,000 %	15/05/2050	1.948.676	0,13
	Energy Transfer LP – Serie 5 a Expedia Group, Inc.	USD USD	4,200 %	15/09/2023	3.364.160 5.171.135	0,22 0,34
	Expedia Group, Inc.	USD	4,500 % 5,000 %	15/08/2024 15/02/2026	868.364	0,34
	FirstEnergy Corp.	USD	2,650 %	01/03/2030	1.378.831	0,00
	Ford Motor Credit Co., LLC	USD	4,375 %	06/08/2023	2.073.228	0,14
1.500.000	·	USD	4,709 %	25/01/2029	1.716.405	0,11
	GE Capital Funding LLC	USD	4,050 %	15/05/2027	5.233.803	0,34
1.975.000	General Electric Co.	USD	6,750 %	15/03/2032	2.745.645	0,18
1.950.000	General Motors Co.	USD	5,400 %	02/10/2023	2.103.797	0,14
	General Motors Co.	USD	4,200 %	01/10/2027	876.072	0,06
	General Motors Co.	USD	5,000 %	01/04/2035	3.578.580	0,24
	General Motors Co.	USD	6,600 %	01/04/2036	1.969.458	0,13
	General Motors Co.	USD	6,250 %	02/10/2043	682.920	0,04
	General Motors Financial Co., Inc.	USD USD	5,650 %	17/01/2029	774.638	0,05 0,27
	General Motors Financial Co., Inc. Halliburton Co.	USD	2,350 % 2,920 %	08/01/2031 01/03/2030	4.147.006 6.006.838	0,40
	Hewlett Packard Enterprise Co.	USD	4,900 %	15/10/2025	5.626.558	0,40
	Hewlett Packard Enterprise Co.	USD	6,350 %	15/10/2045	3.181.994	0,21
2.580.000	•	USD	3,050 %	12/08/2051	2.675.486	0,18
3.200.000	JPMorgan Chase & Co.	USD	3,625 %	01/12/2027	3.444.096	0,23
2.900.000	JPMorgan Chase & Co.(c)	USD	3,882 %	24/07/2038	3.321.196	0,22
	Keurig Dr Pepper, Inc.	USD	4,597 %	25/05/2028	2.689.575	0,18
	Keurig Dr Pepper, Inc.	USD	4,500 %	15/11/2045	121.768	0,01
	Keurig Dr Pepper, Inc.	USD	5,085 %	25/05/2048	363.264	0,02
	Kinder Morgan Energy Partners LP Kinder Morgan, Inc.	USD USD	6,550 %	15/09/2040 15/02/2031	821.754 4.480.817	0,05
	Lowe's Cos., Inc.	USD	2,000 % 1,700 %	15/02/2031	122.545	0,29 0,01
	Marathon Petroleum Corp.	USD	3,800 %	01/04/2028	3.736.177	0,25
	Marathon Petroleum Corp.	USD	4,750 %	15/09/2044	2.046.240	0,13
	Marriott International, Inc. – Serie EE	USD	5,750 %	01/05/2025	459.385	0,03
950.000	Micron Technology, Inc.	USD	3,366 %	01/11/2041	962.141	0,06
1.670.000	Moody's Corp.	USD	3,100 %	29/11/2061	1.686.349	0,11
	Morgan Stanley <sup>(c)</sup>	USD	4,431 %	23/01/2030	2.369.007	0,16
	Morgan Stanley <sup>(c)</sup>	USD	2,484 %	16/09/2036	6.753.390	0,44
7.325.000		USD	2,650 %	15/08/2030	7.262.371	0,48
2.975.000		USD	4,500 %	15/04/2038	3.330.899	0,22
	MPLX LP	USD GBP	5,500 %	15/02/2049 05/12/2023	507.860	0,03 0,18
	MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.  NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	USD	2,550 % 1,900 %	15/06/2028	2.720.876 2.626.574	0,16
	NiSource, Inc.	USD	3,600 %	01/05/2030	1.242.863	0,17
	NiSource, Inc.	USD	1,700 %	15/02/2031	3.626.661	0,24
	Occidental Petroleum Corp.	USD	5,550 %	15/03/2026	981.000	0,06
	Occidental Petroleum Corp.	USD	3,200 %	15/08/2026	693.770	0,05
650.000	Occidental Petroleum Corp.	USD	3,500 %	15/08/2029	641.875	0,04
	Occidental Petroleum Corp.	USD	6,450 %	15/09/2036	1.375.000	0,09
	ONE Gas, Inc.	USD	1,100 %	11/03/2024	7.129.295	0,47
	Oracle Corp.	USD	2,875 %	25/03/2031	6.330.919	0,42
	Oracle Corp.	USD	3,600 %	01/04/2040	1.092.126	0,07
	PACCAR Financial Corp.  Pacific Gas and Electric Co.	USD USD	0,900 %	08/11/2024	1.821.204	0,12
	Pacific Gas and Electric Co. Pacific Gas and Electric Co.	USD	3,000 % 2,500 %	15/06/2028 01/02/2031	3.569.241 1.344.294	0,23 0,09
	Pacific Gas and Electric Co.	USD	2,500 % 3,300 %	01/02/2031	523.980	0,09
	Pacific Gas and Electric Co.	USD	3,750 %	15/08/2042	598.188	0,03
			-, /0			-,-:

					Valor de mercado	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en USD	% del patrimonio
Bonos – (con	tinuación)					
	s – (continuación)					
	Pacific Gas and Electric Co.	USD	3,500 %	01/08/2050	1.097.020	0,07
	Pioneer Natural Resources Co.	USD	1,125 %	15/01/2026	878.949	0,06
	Progress Energy, Inc.	USD	7,750 %	01/03/2031	22.421	0,00
	Realty Income Corp. Realty Income Corp.	USD USD	4,600 % 4,625 %	06/02/2024 01/11/2025	427.572 3.513.352	0,03 0,23
	Realty Income Corp.	USD	3,400 %	15/01/2028	2.668.446	0,23
	Realty Income Corp.	USD	2,850 %	15/12/2032	966.634	0,06
	Reynolds American, Inc.	USD	4,450 %	12/06/2025	2.823.756	0,19
	Sabine Pass Liquefaction LLC	USD	5,750 %	15/05/2024	3.230.014	0,21
	Sabine Pass Liquefaction LLC	USD	5,625 %	01/03/2025	2.232.260	0,15
	Sabine Pass Liquefaction LLC	USD	4,500 %	15/05/2030	3.883.779	0,26
850.000	Sempra Energy	USD	4,000 %	01/02/2048	977.951	0,06
1.000.000	Skyworks Solutions, Inc.	USD	3,000 %	01/06/2031	1.020.040	0,07
200.000	Southern California Edison Co. – Serie E	USD	3,700 %	01/08/2025	214.732	0,01
2.400.000	Southern Co.	USD	3,250 %	01/07/2026	2.540.304	0,17
1.050.000	Spirit Realty LP	USD	3,200 %	15/01/2027	1.106.921	0,07
1.300.000	Spirit Realty LP	USD	2,100 %	15/03/2028	1.278.485	0,08
	Spirit Realty LP	USD	4,000 %	15/07/2029	1.490.211	0,10
	Sysco Corp.	USD	5,950 %	01/04/2030	2.586.485	0,17
	Sysco Corp.	USD	6,600 %	01/04/2050	1.818.507	0,12
	Teledyne Technologies, Inc.	USD	0,950 %	01/04/2024	7.026.523	0,46
	T-Mobile USA, Inc.	USD	3,500 %	15/04/2025	2.386.327	0,16
	T-Mobile USA, Inc.	USD	3,750 %	15/04/2027	9.685.820	0,64
	T-Mobile USA, Inc.	USD	3,875 %	15/04/2030	11.267.424	0,74
	T-Mobile USA, Inc.	USD	2,550 %	15/02/2031	1.830.853	0,12
	T-Mobile USA, Inc.	USD	3,000 %	15/02/2041	3.021.763	0,20
	Valero Energy Partners LP	USD	4,375 %	15/12/2026	444.480	0,03
	Verizon Communications, Inc. Verizon Communications, Inc.	USD USD	4,125 %	16/03/2027	8.650.937	0,57
	Verizon Communications, Inc. Verizon Communications, Inc.	USD	2,550 % 4,862 %	21/03/2031 21/08/2046	10.063.927 2.628.320	0,66 0,17
	Verizon Communications, Inc. Verizon Communications, Inc.	USD	4,000 %	22/03/2050	816.781	0,17
	Verizon Communications, Inc. Verizon Communications, Inc.	USD	2,987 %	30/10/2056	750.750	0,05
	VMware, Inc.	USD	1,800 %	15/08/2028	1.218.463	0,03
	VMware, Inc.	USD	2,200 %	15/08/2031	3.607.426	0,00
	Walgreens Boots Alliance, Inc.	USD	0,950 %	17/11/2023	3.571.890	0,23
	Wells Fargo & Co.	USD	3,000 %	23/10/2026	6.072.977	0,40
	Wells Fargo & Co. (c)	USD	2,572 %	11/02/2031	5.489.100	0,36
	Western Midstream Operating LP	USD	4,000 %	01/07/2022	1.856.938	0,12
	Western Midstream Operating LP	USD	4,350 %	01/02/2025	2.967.562	0,20
	Whirlpool Corp.	USD	4,600 %	15/05/2050	1.069.045	0,07
	Williams Cos., Inc.	USD	4,300 %	04/03/2024	1.381.952	0,09
3.700.000	Williams Cos., Inc.	USD	2,600 %	15/03/2031	3.677.356	0,24
2.150.000	WP Carey, Inc.	USD	3,850 %	15/07/2029	2.384.393	0,16
1.200.000	WP Carey, Inc.	USD	2,400 %	01/02/2031	1.190.652	0,08
		-			503.222.665	33,10
TOTAL DE BO						<u> </u>
(coste USD 1.1	16.574.440)				1.138.383.553	74,88
					Valor de mercado	% del
Tenencias	Descripción del valor				USD	patrimonio
	versión – 4,81 %					
73.108.999	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acci	ones de distribuci	ión X) <sup>(e)(f)</sup>		73.108.999	4,81
	NDOS DE INVERSIÓN		,			
(coste USD 73					73.108.999	4,81
TOTAL DE VAL (coste USD 1.1	ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLS. 89.683.439)	A DE VALORES (	OFICIAL		1.211.492.552	79,69
					Valor de	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	mercado USD	% del patrimonio
Valores mobi	liarios negociados en otro mercado regulado					
Bonos - 10,5	3 %					
Australia	Australia O Nava Zanland Bardina C		0.050.01	201707	0.000.000	0.40
	Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 144A <sup>(c)(d)</sup> Commonwealth Bank of Australia 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD USD	2,950 % 3,610 %	22/07/2030 12/09/2034	2.680.288 3.369.792	0,18 0,22
3.200.000	Commonwealth Dank of Additional 1777/11	OOD	3,010 /0	12/03/2034	0.000.792	0,22

					Valor de mercado	% de
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	USD	patrimonio
Bonos – (con	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					
Australia – (c	ontinuación) Macquarie Bank Ltd. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,052 %	03/03/2036	3.389.140	0,22
	Macquarie Group Ltd. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,052 % 1,340 %	12/01/2027	1.374.198	0,22
	Macquarie Group Ltd. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,763 %	28/11/2028	1.091.710	0,0
	Newcrest Finance Pty Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,250 %	13/05/2030	1.222.715	0,08
	·		<u> </u>		13.127.843	0,86
Bermudas	7					
	Bacardi Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,300 %	15/05/2048	2.435.868	0,16
2 850 000	Avolon Holdings Funding Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,950 %	01/07/2024	2.995.720	0,20
	Avolon Holdings Funding Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,250 %	15/04/2026	1.577.336	0,10
	Avolon Holdings Funding Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,250 %	15/02/2027	1.739.100	0,12
			-,		6.312.156	0,42
Francia					0.012.100	0,12
	BNP Paribas S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	2,219 %	09/06/2026	8.649.685	0,57
	BNP Paribas S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,323 %	13/01/2027	3.688.477	0,24
	BNP Paribas S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	4,375 %	01/03/2033	3.276.420	0,22
	BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,000 %	12/09/2023	4.107.285	0,27
	BPCE S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,652 %	06/10/2026	4.784.663	0,31
	Crédit Agricole S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,250 %	04/10/2024	3.802.968	0,25
	Crédit Agricole S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,907 %	16/06/2026	5.825.878	0,38
	Crédit Agricole S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,247 %	26/01/2027	6.050.890	0,40
	Electricité de France S.A. 144A(d)	USD	6,950 %	26/01/2039	2.380.624	0,16
4.050.000	Société Générale S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,488 %	14/12/2026	3.969.445 46.536.335	0,26 3,06
 Italia					+0.550.555	3,00
	UniCredit SpA 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,982 %	03/06/2027	1.745.198	0,12
Países Bajos						
	Enel Finance International NV 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,875 %	12/07/2041	3.497.040	0,23
	Lundin Energy Finance BV 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,000 %	15/07/2026	4.862.032	0,32
	Prosus NV 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,680 %	21/01/2030	367.367	0,03
	Syngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,441 %	24/04/2023	2.155.531	0,14
1.025.000	Syngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,892 %	24/04/2025	1.112.740	0,07
Supranacional	00				11.554.710	0,73
•	NXP BV Via NXP Funding LLC Via NXP USA, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,500 %	11/05/2031	5.421.708	0,36
1.580.000	NXP BV Via NXP Funding LLC Via NXP USA, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,250 %	30/11/2051	1.594.852	0,10
	<b>3</b>				7.016.560	0,46
Suiza						
4.250.000	Credit Suisse Group AG 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	4,194 %	01/04/2031	4.681.417	0,31
	Credit Suisse Group AG 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,091 %	14/05/2032	2.668.050	0,18
4.100.000	UBS Group AG 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,364 %	30/01/2027	4.026.405	0,26
					11.375.872	0,75
Estados Unido	os Aviation Capital Group LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,950 %	30/01/2026	3.603.974	0,24
	Bay Area Toll Authority	USD	6,263 %	01/04/2049	109.071	0,24
	Broadcom, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,419 %	15/04/2033	4.574.919	0,30
	Broadcom, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,469 %	15/04/2034	6.095.762	0,40
	Broadcom, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,137 %	15/11/2035	3.058.355	0,20
	CoStar Group, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,800 %	15/07/2030	4.075.240	0,27
675.000	Eastern Gas Transmission & Storage, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,600 %	15/12/2044	824.465	0,05
	Glencore Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,125 %	12/03/2024	4.025.378	0,26
	Glencore Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,625 %	29/04/2024	1.289.652	0,08
	Glencore Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,375 %	23/09/2051	1.544.880	0,10
	Hyundai Capital America 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,650 %	17/09/2026	8.786.305	0,58
	International Flavors & Fragrances, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,832 %	15/10/2027	3.777.914	0,2
	International Flavors & Fragrances, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,268 %	15/11/2040	566.715	0,04
	Los Angeles Unified School District	USD	6,758 %	01/07/2034	425.983	0,03
	Metropolitan Transportation Authority	USD	6,668 %	15/11/2039	789.369	0,05
	Metropolitan Transportation Authority	USD	7,336 %	15/11/2039	129.844	0,01
	NRG Energy, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,750 %	15/06/2024	1.153.889	0,07
	NRG Energy, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,450 %	15/06/2029	932.850	0,06 0,06
900.000	Penske Truck Leasing Co., LP Via PTL Finance Corp. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,400 %	15/11/2026	965.034	0,00

Tenencias	Descripción del valor	Divies	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado USD	% del
Bonos – (con		Divisa	Tipo de interes	recha de vencimiento.	035	patrinonic
•	es – (continuación)					
	Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue	USD	6,583 %	15/05/2049	395.943	0,03
875.000	State of California	USD	7,625 %	01/03/2040	1.468.947	0,10
250.000	State of Illinois	USD	6,725 %	01/04/2035	313.085	0,02
	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,711 %	29/01/2027	2.981.107	0,20
	Teachers Insurance & Annuity Association of America 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,900 %	15/09/2044	1.955.036	0,13
5.225.000	Vistra Operations Co., LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,300 %	15/07/2029	5.603.133	0,37
					59.446.850	3,91
TOTAL DE BOI (coste USD 154					159.991.392	10,53
Obligaciones	con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias	s – 3,04 %	0			
Islas Caimán						
	AIMCO CLO Serie 2017-AA "AR" 144A(c)(d)	USD	1,182 %	20/04/2034	6.299.635	0,41
	Bain Capital Credit CLO Ltd. 2019-1A "DR" 144A(c)(d)	USD	3,574 %	19/04/2034	2.007.228	0,13
	Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(c)(d)	USD	1,182 %	18/04/2034	3.594.038	0,24
	Battalion CLO XII Ltd. 2018-12A "A1" 144A(c)(d)	USD	1,228 %	17/05/2031	3.153.059	0,21
	Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	0,874 %	15/04/2029	8.805.866	0,58
	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 31 Ltd. 2019-31A "AR" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,172 %	20/04/2031	4.204.057	0,28
	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 31 Ltd. 2019-31A "DR" 144A(c)(d)	USD	3,382 %	20/04/2031	3.652.606	0,24
	OZLM XVI Ltd. 2017-16A "A1R" 144A(c)(d)	USD	1,185 %	16/05/2030	2.650.716	0,17
4.537.088	Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(c)(d)	USD	1,014 %	15/04/2029	4.539.570	0,30
					38.906.775	2,56
Estados Unido	os Alternative Loan Trust 2006-OA16 "A2"(c)	USD	0,472 %	25/10/2046	8.020	0,00
	Bayview Opportunity Master Fund IVb Trust 2017-SPL4 "A" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,500 %	28/01/2055	331.967	0,00
	Higher Education Funding I 2014-1 "A" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,230 %	25/05/2034	1.956.208	0,02
	SLM Student Loan Trust 2003-1 "A5A" 144A(c)(d)	USD	0.226 %	15/12/2032	1.941.800	0,13
	SLM Student Loan Trust 2007-2 "A4"(c)	USD	0,184 %	25/07/2022	2.473.563	0,16
	SLM Student Loan Trust 2008-4 "A4"(c)	USD	1,774 %	25/07/2022	612.061	0,04
					7.323.619	0,48
	LIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS NO EMITIDOS NI					
(coste USD 46.	OS POR AGENCIAS .200.489)				46.230.394	3,04
	ORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO					
REGULADO (coste USD 20)	0.619.171)				206.221.786	13,57
Otros valores i	mobiliarios					
Bonos - 0,31 %						
Estados Unido	Broadcom, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,187 %	15/11/2036	792.432	0,05
	Glencore Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,625 %	27/04/2026	1.453.273	0,03
	Glencore Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,850 %	27/04/2031	2.501.050	0,16
2.300.000	Clotical Citating ELO 144A	OOD	2,000 //	21704/2001	4.746.755	0,10
TOTAL DE BOI						
(coste USD 4.7	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·				4.746.755	0,31
TOTAL DE OTF (coste USD 4.7	ROS VALORES MOBILIARIOS (63.856)				4.746.755	0,31
Depósitos a p	olazo – 3,05 %					
Estados Unido	os					
	ING Bank NV USD Time Deposit	USD	0,030 %	01/12/2021	373.371	0,02
46.000.000	Rabobank Nederland USD Time Deposit	USD	0,020 %	01/12/2021	46.000.000	3,03
					46.373.371	3,05
	PÓSITOS A DI AZO					
TOTAL DE DEF					46 272 274	2.05
(coste USD 46.					46.373.371	3,05

Contratos de fu	turos - 0,27 %
-----------------	----------------

Número de contratos	Descripción del valor				Compromiso Valor de mercado en USD	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
	AUD						<u> </u>
3	Futuros sobre bonos del	Tesoro de Austral	a a 10 años 15/12/2021	Larga	299.374	2.621	0,00
	CAD						
390	Futuros sobre bonos del	Estado de Canad	á a 10 años 22/03/2022	Larga	43.262.070	816.830	0,06
EG	EUR	la Banública Eada	ral da Alamania a 10 años 09/12/2021	Lorgo	10 004 922	121.101	0,01
		ia Republica Fede	ral de Alemania a 10 años 08/12/2021	Larga	10.994.823	121.101	0,01
6	GBP Futuros sobre bonos del	Estado británico (	gilts) a largo plazo 29/03/2022	Larga	1.015.910	13.547	0,00
	USD		5 · · / · · · · 5 · / · · · · · · · · ·	- 3			-,
478	Futuros sobre pagarés de	el Tesoro de EE. U	JU. a 10 años 22/03/2022	Larga	62.647.875	958.519	0,06
	Futuros sobre pagarés de			Larga	56.727.070	191.730	0,01
716	Futuros sobre bonos del	Tesoro de EE. UU	. a muy largo plazo 22/03/2022	Larga	143.021.000	5.122.095	0,34
					262.395.945	6.272.344	0,41
PLUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRA	ATOS DE FUTUR	os			7.226.443	0,48
					Compromiso		
					Valor de mercado	Minusvalía	
Número de contratos	Descripción del valor				en USD	latente en USD	% del
	EUR						patimonio
(459)		la Renública Fede	ral de Alemania a 2 años 08/12/2021	Corta	(58.727.035)	(125.346)	(0,01)
		•	ral de Alemania a 5 años 08/12/2021	Corta	(1.234.705)	(4.642)	(0,00)
					(59.961.740)		
						(129.988)	(0,01)
	USD						
			. a largo plazo 22/03/2022	Corta	(3.563.313)	(85.250)	(0,00)
` ,	Futuros sobre pagarés de Futuros sobre pagarés de			Corta Corta	(6.946.312) (6.351.680)	(108.106) (22.440)	(0,01)
	Futuros sobre pagarés de			Corta	(68.027.680)	(663.183)	(0,00)
	Futuros sobre pagarés d			Corta	(13.021.398)	(134.939)	(0,01)
			. a muy largo plazo 22/03/2022	Corta	(11.785.250)	(407.008)	(0,03)
(521)	Futuros sobre pagarés d	el Tesoro de EE. U	JU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2	2022 Corta	(76.578.859)	(1.477.523)	(0,10)
(39)	Futuros sobre pagarés de	el Tesoro de EE. l	JU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2	2022 Corta	(5.732.391)	(110.602)	(0,01)
					(192.006.883)	(3.009.051)	(0,20)
MINUSVALÍA I	ATENTE SOBRE CONTR	RATOS DE FUTUR	ROS			(3.139.039)	(0,21)
	divisas a plazo – 0,19					<b>(</b> ,	(-, ,
Contratos de	uivisas a piazo – 0,13	/6				Plusvalía	
<b>.</b>		B			Fecha	latente	, % de
Divisa	Compra		Venta		de vencimiento	USD	patrimonio
USD	3.711.349		3.127.190		15/12/2021	151.490	0,01
GBP USD	16.845.404 175.756.235		22.520.890 127.609.594		21/01/2022 21/01/2022	3.163 5.128.965	0,00 0,34
EUR	117.474.240		132.611.383		10/02/2022	1.361.084	0,09
PLUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRA	ATOS DE DIVISAS	S A PLAZO			6.644.702	0,44
					Fecha	Minusvalía latente	% de
Divisa	Compra	Divisa	Venta		de vencimiento	USD	patrimonio
AUD	116.315	USD	86.138		31/01/2022	(2.783)	(0,00)
CAD	257.563		206.891		31/01/2022	(5.103)	(0,00)
USD	417.453.738	EUR	369.356.176		10/02/2022	(3.775.275)	(0,25)
MINUSVALÍA I	ATENTE SOBRE CONTR	RATOS DE DIVISA	AS A PLAZO			(3.783.161)	(0,25)
Contratos de	divisas a plazo especí	ficos de una cla	se de acciones - (0,31 %)				
					Fecha	Plusvalía latente	% de
Divisa	Compra	Divisa	Venta		de vencimiento	USD	patrimonio
USD	1.114.367	GBP	828.873		21/01/2022	6.077	0,00
					· · · · ·		-,

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones – (continuación)

Company	Divisa	Compra	Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
Dista								
Notes   Compra Divisa   Wenta   Went					ON FINES DE COBERTURA			
No.							Minusvalía	
Cap	Divisa	Compra	Divisa	Venta				
Chief	SEK	1.438.726.198	USD	167.413.416		20/01/2022	(7.555.285)	(0,50)
MINUSYALIA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA   Privato							,	
Presencials   Presencials   Presencials   Presencials   Present   Presencials   Pres							. ,	
Pitavalia						10/02/2022		
Preside   President   Presid	MINUSVALIA L	ATENTE SOBRE CONTR	RATOS DE DIVIS	AS A PLAZO CELEBRADOS C	ON FINES DE COBERTURA		(8.536.027)	(0,56)
Parenicals   Pace	Opciones - (0	),21 %)						
Descripción del valor							Valor de	
Opciones adquiridas   GBB						latente	mercado en	% del
CBP 20.83.000 Call Swaption del SONIA a 12 meses	Tenencias	Descripción del valor				USD	USD	patrimonio
208.000 Call Swaption del SONIA a 12 meses								
22.99.000 Call Swaption del SONIA a 12 meses   Vence 10/10/2022   Precio de ejercicio 0.42   (41.112)   13.273   0.00   27.280.000 Call Swaption del SONIA a 12 meses   Vence 11/10/2022   Precio de ejercicio 0.92   (9.281)   65.123   0.01   21.480.000 Call Swaption del SONIA a 12 meses   Vence 11/10/2022   Precio de ejercicio 0.92   (9.281)   65.123   0.01   25.480.000 Call Swaption del SONIA a 12 meses   Vence 13/10/2022   Precio de ejercicio 0.52   (40.448)   19.434   0.00   23.200.000 Call Swaption del SONIA a 12 meses   Vence 16/11/2022   Precio de ejercicio 0.52   (40.448)   19.434   0.00   23.200.000 Call Swaption del SONIA a 12 meses   Vence 16/11/2022   Precio de ejercicio 0.54   (35.248)   19.328   0.00   247.240   19.9.559   0.02   247.240   19.9.559   0.02   249.880.000   Put Swaption del LIBOR a 3 meses   Vence 26/05/2022   Precio de ejercicio 0.43   (53.118)   33.189   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00	20.830.000		a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,28	(33.091)	6.704	0,00
22 930.000 Call Swaption del SONIA a 12 meses	27.230.000	Call Swaption del SONIA	a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,30	(43.692)	9.305	0,00
272 60, 000 Call Swaption del SONIA a 12 meses   Vence 13/10/2022   Precio de ejercicio 0,93   73,93   55,686   0,01   25 490,000 Call Swaption del SONIA a 12 meses   Vence 15/11/2022   Precio de ejercicio 0,54   (35,240)   194,34   0,00   25 200,000 Call Swaption del SONIA a 12 meses   Vence 16/11/2022   Precio de ejercicio 0,54   (35,240)   199,559   0,00	25.090.000	Call Swaption del SONIA	a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,42	(41.112)		0,00
21.490.000 Call Swaption del SONIA a 12 meses		•			•	, ,		0,00
25.490.000 Call Swaption del SONIA a 12 meses   Vence 16/11/2022   Precio de ejercicio 0.52   (40.448)   19.328   0.00		•						
23,200,000   Call Swaption del SONIA a 12 meses   Vence 16/11/2022   Precio de ejercicio 0,54   (35,240)   19,328   0,00		•				, ,		
April   Apri		•			· ·	, ,		
March   Marc	20.200.000	oun onapuon doi contin		701100 1071112022	1 10000 00 0]0101010 0,0 1			
USD USD USO		IDV				(247.240)	199.559	0,02
TOTAL DE OPCIONES ADQUIRIDAS   Crost USB 642.418)   257.735   0,02	494.880.000		a 6 meses	Vence 26/05/2022	Precio de ejercicio 0,43	(53.118)	33.189	0,00
TOTAL DE OPCIONES ADQUIRIDAS (coste USD 642.418)   Coste USD 642.418)   Coste USD 642.418	10.800.000		a 3 meses	Vence 14/11/2022	Precio de eiercicio 0.70	(84.325)	24.987	0.00
Opciones suscritas   EUR   (7.970.000)   Call Swaption del EURIBOR a 6 meses   Vence 13/12/2021   Precio de ejercicio 0,20   (28.819)   (89.060)   (0.01)   (7.970.000)   Call Swaption del EURIBOR a 6 meses   Vence 20/12/2021   Precio de ejercicio 0,19   (33.795)   (90.782)   (0.01)   (7.970.000)   Call Swaption del EURIBOR a 6 meses   Vence 29/12/2021   Precio de ejercicio 0,23   (66.015)   (125.908)   (0.01)   (6.300.000)   Call Swaption del EURIBOR a 6 meses   Vence 06/01/2022   Precio de ejercicio 0,18   (26.410)   (94.287)   (0.01)   (6.300.000)   Call Swaption del EURIBOR a 6 meses   Vence 01/11/2022   Precio de ejercicio 0,13   (18.633)   (115.271)   (0.01)   (6.300.000)   Call Swaption del EURIBOR a 6 meses   Vence 01/11/2022   Precio de ejercicio 0,13   (27.542)   (115.271)   (0.01)   (5.850.000)   Call Swaption del EURIBOR a 6 meses   Vence 01/11/2022   Precio de ejercicio 0,13   (8.109)   (107.037)   (0.01)   (5.850.000)   Call Swaption del EURIBOR a 6 meses   Vence 01/11/2022   Precio de ejercicio 0,13   (8.119)   (107.037)   (0.01)   (5.850.000)   Call Swaption del EURIBOR a 6 meses   Vence 01/11/2022   Precio de ejercicio 0,13   (8.119)   (107.037)   (0.01)   (5.850.000)   Call Swaption del EURIBOR a 6 meses   Vence 01/11/2022   Precio de ejercicio 0,13   (8.119)   (107.037)   (0.01)   (5.850.000)   Call Swaption del EURIBOR a 6 meses   Vence 01/11/2022   Precio de ejercicio 0,13   (8.119)   (107.037)   (0.01)   (5.850.000)   Call Swaption del EURIBOR a 6 meses   Vence 01/11/2022   Precio de ejercicio 0,13   (8.119)   (107.037)   (0.01)   (5.850.000)   Call Swaption del EURIBOR a 6 meses   Vence 01/11/2022   Precio de ejercicio 0,13   (8.119)   (107.037)   (0.01)   (5.200.000)   Call Swaption del EURIBOR a 6 meses   Vence 01/11/2022   Precio de ejercicio 0,13   (8.119)   (107.037)   (0.01)   (5.200.000)   EURIBOR a 6 meses   Vence 01/11/2022   Precio de ejercicio 0,13   (8.119)   (107.037)   (0.01)   (7.970.000)   Put Swaption del EURIBOR a 6 meses   Vence 01/11/2022   Precio de ejercicio 0,13		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·			,	(		
Company	(coste USD 64						257.735	0,02
(7.970.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses		•						
(7.970.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	(7.970.000)		OR a 6 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 0,20	(28.819)	(89.060)	(0,01)
(7.970.00) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	(7.970.000)	Call Swaption del EURIB	OR a 6 meses	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 0,19	(33.795)	(90.782)	(0,01)
(6.300.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (18.633) (115.271) (0,01) (6.300.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (18.000) (142.533) (0,01) (5.850.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (18.000) (142.533) (0,01) (5.850.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (8.119) (107.037) (0,01) (5.850.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (8.119) (107.037) (0,01) (5.850.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (8.119) (107.037) (0,01) (5.850.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (8.119) (107.037) (0,01) (6.300.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (8.119) (107.037) (0,01) (6.300.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (8.119) (107.037) (0,01) (5.200.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,22 (36.001) (140.299) (0,01) (5.200.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,22 (28.791) (115.802) (0,01) (7.970.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,20 (41.018 (19.222) (0,00) (7.970.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 29/12/2021 Precio de ejercicio 0,19 (27.790.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 29/12/2021 Precio de ejercicio 0,19 (27.790.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,11 (2.890) (86.160) (0,00) (6.300.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,11 (2.890) (86.160) (0,01) (6.300.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.514) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.514) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EUR	,	•			•			(0,01)
(6.300.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (27.542) (115.271) (0,01) (7.790.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (18.000) (142.533) (0,01) (5.850.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (8.119) (107.037) (0,01) (5.850.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (8.119) (107.037) (0,01) (5.850.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (8.119) (107.037) (0,01) (5.850.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (8.119) (107.037) (0,01) (5.850.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (8.119) (107.037) (0,01) (5.200.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,22 (36.001) (140.299) (0,01) (5.200.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,22 (28.791) (115.802) (0,01) (7.970.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2021 Precio de ejercicio 0,22 (28.791) (115.802) (0,01) (7.970.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2021 Precio de ejercicio 0,20 (36.001) (35.887) (0,00) (7.970.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 02/12/2021 Precio de ejercicio 0,19 (35.887) (0,00) (7.970.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 06/01/2022 Precio de ejercicio 0,18 (37.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 06/01/2022 Precio de ejercicio 0,18 (37.000) (35.807) (0,000) (35.807) (0,000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 07/11/2022 Precio de ejercicio 0,11 (36.800) (37.900) (37.900.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 07/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (25.54) (56.924) (0,000) (6.300.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 07/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.554) (56.920) (0,000) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 07/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.554) (56.920) (0,000) (5.850.000) Put S	,	•			•		, ,	
(7.790.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	,	•				, ,	, ,	
(5.850.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (8.119) (107.037) (0,01) (5.850.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (8.119) (107.037) (0,01) (5.850.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (8.119) (107.037) (0,01) (6.800.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (8.119) (107.037) (0,01) (6.300.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,22 (36.001) (140.299) (0,01) (5.200.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,22 (28.791) (115.802) (0,01) (7.970.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,22 (28.791) (115.802) (0,01) (7.970.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 20/12/2021 Precio de ejercicio 0,20 41.018 (19.222) (0,00) (7.970.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 20/12/2021 Precio de ejercicio 0,23 26.803 (33.090) (0,00) (7.970.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 06/01/2022 Precio de ejercicio 0,19 21.100 (35.887) (0,00) (7.970.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 06/01/2022 Precio de ejercicio 0,18 11.583 (56.294) (0,00) (8.710.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 26/05/2022 Precio de ejercicio 0,18 11.583 (56.294) (0,00) (6.300.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,11 2.890 (86.160) (0,01) (6.300.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 21.368 (61.298) (0,00) (7.790.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.514) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.514) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.544) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.964) (56.920) (0,00) (5.8	,	•				, ,		
(5.850.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses		•			•	, ,	. ,	
(5.850.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses		•						(0,01)
(6.300.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	(5.850.000)	Call Swaption del EURIB	OR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13		. ,	(0,01)
(5.200.000) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	(5.850.000)	Call Swaption del EURIB	OR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(8.119)	(107.037)	(0,01)
(7.970.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 13/12/2021 Precio de ejercicio 0,20 41.018 (19.222) (0,00) (7.970.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 29/12/2021 Precio de ejercicio 0,19 21.100 (35.887) (0,00) (7.970.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 29/12/2021 Precio de ejercicio 0,23 26.803 (33.090) (0,00) (8.710.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 06/01/2022 Precio de ejercicio 0,18 11.583 (56.294) (0,00) (8.710.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 26/05/2022 Precio de ejercicio 0,11 2.890 (86.160) (0,01) (6.300.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 21.368 (61.298) (0,00) (6.300.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 26.236 (61.298) (0,00) (7.790.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 18.260 (75.796) (0,01) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.514) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.290) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.290) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.290) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.964) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.964) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.964) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.964) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.964) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,22 46.918 (52.515) (0,00) (5.200.000) Put Swapti								(0,01)
(7.970.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 20/12/2021         Precio de ejercicio 0,19         21.100         (35.887)         (0,00)           (7.970.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 29/12/2021         Precio de ejercicio 0,23         26.803         (33.090)         (0,00)           (7.970.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 06/01/2022         Precio de ejercicio 0,18         11.583         (56.294)         (0,00)           (8.710.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 26/05/2022         Precio de ejercicio 0,11         2.890         (86.160)         (0,01)           (6.300.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,13         21.368         (61.298)         (0,00)           (7.790.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,13         26.236         (61.298)         (0,00)           (5.850.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,13         (2.514)         (56.920)         (0,01)           (5.850.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,13         (2.514)         (56.920)         (0,00)           (5.850.000)	,	•						
(7.970.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 29/12/2021         Precio de ejercicio 0,23         26.803         (33.090)         (0,00)           (7.970.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 06/01/2022         Precio de ejercicio 0,18         11.583         (56.294)         (0,00)           (8.710.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 26/05/2022         Precio de ejercicio 0,11         2.890         (86.160)         (0,01)           (6.300.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,13         21.368         (61.298)         (0,00)           (7.790.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,13         26.236         (61.298)         (0,00)           (5.850.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,13         18.260         (75.796)         (0,01)           (5.850.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,13         (2.514)         (56.920)         (0,00)           (5.850.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,13         (2.290)         (56.920)         (0,00)           (5.850.000)	,	•						
(7.970.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 06/01/2022 Precio de ejercicio 0,18 11.583 (56.294) (0,00) (8.710.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 26/05/2022 Precio de ejercicio 0,11 2.890 (86.160) (0,01) (6.300.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 21.368 (61.298) (0,00) (6.300.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 26.236 (61.298) (0,00) (7.790.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 18.260 (75.796) (0,01) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.514) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.290) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.290) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.964) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.964) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.964) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.964) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,22 46.918 (52.515) (0,00) (5.200.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,22 43.665 (43.346) (0,00)	. ,	•						
(8.710.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 26/05/2022 Precio de ejercicio 0,11 2.890 (86.160) (0,01) (6.300.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 21.368 (61.298) (0,00) (7.790.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 26.236 (61.298) (0,00) (7.790.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 18.260 (75.796) (0,01) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.514) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.290) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.2964) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.964) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.964) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.964) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,12 (2.964) (56.920) (0,00) (5.200.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,22 46.918 (52.515) (0,00) (5.200.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,22 43.665 (43.346) (0,00)	,	'						
(6.300.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 21.368 (61.298) (0,00) (6.300.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 26.236 (61.298) (0,00) (7.790.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 18.260 (75.796) (0,01) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.514) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.290) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.964) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.964) (56.920) (0,00) (5.850.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,13 (2.964) (56.920) (0,00) (6.300.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,22 46.918 (52.515) (0,00) (5.200.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,22 43.665 (43.346) (0,00)								
(7.790.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,13         18.260         (75.796)         (0,01)           (5.850.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,13         (2.514)         (56.920)         (0,00)           (5.850.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,13         (2.290)         (56.920)         (0,00)           (5.850.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,13         (2.964)         (56.920)         (0,00)           (5.850.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,13         (2.964)         (56.920)         (0,00)           (6.300.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,22         46.918         (52.515)         (0,00)           (5.200.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,22         43.665         (43.346)         (0,00)	(6.300.000)	Put Swaption del EURIBO	OR a 6 meses					(0,00)
(5.850.000)       Put Swaption del EURIBOR a 6 meses       Vence 01/11/2022       Precio de ejercicio 0,13       (2.514)       (56.920)       (0,00)         (5.850.000)       Put Swaption del EURIBOR a 6 meses       Vence 01/11/2022       Precio de ejercicio 0,13       (2.290)       (56.920)       (0,00)         (5.850.000)       Put Swaption del EURIBOR a 6 meses       Vence 01/11/2022       Precio de ejercicio 0,13       (2.964)       (56.920)       (0,00)         (5.850.000)       Put Swaption del EURIBOR a 6 meses       Vence 01/11/2022       Precio de ejercicio 0,13       (2.964)       (56.920)       (0,00)         (6.300.000)       Put Swaption del EURIBOR a 6 meses       Vence 01/11/2022       Precio de ejercicio 0,22       46.918       (52.515)       (0,00)         (5.200.000)       Put Swaption del EURIBOR a 6 meses       Vence 01/11/2022       Precio de ejercicio 0,22       43.665       (43.346)       (0,00)		•			•			
(5.850.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,13         (2.290)         (56.920)         (0,00)           (5.850.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,13         (2.964)         (56.920)         (0,00)           (5.850.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,13         (2.964)         (56.920)         (0,00)           (6.300.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,22         46.918         (52.515)         (0,00)           (5.200.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,22         43.665         (43.346)         (0,00)								
(5.850.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,13         (2.964)         (56.920)         (0,00)           (5.850.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,13         (2.964)         (56.920)         (0,00)           (6.300.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,22         46.918         (52.515)         (0,00)           (5.200.000)         Put Swaption del EURIBOR a 6 meses         Vence 01/11/2022         Precio de ejercicio 0,22         43.665         (43.346)         (0,00)	,	•						
(5.850.000)       Put Swaption del EURIBOR a 6 meses       Vence 01/11/2022       Precio de ejercicio 0,13       (2.964)       (56.920)       (0.00)         (6.300.000)       Put Swaption del EURIBOR a 6 meses       Vence 01/11/2022       Precio de ejercicio 0,22       46.918       (52.515)       (0,00)         (5.200.000)       Put Swaption del EURIBOR a 6 meses       Vence 01/11/2022       Precio de ejercicio 0,22       43.665       (43.346)       (0,00)	,	•			•			
(6.300.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,22 46.918 (52.515) (0,00) (5.200.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,22 43.665 (43.346) (0,00)	, ,	•			•	, ,		
(5.200.000) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Vence 01/11/2022 Precio de ejercicio 0,22 43.665 (43.346) (0,00)		•			•			
(57.705) (2.209.947) (0,15)		•						(0,00)
						(57.705)	(2.209.947)	(0,15)

#### Opciones - (continuación)

Tenencias	Descripción del valor			Plusvalía/ (minusvalía) latente USD	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	Opciones suscritas – (continuación) GBP					
(2.150.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,36	10.764	(29.037)	(0,00)
, ,	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,40	11.279	(41.719)	(0,00)
,	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,38	14.167	(40.298)	(0,00)
,	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,42	9.575	(40.466)	(0,00)
,	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 11/10/2022	Precio de ejercicio 1,04	(86.411)	(160.649)	(0,01)
,	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 13/10/2022	Precio de ejercicio 0,99	(56.778)	(117.648)	(0,01)
(2.630.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 15/11/2022	Precio de ejercicio 0,55	(5.790)	(65.595)	(0,01)
(2.400.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,60	(11.177)	(65.816)	(0,01)
			· -	(114.371)	(561.228)	(0,04)
	USD					
(9.130.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 06/12/2021	Precio de ejercicio 1,58	(15.097)	(84.143)	(0,01)
(9.130.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,64	(57.546)	(136.407)	(0,01)
(9.130.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 1,67	(92.366)	(170.427)	(0,01)
(9.130.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 1,60	(42.394)	(127.303)	(0,01)
(2.100.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 14/11/2022	Precio de ejercicio 1,06	60.134	(48.945)	(0,00)
(9.130.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 06/12/2021	Precio de ejercicio 1,58	54.778	(14.267)	(0,00)
(9.130.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,64	58.916	(19.945)	(0,00)
(9.130.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 1,67	48.649	(29.412)	(0,00)
(9.130.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 1,60	29.771	(55.138)	(0,00)
				44.845	(685.987)	(0,04)
TOTAL DE OPO	CIONES SUSCRITAS 329.931))				(3.457.162)	(0,23)
TOTAL DE OPO					(3.199.427)	(0,21)

#### Contratos de permutas financieras – 0,08 %

Importe teórico	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del
- Iocai neto		A recibil	Divisa	recha de vencimiento	030	patrillollio
	Permutas de tipos de interés					
	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 2,000 %	AUD	17/03/2032	52.911	0,01
	Fijo 5,800 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2023	233.526	0,02
	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,400 %	BRL	02/01/2023	17.372	0,00
	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,300 %	BRL	02/01/2024	44.443	0,00
	Fijo 6,320 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2025	353.372	0,02
	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 11,230 %	BRL	04/01/2027	27.903	0,00
	Fijo 1,750 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2026	7.335	0,00
24.320.000	Fijo 1,680 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	22/08/2028	330.976	0,02
10.380.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,500 %	CAD	14/10/2031	78.533	0,01
2.000.000	Fijo 2,000 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2031	26.273	0,00
13.330.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,250 %	CAD	15/12/2051	200.714	0,01
2.570.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,180 %	CAD	22/08/2052	1.072	0,00
2.650.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,000 %	CHF	16/03/2027	11.443	0,00
15.450.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,000 %	CHF	16/03/2032	165.747	0,01
3.980.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,500 %	CHF	17/03/2032	27.595	0,00
119.080.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,500 %	CNY	15/09/2023	31.593	0,00
34.570.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,750 %	CNY	15/09/2026	37.159	0,00
12.200.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,500 %	CNY	15/12/2026	15.220	0,00
145.090.000	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	03/11/2023	182.270	0,01
2.900.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2023	5.134	0,00
2.620.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2024	12.854	0,00
34.770.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2024	67.796	0,01
4.010.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2026	35.409	0,00
12.205.453	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2026	43.444	0,00
21.510.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,200 %	EUR	03/11/2027	40.926	0,00
2.990.000	Fijo 0,000 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2028	31.593	0,00
1.250.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2030	24.418	0,00
5.160.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,500 %	EUR	26/11/2031	41.762	0,00
1.890.000	Fijo 0,000 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2031	23.794	0.00
	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	,	EUR	15/12/2031	3.385	0,00
6.120.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	•	EUR	17/03/2032	31.552	0,00
7.170.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,250 %	EUR	15/12/2036	89.048	0,01
	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,500 %	EUR	15/12/2041	9.936	0,00
	Fijo 0,250 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2024	249.832	0,02
	Fijo 0,250 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2024	9.378	0,00

#### Contratos de permutas financieras – (continuación)

Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
	Permutas de tipos de interés – (continu	uación)				
690.000	Fijo 0,500 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2026	18.139	0,00
11.450.000	Fijo 0,750 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2028	197	0,00
870.000	Fijo 0,750 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2031	14.820	0,00
7.440.000	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	Fijo 1,000 %	GBP	15/12/2041	77.410	0,01
	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	Fijo 0,750 %	GBP	15/12/2051	64.176	0,01
125.700.000	•	Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)	JPY	15/12/2026	1.195	0,00
23.867.360.000	•	Variable (LIBOR a 3 meses en KRW)	KRW	16/03/2024	63.571	0,01
109.970.000	•	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	13/12/2023	82.809	0,01
	Fijo 6,700 %	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	09/12/2026	53.507	0,01
	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 3,000 %	NZD	16/09/2031	7.553	0,00
	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	Fijo 1,750 %	PLN	15/12/2023	614	0,00
	Fijo 1,700 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2026	13.323	0,00
	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,500 %	SEK	16/03/2024	40.842	0,00
	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,750 %	SEK	15/12/2031	41.617	0,00
	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 1,000 %	SEK	17/03/2032	2.631	0,00
	Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD	25/07/2024	1.364	0,00
	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	Fijo 1,530 %	USD	22/09/2031	18.747	0,00
	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	Fijo 1,750 %	USD	15/12/2031	79.922	0,01
26.275.000	Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	Fijo 7,400 %	ZAR	15/12/2031	31.985	0,00
PLUSVALÍA LATEN	ITE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE IN	ITERÉS			3.180.140	0,21
49 225 000	Permutas de incumplimiento crediticio Variable (The Markit CDX North America	(CDS)				
	Investment Grade 28 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2022	20.501	0,00
1.510.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Indonesia)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2024	23.907	0,00
130.000	Variable (Bonos internacionales del Estado saudí)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2024	2.030	0,00
1.000.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Indonesia)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	5.083	0,00
1.300.000	Variable (Bonos internacionales del Estado saudí)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	16.168	0,00
206.025.000	Variable (The Markit CDX North America	•				
	Investment Grade 34 Index) Variable (The Markit CDX North America	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2025	1.684.403	0,11
	Investment Grade 35 Version 1 Index) Variable (The Markit CDX North America	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	121.301	0,01
	Investment Grade 36 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2026	45.915	0,00
	ITE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIM	· · · · ·			1.919.308	0,12
TOTAL DE PLUSVA	ALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE	PERMUTAS FINANCIERAS			5.099.448	0,33
Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% del patrimonio
local neto	A pagar Permutas de tipos de interés	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	latente	
local neto		A recibir Fijo 0,190 %	<b>Divisa</b>	Fecha de vencimiento 22/02/2023	latente	patrimonio
102.020.000	Permutas de tipos de interés				latente USD	patrimonio (0,01)
102.020.000 68.490.000	Permutas de tipos de interés Variable (BBSW a 3 meses en AUD)	Fijo 0,190 %	AUD	22/02/2023	(174.330)	(0,01) (0,05)
102.020.000 68.490.000 15.430.000	Permutas de tipos de interés Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 %	AUD AUD	22/02/2023 15/12/2026	(174.330) (748.947)	(0,01) (0,05) (0,01)
102.020.000 68.490.000 15.430.000 13.140.000	Permutas de tipos de interés Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 % Fijo 2,000 %	AUD AUD AUD	22/02/2023 15/12/2026 15/12/2031	(174.330) (748.947) (199.088) (19.236)	(0,01) (0,05) (0,01) (0,00)
102.020.000 68.490.000 15.430.000 13.140.000 36.220.000	Permutas de tipos de interés Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (LIBOR a 1 mes en BRL)	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 % Fijo 2,000 % Fijo 10,565 %	AUD AUD AUD BRL BRL	22/02/2023 15/12/2026 15/12/2031 02/01/2023 02/01/2023	(174.330) (748.947) (199.088) (19.236) (245.284)	(0,01) (0,05) (0,01) (0,00) (0,02)
102.020.000 68.490.000 15.430.000 13.140.000 36.220.000 2.500.000	Permutas de tipos de interés Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (LIBOR a 1 mes en BRL) Fijo 11,814 %	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 % Fijo 2,000 % Fijo 10,565 % Fijo 7,200 %	AUD AUD AUD BRL BRL BRL	22/02/2023 15/12/2026 15/12/2031 02/01/2023 02/01/2023 02/01/2024	(174.330) (748.947) (199.088) (19.236) (245.284) (1.874)	(0,01) (0,05) (0,01) (0,00) (0,02) (0,00)
102.020.000 68.490.000 15.430.000 13.140.000 36.220.000 2.550.000 2.225.000	Permutas de tipos de interés Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BBCDI a 1 mes en BRL) Variable (LIBOR a 1 mes en BRL) Fijo 11,814 % Fijo 11,905 %	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 % Fijo 2,000 % Fijo 10,565 % Fijo 7,200 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	AUD AUD AUD BRL BRL BRL BRL	22/02/2023 15/12/2026 15/12/2031 02/01/2023 02/01/2023 02/01/2024 02/01/2024	(174.330) (748.947) (199.088) (19.236) (245.284) (1.874) (1.874)	(0,01) (0,05) (0,01) (0,00) (0,02) (0,00) (0,00)
102.020.000 68.490.000 15.430.000 13.140.000 36.220.000 2.500.000 2.225.000 3.425.000	Permutas de tipos de interés Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (LIBOR a 1 mes en BRL) Fijo 11,814 % Fijo 11,905 % Fijo 12,185 %	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 % Fijo 2,000 % Fijo 10,565 % Fijo 7,200 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	AUD AUD AUD BRL BRL BRL BRL BRL	22/02/2023 15/12/2026 15/12/2031 02/01/2023 02/01/2023 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024	(174.330) (748.947) (199.088) (19.236) (245.284) (1.874) (5.686)	(0,01) (0,05) (0,01) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
102.020.000 68.490.000 15.430.000 13.140.000 36.220.000 2.500.000 2.225.000 3.425.000 10.625.000	Permutas de tipos de interés Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (LIBOR a 1 mes en BRL) Fijo 11,814 % Fijo 11,905 % Fijo 12,185 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 % Fijo 2,000 % Fijo 10,565 % Fijo 7,200 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Fijo 4,930 %	AUD AUD BRL BRL BRL BRL BRL BRL	22/02/2023 15/12/2026 15/12/2031 02/01/2023 02/01/2023 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024	(174.330) (748.947) (199.088) (19.236) (245.284) (1.874) (5.686) (168.931)	(0,01) (0,05) (0,01) (0,00) (0,02) (0,00) (0,00) (0,00) (0,01)
102.020.000 68.490.000 15.430.000 13.140.000 36.220.000 2.500.000 2.225.000 3.425.000 10.625.000 23.980.476	Permutas de tipos de interés Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (LIBOR a 1 mes en BRL) Fijo 11,814 % Fijo 11,905 % Fijo 12,185 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 % Fijo 2,000 % Fijo 10,565 % Fijo 7,200 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Fijo 4,930 % Fijo 9,200 %	AUD AUD BRL BRL BRL BRL BRL BRL BRL	22/02/2023 15/12/2026 15/12/2031 02/01/2023 02/01/2023 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024	(174.330) (748.947) (199.088) (19.236) (245.284) (1.874) (5.686) (168.931) (53.311)	(0,01) (0,05) (0,01) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,01) (0,01)
102.020.000 68.490.000 15.430.000 13.140.000 36.220.000 2.500.000 2.225.000 3.425.000 10.625.000 23.980.476 34.300.000	Permutas de tipos de interés Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (LIBOR a 1 mes en BRL) Fijo 11,814 % Fijo 11,905 % Fijo 12,185 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 3 meses en CAD)	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 % Fijo 2,000 % Fijo 10,565 % Fijo 7,200 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Fijo 4,930 % Fijo 9,200 % Fijo 1,560 %	AUD AUD BRL BRL BRL BRL BRL BRL BRL BRL BRL CAD	22/02/2023 15/12/2026 15/12/2031 02/01/2023 02/01/2023 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 22/08/2025	(174.330) (748.947) (199.088) (19.236) (245.284) (1.874) (5.686) (168.931) (53.311) (297.677)	(0,01) (0,05) (0,01) (0,00) (0,02) (0,00) (0,00) (0,00) (0,01) (0,01) (0,01)
102.020.000 68.490.000 15.430.000 13.140.000 2.500.000 2.225.000 3.425.000 10.625.000 23.980.476 34.300.000 15.270.000	Permutas de tipos de interés Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BIBOR a 1 mes en BRL) Fijo 11,814 % Fijo 11,905 % Fijo 12,185 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 %	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 % Fijo 2,000 % Fijo 10,565 % Fijo 7,200 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Fijo 4,930 % Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	AUD AUD BRL BRL BRL BRL BRL BRL CAD	22/02/2023 15/12/2026 15/12/2031 02/01/2023 02/01/2023 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031	(174.330) (748.947) (199.088) (19.236) (245.284) (1.874) (1.874) (5.686) (168.931) (53.311) (297.677) (182.076)	(0,01) (0,05) (0,01) (0,00) (0,02) (0,00) (0,00) (0,01) (0,01) (0,02) (0,01)
102.020.000 68.490.000 15.430.000 13.140.000 36.220.000 2.500.000 2.225.000 3.425.000 10.625.000 23.980.476 34.300.000 15.270.000 60.798.254	Permutas de tipos de interés Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Fijo 11,814 % Fijo 11,905 % Fijo 12,185 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CECTIP a 1 mes en BRL) Variable (CECTIP a 1 mes en BRL) Fijo 2,000 % Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 % Fijo 2,000 % Fijo 7,200 % Fijo 7,200 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Fijo 4,930 % Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 0,000 %	AUD AUD BRL BRL BRL BRL BRL CAD CAD EUR	22/02/2023 15/12/2026 15/12/2031 02/01/2023 02/01/2023 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 15/12/2031 15/12/2031	(174.330) (748.947) (199.088) (19.236) (245.284) (1.874) (5.686) (168.931) (53.311) (297.677) (182.076) (51.687)	(0,01) (0,05) (0,01) (0,00) (0,02) (0,00) (0,00) (0,01) (0,01) (0,01) (0,02) (0,01) (0,00)
102.020.000 68.490.000 15.430.000 13.140.000 2.500.000 2.225.000 3.425.000 10.625.000 23.980.476 34.300.000 15.270.000 60.798.254 35.950.000	Permutas de tipos de interés Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Fijo 11,814 % Fijo 11,905 % Fijo 12,185 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 %	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 % Fijo 2,000 % Fijo 10,565 % Fijo 7,200 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Fijo 4,930 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	AUD AUD BRL BRL BRL BRL BRL CAD CAD EUR	22/02/2023 15/12/2026 15/12/2031 02/01/2023 02/01/2023 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 15/12/2023	(174.330) (748.947) (199.088) (19.236) (245.284) (1.874) (5.686) (168.931) (53.311) (297.677) (182.076) (51.687) (16.328)	(0,01) (0,05) (0,01) (0,00) (0,02) (0,00) (0,00) (0,01) (0,01) (0,02) (0,01) (0,00) (0,00)
102.020.000 68.490.000 15.430.000 13.140.000 2.500.000 2.225.000 3.425.000 10.625.000 23.980.476 34.300.000 15.270.000 60.798.254 35.950.000	Permutas de tipos de interés Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (LIBOR a 1 mes en BRL) Fijo 11,814 % Fijo 11,905 % Fijo 12,185 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 % Fijo 2,000 % Fijo 10,565 % Fijo 7,200 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Fijo 4,930 % Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 %	AUD AUD BRL BRL BRL BRL BRL CAD CAD EUR EUR	22/02/2023 15/12/2026 15/12/2031 02/01/2023 02/01/2023 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 15/12/2023 15/12/2025	(174.330) (748.947) (199.088) (19.236) (245.284) (1.874) (5.686) (168.931) (53.311) (297.677) (182.076) (51.687) (16.328) (23.868)	(0,01) (0,05) (0,01) (0,00) (0,02) (0,00) (0,00) (0,01) (0,01) (0,02) (0,00) (0,00) (0,00)
102.020.000 68.490.000 15.430.000 13.140.000 2.500.000 2.225.000 3.425.000 10.625.000 23.980.476 34.300.000 15.270.000 60.798.254 35.950.000 5.080.000 33.800.000	Permutas de tipos de interés Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (LIBOR a 1 mes en BRL) Fijo 11,814 % Fijo 11,905 % Fijo 12,185 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Fijo 0,000 %	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 % Fijo 2,000 % Fijo 10,565 % Fijo 7,200 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Fijo 4,930 % Fijo 9,200 % Fijo 9,200 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	AUD AUD AUD BRL BRL BRL BRL CAD CAD EUR EUR EUR	22/02/2023 15/12/2026 15/12/2031 02/01/2023 02/01/2023 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 15/12/2031 15/12/2025 15/12/2025 15/12/2026 03/11/2027	(174.330) (748.947) (199.088) (19.236) (245.284) (1.874) (5.686) (168.931) (53.311) (297.677) (182.076) (51.687) (16.328) (23.868) (211.364)	(0,01) (0,05) (0,01) (0,02) (0,00) (0,00) (0,01) (0,01) (0,01) (0,01) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
102.020.000 68.490.000 15.430.000 13.140.000 36.220.000 2.500.000 2.225.000 3.425.000 10.625.000 23.980.476 34.300.000 15.270.000 60.798.254 35.950.000 5.080.000 33.800.000 2.630.000	Permutas de tipos de interés  Variable (BBSW a 3 meses en AUD)  Variable (BBSW a 6 meses en AUD)  Variable (BBSW a 6 meses en AUD)  Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)  Variable (LIBOR a 1 mes en BRL)  Fijo 11,814 %  Fijo 11,905 %  Fijo 12,185 %  Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)  Variable (CETIP a 1 mes en BRL)  Variable (CDOR a 3 meses en CAD)  Fijo 2,000 %  Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)  Fijo 0,000 %  Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)  Fijo 0,000 %  Fijo 0,000 %	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 % Fijo 2,000 % Fijo 10,565 % Fijo 7,200 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Fijo 4,930 % Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (LIBOR a 16 meses en EUR)	AUD AUD BRL BRL BRL BRL CAD CAD EUR EUR EUR EUR	22/02/2023 15/12/2026 15/12/2031 02/01/2023 02/01/2023 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 15/12/2023 15/12/2026 03/11/2027 26/11/2027	(174.330) (748.947) (199.088) (19.236) (245.284) (1.874) (5.686) (168.931) (53.311) (297.677) (182.076) (51.687) (16.328) (23.868) (211.364) (41.606)	(0,01) (0,05) (0,01) (0,00) (0,02) (0,00) (0,00) (0,01) (0,01) (0,01) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
102.020.000 68.490.000 15.430.000 13.140.000 2.500.000 2.225.000 3.425.000 10.625.000 23.980.476 34.300.000 15.270.000 60.798.254 35.950.000 33.800.000 33.800.000 33.800.000	Permutas de tipos de interés  Variable (BBSW a 3 meses en AUD)  Variable (BBSW a 6 meses en AUD)  Variable (BBSW a 6 meses en AUD)  Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)  Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)  Fijo 11,814 %  Fijo 11,905 %  Fijo 12,185 %  Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)  Variable (CETIP a 1 mes en BRL)  Variable (CETIP a 1 mes en BRL)  Variable (CDOR a 3 meses en CAD)  Fijo 2,000 %  Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)  Fijo 0,000 %  Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)  Fijo 0,000 %  Fijo 0,000 %  Fijo 0,750 %  Fijo 0,500 %	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 % Fijo 1,250 % Fijo 2,000 % Fijo 7,200 % Fijo 7,200 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Fijo 4,930 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	AUD AUD BRL BRL BRL BRL CAD CAD EUR EUR EUR EUR EUR EUR	22/02/2023 15/12/2026 15/12/2031 02/01/2023 02/01/2023 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 15/12/2023 15/12/2026 03/11/2027 26/11/2021	(174.330) (748.947) (199.088) (19.236) (245.284) (1.874) (5.686) (168.931) (53.311) (297.677) (182.076) (51.687) (16.328) (23.868) (211.364) (41.606) (757)	(0,01) (0,05) (0,01) (0,00) (0,02) (0,00) (0,00) (0,01) (0,01) (0,02) (0,01) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
102.020.000 68.490.000 15.430.000 13.140.000 2.500.000 2.225.000 3.425.000 10.625.000 23.980.476 34.300.000 15.270.000 60.798.254 35.950.000 2.630.000 2.630.000 3.20.000 1.520.000	Permutas de tipos de interés Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (LIBOR a 1 mes en BRL) Fijo 11,814 % Fijo 11,905 % Fijo 12,185 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Fijo 0,750 % Fijo 0,750 % Fijo 0,500 % Fijo 0,500 %	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 % Fijo 1,250 % Fijo 10,565 % Fijo 7,200 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Fijo 4,930 % Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	AUD AUD BRL BRL BRL BRL CAD CAD EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR	22/02/2023 15/12/2026 15/12/2031 02/01/2023 02/01/2023 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2025 15/12/2026 03/11/2027 26/11/2041 15/12/2041	(174.330) (748.947) (199.088) (19.236) (245.284) (1.874) (5.686) (168.931) (53.311) (297.677) (182.076) (51.687) (16.328) (23.868) (211.364) (41.606) (757) (22.871)	(0,01) (0,05) (0,01) (0,00) (0,02) (0,00) (0,01) (0,01) (0,02) (0,01) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
102.020.000 68.490.000 15.430.000 13.140.000 2.500.000 2.225.000 3.425.000 10.625.000 23.980.476 34.300.000 15.270.000 60.798.254 35.950.000 33.800.000 2.630.000 320.000 1.520.000 42.630.000	Permutas de tipos de interés  Variable (BBSW a 3 meses en AUD)  Variable (BBSW a 6 meses en AUD)  Variable (BBSW a 6 meses en AUD)  Variable (BBCDI a 1 mes en BRL)  Variable (LIBOR a 1 mes en BRL)  Fijo 11,814 %  Fijo 11,905 %  Fijo 12,185 %  Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)  Variable (CETIP a 1 mes en BRL)  Variable (CETIP a 1 mes en BRL)  Variable (CDOR a 3 meses en CAD)  Fijo 2,000 %  Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)  Fijo 0,000 %  Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)  Fijo 0,000 %  Fijo 0,750 %  Fijo 0,500 %  Fijo 0,500 %  Fijo 0,500 %	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 % Fijo 2,000 % Fijo 10,565 % Fijo 7,200 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Fijo 4,930 % Fijo 9,200 % Fijo 9,200 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	AUD AUD AUD BRL BRL BRL BRL CAD CAD EUR	22/02/2023 15/12/2026 15/12/2031 02/01/2023 02/01/2023 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 15/12/2025 15/12/2026 03/11/2027 26/11/2041 15/12/2051 15/12/2051	(174.330) (748.947) (199.088) (19.236) (245.284) (1.874) (5.686) (168.931) (53.311) (297.677) (182.076) (51.687) (16.328) (23.868) (211.364) (41.606) (757) (22.871)	(0,01) (0,05) (0,01) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,01) (0,01) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
102.020.000 68.490.000 15.430.000 13.140.000 2.500.000 2.225.000 3.425.000 10.625.000 23.980.476 34.300.000 15.270.000 60.798.254 35.950.000 33.800.000 2.630.000 32.000 1.520.000 42.630.000 42.630.000 12.550.000	Permutas de tipos de interés  Variable (BBSW a 3 meses en AUD)  Variable (BBSW a 6 meses en AUD)  Variable (BBSW a 6 meses en AUD)  Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)  Variable (LIBOR a 1 mes en BRL)  Fijo 11,814 %  Fijo 11,905 %  Fijo 12,185 %  Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)  Variable (CETIP a 1 mes en BRL)  Variable (CETIP a 1 mes en BRL)  Variable (CDOR a 3 meses en CAD)  Fijo 2,000 %  Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)  Fijo 0,000 %  Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)  Fijo 0,000 %  Fijo 0,750 %  Fijo 0,500 %  Fijo 0,500 %  Fijo 0,500 %  Fijo 0,500 %	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 % Fijo 2,000 % Fijo 10,565 % Fijo 7,200 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Fijo 4,930 % Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	AUD AUD AUD BRL BRL BRL BRL CAD CAD EUR	22/02/2023 15/12/2026 15/12/2031 02/01/2023 02/01/2023 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 15/12/2026 03/11/2027 26/11/2041 15/12/2051 15/12/2051 15/12/2051	(174.330) (748.947) (199.088) (19.236) (245.284) (1.874) (5.686) (168.931) (53.311) (297.677) (182.076) (51.687) (16.328) (23.868) (211.364) (41.606) (757) (22.871) (227.846) (123.652)	(0,01) (0,05) (0,01) (0,02) (0,00) (0,00) (0,01) (0,01) (0,01) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
102.020.000 68.490.000 15.430.000 13.140.000 2.500.000 2.225.000 3.425.000 10.625.000 23.980.476 34.300.000 15.270.000 60.798.254 35.950.000 5.080.000 2.630.000 33.800.000 1.520.000 42.630.000 12.550.000 14.680.000	Permutas de tipos de interés  Variable (BBSW a 3 meses en AUD)  Variable (BBSW a 6 meses en AUD)  Variable (BBSW a 6 meses en AUD)  Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)  Variable (LIBOR a 1 mes en BRL)  Fijo 11,814 %  Fijo 11,905 %  Fijo 12,185 %  Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)  Variable (BCDI a 1 mes en BRL)  Variable (CETIP a 1 mes en BRL)  Variable (CETIP a 1 mes en BRL)  Variable (LIBOR a 3 meses en CAD)  Fijo 2,000 %  Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)  Fijo 0,000 %  Fijo 0,000 %  Fijo 0,500 %  Fijo 0,500 %  Fijo 0,500 %  Fijo 0,750 %  Fijo 0,750 %  Fijo 0,750 %  Fijo 1,000 %	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 % Fijo 1,250 % Fijo 2,000 % Fijo 7,200 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Fijo 4,930 % Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	AUD AUD AUD BRL BRL BRL BRL CAD CAD EUR EUR EUR EUR EUR EUR GBP GBP	22/02/2023 15/12/2026 15/12/2031 02/01/2023 02/01/2023 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 15/12/2026 03/11/2027 26/11/2041 15/12/2026 15/12/2026 15/12/2026 15/12/2026 15/12/2026 15/12/2026	(174.330) (748.947) (199.088) (19.236) (245.284) (1.874) (5.686) (168.931) (53.311) (297.677) (182.076) (51.687) (16.328) (23.868) (211.364) (41.606) (757) (22.871) (227.846) (123.652) (132.721)	(0,01) (0,05) (0,01) (0,00) (0,02) (0,00) (0,01) (0,01) (0,01) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0
102.020.000 68.490.000 15.430.000 15.430.000 13.140.000 2.220.000 2.500.000 2.225.000 3.425.000 10.625.000 23.980.476 34.300.000 15.270.000 60.798.254 35.950.000 2.630.000 2.630.000 1.520.000 1.520.000 1.520.000 1.520.000 12.550.000 12.650.000 14.680.000	Permutas de tipos de interés  Variable (BBSW a 3 meses en AUD)  Variable (BBSW a 6 meses en AUD)  Variable (BBSW a 6 meses en AUD)  Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)  Variable (LIBOR a 1 mes en BRL)  Fijo 11,814 %  Fijo 11,905 %  Fijo 12,185 %  Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)  Variable (CETIP a 1 mes en BRL)  Variable (CETIP a 1 mes en BRL)  Variable (CDOR a 3 meses en CAD)  Fijo 2,000 %  Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)  Fijo 0,000 %  Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)  Fijo 0,000 %  Fijo 0,750 %  Fijo 0,500 %  Fijo 0,500 %  Fijo 0,500 %  Fijo 0,500 %	Fijo 0,190 % Fijo 1,250 % Fijo 2,000 % Fijo 10,565 % Fijo 7,200 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Fijo 4,930 % Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	AUD AUD AUD BRL BRL BRL BRL CAD CAD EUR	22/02/2023 15/12/2026 15/12/2031 02/01/2023 02/01/2023 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 15/12/2026 03/11/2027 26/11/2041 15/12/2051 15/12/2051 15/12/2051	(174.330) (748.947) (199.088) (19.236) (245.284) (1.874) (5.686) (168.931) (53.311) (297.677) (182.076) (51.687) (16.328) (23.868) (211.364) (41.606) (757) (22.871) (227.846) (123.652)	(0,01) (0,05) (0,01) (0,02) (0,00) (0,00) (0,01) (0,01) (0,01) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)

#### Contratos de permutas financieras – (continuación)

1.43	Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% del patrimonio
437300000 Variabe (LIBOR a 12 meses en JPY)   Fijo 0,000 %		· ·	ión)				•
1.434.800.000   Fijio 0,000 %   Variable (LIBOR a 12 messe en NPY)   Fig. 15/12/2031   12.24.17)   15/13/2031   12.24.17)   15/13/2031   13.37.49   15/13/2031   13.37.49   15/13/2031   13.37.49   15/13/2031   13.37.49   13.37.59.6000   Fijio 2,100 %   Variable (RIBOR a 6 messe en NCK)   NOK   11/03/2037   16/03/2037   16/03/2037   16/03/2037   16/03/2037   16/03/2037   16/03/2037   16/03/2037   16/03/2037   16/03/2037   16/03/2037   16/03/2037   16/03/2037   16/03/2037   16/03/2037   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/2032   16/03/20	437.300.000		•	JPY	15/12/2026	(4.457)	(0.00)
5.115.210.000 Fijo 1,750 % Variable (KWCDC a 3 meses en KRW) KRW 150/30231 (111.245) C 37.860.000 Fijo 2,100 % Variable (TIBE a 1 mes en MXN) MXN 03/122031 (38.794) C 7.860.000 Fijo 2,200 % Variable (NIBOR a 6 meses en NCK) NOK 160/32027 (89.600) C 7.87550.000 Fijo 2,200 % Variable (NIBOR a 6 meses en NCK) NOK 160/32032 (45.439) C 14.1230.000 Fijo 2,200 % Variable (NIBOR a 6 meses en NCK) NOK 160/32032 (45.439) C 14.1230.000 Variable (NIBOR a 6 meses en NCK) NOK 160/32032 (45.439) C 14.1230.000 Variable (NIBOR a 6 meses en NCK) NOK 160/32032 (45.439) C 15.120.000 Variable (NIBOR a 6 meses en NCK) NOK 160/32032 (45.439) C 15.120.000 Variable (NIBOR a 6 meses en NCK) NOK 160/32032 (45.439) C 15.120.000 Variable (NIBOR a 6 meses en NCK) NOK 160/32032 (45.439) C 15.120.000 Variable (NIBOR a 7 meses en NCK) NOK 160/32032 (45.439) C 15.120.000 Variable (NIBOR a 7 meses en NCK) NOK 160/32032 (45.439) C 15.120.000 Variable (NIBOR a 7 meses en NCK) NOK 160/32032 (45.439) C 15.120.000 Variable (NIBOR a 7 meses en NCK) NOK 160/32032 (45.439) C 15.120.000 Variable (NIBOR a 7 meses en NCK) NOK 160/32032 (45.439) C 15.120.000 Variable (NIBOR a 7 meses en NCK) NOK 160/32032 (45.439) C 15.120.000 Variable (NIBOR a 7 meses en NCK) NOK 160/32032 (12.216) C 15.120.000 Variable (NIBOR a 7 meses en NCK) NOK 160/32032 (12.216) C 15.120.000 Variable (NIBOR a 7 meses en NCK) NOK 160/32032 (14.7075) C 15.120.000 Variable (NIBOR a 7 meses en NCK) NOK 160/32032 (15.236) C 15.120.000 Variable (NIBOR a 7 meses en NCK) NOK 160/32032 (15.236) C 15.120.000 Variable (NIBOR a 7 meses en NCK) NOK 160/32032 (15.236) C 15.120.000 Variable (NIBOR a 7 meses en NCK) NOK 160/32032 (15.236) C 15.120.000 Variable (NIBOR a 7 meses en NCK) NOK 160/32032 (15.236) C 15.120.000 Variable (NIBOR a 7 meses en NCK) NOK 160/32032 (15.236) C 15.120.000 Variable (NIBOR a 7 meses en NCK) NOK 160/32032 (15.236) C 15.120.000 Variable (NIBOR a 7 meses en NCK) NOK 160/32032 (15.236) C 15.120.0000 Variable (NIBOR a 7 meses en NCK) NOK 160/32032 (15.236) C 15.120.0000 Var		,		JPY	15/12/2031	` ,	(0,00)
37,860.000 Fijo 2,100 % Variable (TIIE a 1 mes en MXN) MXN 03/12/2031 (38,794) (79,580.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/2027 (98,660) (87,550.000 Fijo 2,130 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/2031 (107,249) (12,540 % NOK 11/05/2031 (107,249) (145,439) (145,439) (147,249) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,430) (145,			,	KRW	15/09/2031	, ,	(0,01
P3.50.000   Fip 2,100 %   Variable (NIBOR a 6 messe an NOK)   NOK   1609,2027 (98.680)   R5.550.00 Fip 2,100 %   Variable (NIBOR a 6 messe an NOK)   NOK   1609,2023 (145.489)   21.940.000   Fip 2,200 %   Variable (NIBOR a 6 messe an NOK)   NOK   1609,2032 (145.489)   R5.500.00   Fip 2,000 %   Variable (NIBOR a 6 messe an NOK)   NOK   1609,2032 (145.489)   R5.500.00   Fip 2,000 %   Variable (NIBOR a 6 messe an NOK)   NOK   NOK   1609,2032 (145.489)   R5.500.00   Fip 2,000 %   Variable (NIBOR a 7 messe an NOK)   NOK   NOK   NOK   1609,2032 (145.489)   R5.500.00   Fip 2,000 %   Variable (NIBOR a 7 messe an NOK)   NOK   NOK   NOK   1609,2032 (145.489)   R5.500.00   Fip 2,000 %   Variable (NIBOR a 7 messe an NOK)   NOK   NOK   NOK   1609,2021 (126.86)   R5.500.00   Fip 2,000 %   Variable (NIBOR a 7 messe an NOK)   NOK   NOK   NOK   NOK   NOK   R5.500.00   Fip 2,000 %   Variable (NIBOR a 7 messe an NOK)   NOK   NOK   NOK   NOK   R5.500.00   Fip 2,000 %   Variable (NIBOR a 7 messe an NOK)   NOK   N			,			. ,	(0,00)
87.550.000 Fijo 2,130 % Variable (NIBOR a 6 messe an NOK) NOK 1108;2031 (107.249) 21.144.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 messe an NOK) NOK 1603;2032 (45.489) 11.230.000 Variable (NZDBB a 3 messe an NZD) Fijo 1,226 % NZD 1512;2032 (43.549) 28.550.000 Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 messe an NZD) NZD 1512;2031 (28.521) 49.260.000 Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 messe an NZD) NZD 1512;2031 (28.521) 49.260.000 Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 messe an NZD) NZD 1512;2031 (28.521) 49.260.000 Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 messe an PLN) PLN 1512;2031 (12.912) 72.2990.000 Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 messe an PLN) PLN 1512;2031 (12.912) 72.2990.000 Variable (NZDBB a 3 messe an PLN) PLN 1512;2031 (12.912) 72.2990.000 Variable (NZDBB a 3 messe an PLN) PLN 1512;2031 (12.912) 72.2990.000 Variable (NZDBB a 3 messe an PLN) PLN 1512;2031 (12.912) 72.2990.000 Variable (NZDBB a 3 messe an PLN) PLN 1512;2031 (12.913) 72.2990.000 Variable (NZDBB a 3 messe an PLN) PLN 1512;2031 (12.913) 73.2990.000 Variable (NZDBB a 3 messe an PLN) PLN 1512;2031 (12.913) 74.100.000 Fijo 0,250 % Variable (SOFR a 1 mes an USD) USD 1603;2024 (47.075) (10.913) 75.700.000 Fijo 1,000 % Variable (NZDR a 3 messe an USD) USD 1603;2024 (47.075) (10.913) 75.700.000 Fijo 1,000 % Variable (NZDR a 3 messe an USD) USD 1603;2024 (15.236) (10.913) 75.700.000 Fijo 1,000 % Variable (NZDR a 1 mes an USD) USD 1603;2025 (115.236) (10.913) 75.700.000 Fijo 1,000 % Variable (NZDR a 1 mes an USD) USD 1603;2025 (115.231) (10.913) 75.700.000 Variable (Uniball-Rodamoc-Westfield S.E.) Fijo 1,000 % EUR 2006;2024 (16.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.548) (1.5			,	NOK	16/03/2027	, ,	(0,01
11.94.0,000 Fijo 2,000 %		•	,			, ,	(0,01)
1.120.000 Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)		•	,	NOK	16/03/2032	,	(0,00
Al 260.000 Fijo 2,000	11.230.000	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 1,250 %	NZD	15/12/2022	, ,	(0,00
9 700.000 Fijo 2,000 % 72 990.000 Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Fijo 2,509 % SEK 151220031 (12.912) (12.828) (13.81220036 (13.81520036 (13.81520036 (13.81520036 (13.81520036 (13.81520036 (13.81520036 (13.81520036 (13.81520036 (13.81520036 (13.8152036 (13.81520036 (13.81520036 (13.81520036 (13.81520036 (13.81520) (13.81520036 (13.81520) (13.81520036 (13.81520) (13.81520036 (13.81520) (13.81520036 (13.81520) (13.81520036 (13.81520) (13.81520) (13.81520036 (13.81520) (13.81520) (13.81520036 (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.8152	8.550.000	Fijo 2,000 %	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	NZD	15/12/2031	(28.521)	(0,00
9 700.000 Fijo 2,000 % 72 990.000 Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Fijo 2,509 % SEK 151220031 (12.912) (12.828) (13.81220036 (13.81520036 (13.81520036 (13.81520036 (13.81520036 (13.81520036 (13.81520036 (13.81520036 (13.81520036 (13.81520036 (13.8152036 (13.81520036 (13.81520036 (13.81520036 (13.81520036 (13.81520) (13.81520036 (13.81520) (13.81520036 (13.81520) (13.81520036 (13.81520) (13.81520036 (13.81520) (13.81520036 (13.81520) (13.81520) (13.81520036 (13.81520) (13.81520) (13.81520036 (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.81520) (13.8152	49.260.000	Fijo 0,250 %	Variable (WIBOR a 3 meses en PLN)	PLN	16/12/2021	(22.618)	(0,00
T2.990.000 Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)   Fijo 0.250 %   SEK   15/12/2026 (12.288)   T1.410.000   Fijo 0.250 %   Variable (SOFR a 1 mes en USD)   USD   16/03/2024 (47.075)   T1.410.000   Fijo 0.250 %   Variable (SOFR a 1 mes en USD)   USD   16/03/2024 (47.075)   T1.410.000   Fijo 0.250 %   Variable (SOFR a 1 mes en USD)   USD   16/03/2024 (47.075)   T1.410.000   Fijo 1.200 %   Variable (SOFR a 1 mes en USD)   USD   17/09/2031   T1.520 %   T1.410.000   Fijo 1.200 %   Variable (UBOR a 3 meses en USD)   USD   20/09/2036 (31.615)   T1.520.000   T1.500 %   Variable (SOFR a 1 mes en USD)   USD   T1.500.000   T1.500 %   Variable (SOFR a 1 mes en USD)   USD   T1.500.000   T1.500 %   Variable (SOFR a 1 mes en USD)   USD   T1.500.000   T1.500 %   Variable (SOFR a 1 mes en USD)   USD   T1.500.000   T1.500 %   Variable (SOFR a 1 mes en USD)   USD   T1.500.000   T1.500 %   T1.500.000   T1.50			,			, ,	(0,00)
1.1.10.000 Fig. 0.260 %		•	,	SEK	15/12/2026	, ,	(0,00)
19.530.000   Fijo 1.000 %   Variable (SDFR a 1 mes en USD)			•	USD	16/03/2024	, ,	(0,00)
5,700.000   Fijo 2,500 %   Variable (LIBOR a 3 messes en USD)   USD   17(0)2031   (15.236)   (2.2810.000 Fijo 1,630 %   Variable (SOFR a 1 mess en USD)   USD   22/09/2038   (31.615)   (3.280.000 Fijo 1,750 %   Variable (SOFR a 1 mess en USD)   USD   16/03/2052   (15.231)   (2.231,765.819 Fijo 5,500 %   Variable (JIBAR a 3 messe en ZAR)   ZAR   15/12/2023   (34.618)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.397)   (3.804.3		•	` ,	USD	16/03/2027		(0,01
22.810.000 Fijo 1,630 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 22/09/2036 (31.615) (31.635)		•	` ,	USD	17/09/2031	, ,	(0,00)
6.330.000   Fijo 1.750 %		•	,			, ,	(0,00)
231.765.819   Fijo 5.500 %   Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)   ZAR   15/12/2023   (43.618)   (18.712/2023   (43.618)   (18.712/2023   (43.618)   (18.712/2023   (43.618)   (18.712/2023   (43.618)   (18.712/2023   (43.618)   (18.712/2023   (43.618)   (18.712/2023   (43.618)   (18.712/2023   (43.618)   (18.712/2023   (43.618)   (18.712/2023   (43.618)   (18.712/2023   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (43.618)   (4		• • • • • • • • • • • • • • • • • • • •	,	USD	16/03/2052	, ,	(0,01
Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)   3.000.000   Variable (Unibail-Rodamco-Westfield S.E.)   Fijo 1,000 %   EUR   20/06/2024   (16.548)   (16.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.548)   (19.5			•				(0,00
3.000.000 Variable (Unibail-Rodamco-Westfield S.E.)   Fijo 1,000 %   EUR   20/06/2024   (16.548)   (10.10.000 Variable (Bonos internacionales del Estado de México)   Elipo 1,000 %   USD   20/12/2026   (11.299)   (10.10.000 Variable (Bonos internacionales del Estado de México)   Elipo 1,000 %   USD   20/12/2026   (11.299)   (10.10.000 Variable (Bonos internacionales del Estado de México)   Elipo 1,000 %   USD   20/12/2026   (11.299)   (10.10.000 Variable (Bonos internacionales del Estado de Mexico)   Elipo 1,000 %   USD   20/12/2026   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)   (11.299)	MINUSVALÍA LATE	ENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INT	ERÉS			(3.804.397)	(0,25
3.000.000 Variable (Unibail-Rodamco-Westfield S.E.)   Fijo 1,000 %   EUR   20/06/2024   (16.548)   (16.548)   (10.10.000 Variable (Bonos internacionales del Estado de Mexico)   Eijo 1,000 %   USD   20/12/2026   (11.299)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548)   (10.548		Permutas de incumplimiento crediticio (C	DS)				
MINUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMIENTO CREDITICIO (CDS) (27.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.847) (17.	3.000.000	•	,	EUR	20/06/2024	(16.548)	(0,00
MINUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMIENTO CREDITICIO (CDS)	1.010.000	Variable (Bonos internacionales del Estado	•			, ,	
VALOR DE MERCADO DE LAS INVERSIONES (coste USD 1.438.752.324)   1.469.195.821   5.50			Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(11.299)	(0,00)
VALOR DE MERCADO DE LAS INVERSIONES (coste USD 1.438.752.324)         1.469.195.821         9           OTROS ACTIVOS Y PASIVOS         51.033.654           PATRIMONIO         1.520.229.475         10           Valor de mercado en mercado en USD         Valor de mercado en USD         patrin           TOTAL DE INVERSIONES         1.468.834.464         9           Plusvalía latente sobre contratos de futuros         7.226.443         9           Minusvalía latente sobre contratos de futuros         3.139.039)         (contratos de divisas a plazo           Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo         6.644.702         3.880.662         9           Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura         3.880.662         9           Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura         (8.536.027)         (contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura         (8.536.027)         (contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura         (8.536.027)         (contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura         (8.536.027)         (contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura         (contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura         (contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura         (contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura         (contratos de divisas a plazo celebrados c	MINUSVALÍA LATE	ENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMIE	NTO CREDITICIO (CDS)			(27.847)	(0,00)
Icoste USD 1.438.752.324)         1.469.195.821         5           OTROS ACTIVOS Y PASIVOS         51.033.654           PATRIMONIO         1.520.229.475         10           TOTAL DE INVERSIONES         Valor de mercado en uSD         patrin           TOtal inversiones excluyendo derivados (coste USD 1.441.439.837)         1.468.834.464         9           Plusvalía latente sobre contratos de futuros         7.226.443         9           Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo         (3.139.039)         (           Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo         (3.783.161)         (           Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo         (3.783.161)         (           Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura         3.880.662         (           Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura         (8.536.027)         (           Valor de mercado de opciones compradas (coste USD 642.418)         257.735         (           Valor de mercado de opciones suscritas (coste USD (3.29.931))         (3.457.162)         (           Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras         5.099.448         (           Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras         5.099.448         (           Minusv	TOTAL DE MINUS	VALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE P	ERMUTAS FINANCIERAS			(3.832.244)	(0,25)
PATRIMONIO         1.520.229.475         10           TOTAL DE INVERSIONES         Valor de mercado en USD           TOTAL INVERSIONES         1.468.834.464         9           Plusvalía latente sobre contratos de futuros         7.226.443         9           Plusvalía latente sobre contratos de futuros         (3.139.039)         (6.644.702           Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo         6.644.702         9           Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo         (3.783.161)         (6.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.16						1.469.195.821	96,64
PATRIMONIO         1.520.229.475         10           TOTAL DE INVERSIONES         Valor de mercado en USD           TOTAL INVERSIONES         1.468.834.464         9           Plusvalía latente sobre contratos de futuros         7.226.443         9           Plusvalía latente sobre contratos de futuros         (3.139.039)         (6.644.702           Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo         6.644.702         9           Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo         (3.783.161)         (6.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.161)         (7.783.16	OTROS ACTIVOS	Y PASIVOS				51.033.654	3,36
TOTAL DE INVERSIONES  Total inversiones excluyendo derivados (coste USD 1.441.439.837)  Total inversiones excluyendo derivados (coste USD 1.441.439.837)  Plusvalía latente sobre contratos de futuros  Plusvalía latente sobre contratos de futuros  Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo  Rinusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo (3.783.161)  Rinusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura  Rinusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura  Rinusvalía latente sobre contratos de opciones compradas (coste USD 642.418)  Valor de mercado de opciones suscritas (coste USD 642.418)  Valor de mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931))  (3.457.162)  Rinusvalía latente sobre contratos de permutas financieras  Songa.448  Rinusvalía latente sobre contratos de permutas financieras  Songa.449  Cotros activos y pasivos							100,00
TOTAL DE INVERSIONES         mercado en USD         patrin           Total inversiones excluyendo derivados (coste USD 1.441.439.837)         1.468.834.464         9           Plusvalía latente sobre contratos de futuros         7.226.443           Minusvalía latente sobre contratos de futuros         (3.139.039)         (           Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo         (6.644.702         (3.783.161)         (           Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo         (3.783.161)         (           Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura         3.880.662         (           Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura         (8.536.027)         (           Valor de mercado de opciones compradas (coste USD 642.418)         257.735         (           Valor de mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931))         (3.457.162)         (           Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras         5.099.448         (           Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras         51.033.654         (							,
TOTAL DE INVERSIONES         USD         patrin           Total inversiones excluyendo derivados (coste USD 1.441.439.837)         1.468.834.464         9           Plusvalía latente sobre contratos de futuros         7.226.443           Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo         (3.139.039)         (           Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo         (6.644.702)         (           Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo         (3.783.161)         (           Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura         3.880.662         (           Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura         (8.536.027)         (           Valor de mercado de opciones compradas (coste USD 642.418)         257.735         (           Valor de mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931))         (3.457.162)         (           Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras         5.099.448         (           Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras         5.099.448         (           Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras         5.033.654         (							% de
Total inversiones excluyendo derivados (coste USD 1.441.439.837)  1.468.834.464  Plusvalía latente sobre contratos de futuros  7.226.443  Minusvalía latente sobre contratos de futuros  (3.139.039)  (9.10 svalía latente sobre contratos de divisas a plazo  (1.783.161)  (1.783.161)  (1.783.161)  (2.783.161)  (3.783.161)  (3.783.161)  (4.792  Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo  (5.783.161)  (7.793.161)  (8.536.027)  (8.536.027)  (9.10 de mercado de opciones compradas (coste USD 642.418)  (9.10 de mercado de opciones suscritas (coste USD 642.418)  (9.10 de mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931))  (9.10 svalía latente sobre contratos de permutas financieras	TOTAL DE INVERS	SIONES					% de patrimonio
Plusvalía latente sobre contratos de futuros  7.226.443  Minusvalía latente sobre contratos de futuros  (3.139.039) (6.644.702  Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo  Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo  Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo  Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo  Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura  Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura  Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura  Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura  Valor de mercado de opciones compradas (coste USD 642.418)  Valor de mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931))  Valor de mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931))  (3.457.162)  (9.105.0000000000000000000000000000000000	Total inversiones ex	voluvendo derivados (coste USD 1.441.430.93	7)			1 468 834 464	96,62
Minusvalía latente sobre contratos de futuros       (3.139.039)       (         Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo       6.644.702         Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo       (3.783.161)       (         Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura       3.880.662         Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura       (8.536.027)       (         Valor de mercado de opciones compradas (coste USD 642.418)       257.735       Valor de mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931))       (3.457.162)       (         Valor de mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931))       (3.457.162)       (         Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras       5.099.448         Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras       (3.832.244)       (         Otros activos y pasivos       51.033.654			' /				0,48
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo  Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo  Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo  Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura  Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura  Valor de mercado de opciones compradas (coste USD 642.418)  Valor de mercado de opciones suscritas (coste USD 642.418)  Valor de mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931))  Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras  Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras  Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras  5.099.448  Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras  51.033.654							(0,21
Minusvalia latente sobre contratos de divisas a plazo (3.783.161) (Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura 3.880.662 Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura (8.536.027) (Valor de mercado de opciones compradas (coste USD 642.418) Valor de mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931)) (3.457.162) (Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras 5.099.448 Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras (3.832.244) (Otros activos y pasivos 51.033.654						,	0,44
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura  3.880.662  Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura  (8.536.027) ( Valor de mercado de opciones compradas (coste USD 642.418)  Valor de mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931))  (3.457.162) ( Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras  5.099.448  Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras  (3.832.244) ( Otros activos y pasivos  51.033.654		•					
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura  (8.536.027) (Valor de mercado de opciones compradas (coste USD 642.418)  Valor de mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931)) (3.457.162) (9.104 mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931)) (1.405 mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931)) (2.405 mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931)) (3.457.162) (9.105 mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931)) (3.457.162) (9.105 mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931)) (3.457.162) (9.105 mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931)) (1.405 mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931)) (3.457.162) (9.105 mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931)) (1.405 mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931)) (3.457.162) (9.105 mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931)) (1.405 mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931)) (3.457.162) (9.105 mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931)) (1.405 mercado de opciones su		·	un finan da anhantura			,	(0,25
Valor de mercado de opciones compradas (coste USD 642.418)257.735Valor de mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931))(3.457.162)(Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras5.099.448Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras(3.832.244)(Otros activos y pasivos51.033.654		·					0,25
Valor de mercado de opciones suscritas (coste USD (3.329.931))(3.457.162)(Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras5.099.448Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras(3.832.244)(Otros activos y pasivos51.033.654		•	con inies de copertura			,	(0,56)
Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras 5.099.448 Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras (3.832.244) ( Otros activos y pasivos 51.033.654							0,02
Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras (3.832.244) ( Otros activos y pasivos 51.033.654						,	(0,23
Otros activos y pasivos 51.033.654		•					0,33
							(0,25)
ratrimonio 1.520.229.475 10							
	ratrimonio					1.520.229.475	100,00

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Australia & New Zealand Banking Group Ltd., Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Natwest Markets Plc., Standard Chartered Bank, State Street Bank & Trust, UBS AG y Westpac Banking Corp.

Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc. y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Barclays Bank Plc. y Credit Suisse.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,48 %.

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (d) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (e) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- $^{(f)}$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Valores mobil Bonos – 70,12 Austria	liarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial 2 %					
	Bonos del Estado de Austria 144A <sup>(c)</sup>	EUR	2,100 %	Perp.	155.992	0,13
80.000	Bonos del Estado de Austria 144A <sup>(c)</sup>	EUR	0,850 %	Perp.	89.229	0,07
200.000	Volksbank Wien AG	EUR	0,875 %	23/03/2026	229.031	0,18
					474.252	0,38
Bélgica 90.000	Bonos del Estado de Bélgica – Serie 60 144A <sup>(c)</sup>	EUR	4,250 %	28/03/2041	174.408	0,14
	Bonos del Estado de Bélgica – Serie 80 144A <sup>(c)</sup>	EUR	2,150 %	22/06/2066	255.098	0,20
					429.506	0,34
275 000	Bank of Nova Scotia	GBP	1,250 %	17/12/2025	365.300	0,29
	Bonos del Estado de Canadá	CAD	2,750 %	01/12/2048	998.750	0,80
	Provincia de Ontario, Canadá	CAD	2,850 %	02/06/2023	282.034	0,23
	Provincia de Ontario, Canadá	CAD	2,600 %	02/06/2025	431.230	0,34
	Provincia de Ontario, Canadá	CAD	4,650 %	02/06/2041	102.862	0,08
	Suncor Energy, Inc.	USD	3,100 %	15/05/2025	157.731	0,13
					2.337.907	1,87
Islas Caimán 200.000	CK Hutchison International 21 Ltd.	USD	2,500 %	15/04/2031	204.409	0,16
China		-				<u> </u>
	Agricultural Development Bank of China – Serie 1906	CNY	3,740 %	12/07/2029	359.100	0,29
	Agricultural Development Bank of China – Serie 2004	CNY	2,960 %	17/04/2030	1.969.184	1,58
	Agricultural Development Bank of China – Serie 2105	CNY	3,520 %	24/05/2031	244.028	0,19
1.280.000	China Development Bank – Serie 1710	CNY	4,040 %	10/04/2027	210.638	0,17
	China Development Bank – Serie 1909	CNY	3,500 %	13/08/2026	730.338	0,58
200.000	China Development Bank – Serie 1910	CNY	3,650 %	21/05/2029	32.316	0,03
2.800.000	China Development Bank – Serie 1915	CNY	3,450 %	20/09/2029	446.399	0,36
4.400.000	China Development Bank – Serie 2012	CNY	3,340 %	14/07/2025	702.638	0,56
6.270.000	China Development Bank – Serie 2103	CNY	3,300 %	03/03/2026	999.673	0,80
	Bonos del Estado de China	CNY	2,850 %	04/06/2027	895.673	0,72
	Bonos del Estado de China	CNY	3,810 %	14/09/2050	226.015	0,18
	Bonos del Estado de China – Serie 1824	CNY	4,080 %	22/10/2048	90.767	0,07
	Bonos del Estado de China – Serie 1827	CNY	3,250 %	22/11/2028		0,53
	Bonos del Estado de China – Serie 1906	CNY	3,290 %	23/05/2029	563.405	0,45
	Bonos del Estado de China – Serie 1907 Bonos del Estado de China – Serie 1910	CNY CNY	3,250 % 3,860 %	06/06/2026 22/07/2049	508.398 875.831	0,41 0,70
0.200.000	25.10. 40. 25.440 40 51.114 05.10 10.10	5.1.1		2207.2010	9.518.904	7,62
Croacia						
	Bonos internacionales del Estado de Croacia	EUR	1,500 %	17/06/2031	137.498	0,11
Dinamarca 425 000	Danske Bank A/S <sup>(d)</sup>	EUR	1,375 %	12/02/2030	489.249	0,39
	Bonos del Estado de Dinamarca	DKK	4,500 %	15/11/2039	259.244	0,21
					748.493	0,60
Finlandia						
	SBB Treasury OYJ	EUR	0,750 %	14/12/2028	436.420	0,35
Francia	Agence Française de Develonnement EDIC	ELID	0.125.0/	20/00/2024	AE2 666	0.36
	Agence Francaise de Developpement EPIC BNP Paribas S.A.	EUR USD	0,125 %	29/09/2031	453.666 211.270	0,36
	BPCE S.A. – Serie NC5 <sup>(d)</sup>	EUR	3,375 % 1,500 %	09/01/2025 13/01/2042	211.270 225.909	0,17 0,18
	Caisse Centrale du Credit Immobilier de France S.A.	EUR	(0,472 %)	17/01/2024		0,18
	Crédit Agricole S.A.	USD	4,375 %	17/03/2025		0,24
	Crédit Agricole S.A. <sup>(d)</sup>	GBP	1,874 %	09/12/2031	131.185	0,10
	Électricité de France S.A. <sup>(d)</sup>	EUR	2,875 %	Perp.	233.259	0,19
	Bonos del Estado de Francia OAT	EUR	3,250 %	25/05/2045		0,04
	Bonos del Estado de Francia OAT 144A <sup>(c)</sup>	EUR	1,750 %	25/05/2066	123.407	0,10
	La Mondiale SAM	EUR	0,750 %	20/04/2026		0,09
	Société Générale S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	14/04/2025		0,24
200.000	Valeo S.A.	EUR	1,000 %	03/08/2028	219.784	0,18
Alaman !					2.588.629	2,07
Alemania 200.000	Allianz S.E. <sup>(d)</sup>	EUR	2,625 %	Perp.	220.261	0,18

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
Alemania - (co	ontinuación)					
200.000	Allianz S.E. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,200 %	Perp.	188.747	0,15
	Bayerische Landesbank <sup>(d)</sup>	EUR	1,184 %	23/09/2031	225.995	0,18
	Commerzbank AG <sup>(d)</sup>	EUR	4,000 %	05/12/2030	123.599	0,10
	Commerzbank AG <sup>(d)</sup>	EUR	1,375 %	29/12/2031	111.652	0,09
	Deutsche Bank AG <sup>(d)</sup>	USD	2,222 %	18/09/2024	254.262	0,20
	Deutsche Bank AG <sup>(d)</sup>	USD	2,129 %	24/11/2026	451.341	0,36
	Deutsche Bank AG <sup>(d)</sup>	EUR	1,750 %	19/11/2030	356.112	0,29
570.000	Deutsche Bank AG – Serie E	USD	0,962 %	08/11/2023	275.016	0,22
200.000		GBP EUR	0,875 % 0,625 %	15/09/2026 07/01/2028	763.487 240.517	0,61 0,19
200.000	NF VV	EUR	0,025 %	07/01/2026	3.210.989	2,57
Indonesia					3.210.303	2,57
	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	4,125 %	15/01/2025	336.169	0,27
200.000	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	3,350 %	12/03/2071	189.750	0,15
2.337.000.000	Bonos del Tesoro de Indonesia – Serie FR73	IDR	8,750 %	15/05/2031	189.277	0,15
					715.196	0,57
Irlanda						
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	4,625 %	01/07/2022	153.441	0,12
375.000	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	6,500 %	15/07/2025	429.172	0,35
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	3,000 %	29/10/2028	277.478	0,22
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	3,300 %	30/01/2032	201.698	0,16
	AIB Group Plc.(d)	EUR	1,875 %	19/11/2029	115.634	0,09
	AIB Group Pic.(d)	EUR	2,875 %	30/05/2031	178.952	0,14
	Bank of Ireland Group Plc. <sup>(d)</sup>	EUR	0,375 %	10/05/2027	224.980	0,18
	Bank of Ireland Group Plc. <sup>(d)</sup> Dell Bank International DAC	EUR EUR	1,375 %	11/08/2031	335.701	0,27 0,24
	Bonos del Estado de Irlanda	EUR	1,625 % 0,200 %	24/06/2024 18/10/2030	295.261 336.362	0,24
290.000	Bollos del Estado de Inalida	LOIX		16/10/2030	2.548.679	2,04
Israel					2.546.679	2,04
	Bono del Estado de Israel - Fijo – Serie 327	ILS	2,000 %	31/03/2027	128.756	0,10
310.000	Bonos internacionales del Estado de Israel	USD	3,800 %	13/05/2060	354.421	0,29
					483.177	0,39
Italia	5 10 A 0 : 05 (d)	EUD.	4.075.0/		077.044	2.00
	Enel SpA – Serie 6,5 a <sup>(d)</sup>	EUR	1,375 %	Perp.	277.214	0,22
	Intesa Sanpaolo SpA	EUR	1,350 %	24/02/2031	391.760	0,31
	Buoni poliennali del Tesoro Italia	EUR	0,950 %	15/03/2023	208.635	0,17
	Buoni poliennali del Tesoro Italia Buoni poliennali del Tesoro Italia	EUR EUR	0,144 % 0,950 %	01/04/2026 01/08/2030	158.498 312.197	0,13 0,25
	Buoni poliennali del Tesoro Italia	EUR	6.000 %	01/05/2031	2.481.974	1,99
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A <sup>(c)</sup>	EUR	0,950 %	01/12/2031	193.756	0,15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A <sup>(c)</sup>	EUR	2,800 %	01/03/2067	145.265	0,12
	UniCredit SpA <sup>(d)</sup>	EUR	2,731 %	15/01/2032	230.130	0,18
	•	LOIX			4.399.429	3,52
 Japón						
	Bono del Estado de Japón – Serie 14	JPY	0,700 %	20/03/2061	1.815.805	1,45
192.050.000	Bono del Estado de Japón – Serie 171	JPY	0,300 %	20/12/2039	1.679.022	1,34
19.850.000	Bono del Estado de Japón – Serie 176	JPY	0,500 %	20/03/2041	178.430	0,14
154.250.000	Bono del Estado de Japón – Serie 178	JPY	0,500 %	20/09/2041	1.382.414	1,11
25.350.000	Bono del Estado de Japón – Serie 350	JPY	0,100 %	20/03/2028	227.887	0,18
	Bono del Estado de Japón – Serie 354	JPY	0,100 %	20/03/2029	2.046.640	1,64
	Bono del Estado de Japón – Serie 364	JPY	0,100 %	20/09/2031	1.846.988	1,48
	Bono del Estado de Japón – Serie 429	JPY	0,005 %	01/10/2023	793.306	0,64
689.700.000	Bono del Estado de Japón – Serie 430	JPY	0,005 %	01/11/2023	6.141.331	4,92
					16.111.823	12,90
Jersey 320.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,940 %	30/09/2040	317.200	0,25
	Gatwick Funding Ltd.	GBP	2,500 %	15/04/2030	133.544	0,11
	Heathrow Funding Ltd.	GBP	6,750 %	03/12/2026	205.648	0,17
	Heathrow Funding Ltd.	EUR	1,125 %	08/10/2030	198.425	0,16
					854.817	0,69
Kazajistán						
200.000	KazMunayGas National Co., JSC	USD	6,375 %	24/10/2048	253.046	0,20

150.000   Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL   100.000   Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL   El 200.000   Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL   El 200.000   Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL   El 200.000   Gazprom PUSC Via Gaz Capital S.A.   U 200.000   Logicor Financing SARL   El 200.000   Logicor Financing SARL   Logicor Fina	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de patrimonio
175.000 Blackstone Property Partners Europe Holdings SARI. 150.000 Blackstone Property Partners Europe Holdings SARI. 150.000 Blackstone Property Partners Europe Holdings SARI. 200.000 Blackstone Property Partners Europe Holdings SARI. 200.000 Blackstone Property Partners Europe Holdings SARI. 200.000 Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 300.000 Bearborn SARI. 300.000 Helvetta Europe S.A.(□) 300.000 Helvetta Europe S.A.(□) 300.000 Mexico City Airport Trust 1444(□) 300.000 ABN AMRO Bank NV(□) 325.000 ABN AMRO Bank NV 1444(□) 300.000 ING Groep NV(□) 300.000 ING Groep NV(□) 300.000 ING Groep NV(□) 300.000 JAB Holdings BV 200.000 ING Groep NV(□) 300.000 Stellantis NV 300.000 Volkswagen International Finance NV(□) 300.000 WPC Eurobond BV  Perú 200.000 Bonos internacionales del Estado de Perú  Perú 200.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía 70.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía 230.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía 300.000 WPC Eurobond BV  El Stado Bonos del Tesoro de Corea indexados a la inflación – Serie 2606 Kf 320.0000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Rusia 4.470.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kr 745.420.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2916  España 200.000 Banco Santander S.A. 400.000 Banco Santander S.A.					
150.000   Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL   100.000   Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL   El 200.000   Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL   El 200.000   Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL   El 200.000   Gazprom PLSC Via Gaz Capital S.A.   U	EUR	1,000 %	04/05/2028	194.783	0,16
100.000   Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL   E   200.000   Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL   E   110.000   Fonde Europeo de Establidad Financiera   E   220.000   Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.   U   90.000   Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.   U   50.000   Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.   U   50.000   Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.   E   515.000   Legicor Financing SARL   Legicor Financin	GBP	2,625 %	20/10/2028	204.106	0,16
200.000 Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL 110.000 Fondo Europeo de Estabilidad Financiera 110.000 Fondo Europeo de Estabilidad Financiera 110.000 Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 110.000 Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 110.000 Logicor Financing SARL 110.000 Mexico City Airport Trust 144A(c) 110.000 Mexico City Airport Trust 144A(c) 110.000 Bonos mexicanos – Serie M 30 M M M M M M M M M M M M M M M M M	EUR	1,750 %	12/03/2029	115.969	0,10
110.000	EUR	1,625 %	20/04/2030	228.467	0,18
220,000   Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.   90,000   Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.   U	EUR	0,875 %	10/04/2035	136.384	0,1
99.000 Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.  150.000 Helvetia Europe S.A. <sup>(6)</sup> E 150.000 Logicor Financing SARL  375.000 Logicor Financing SARL  E 150.000 Logicor Financing SARL  E 1.228.800 Bonos mexicanos − Serie M 2.191.900 Bonos mexicanos − Serie M 2.191.900 Bonos mexicanos − Serie M 2.00.000 Mexico Ciţl Airport Trust 144A(c) 200.000 Bonos internacionales del Estado de México  Paises Bajos 200.000 ABN AMRO Bank NV(d) 325.000 ABN AMRO Bank NV 144A(c) 100.000 Airbus S.E. E 100.000 Cooperatieve Rabobank UA 200.000 ING Groep NV(d) 100.000 JAB Holdings BV 200.000 ING Groep NV(d) 100.000 JAB Holdings BV 200.000 ING Groep NV(d) 100.000 Stellantis NV 300.000 Stellantis NV 300.000 Stellantis NV 125.000 Stellantis NV 125.000 Stellantis NV 100.000 Volkswagen International Finance NV(d) 100.000 Volkswagen International Finance NV(d) 100.000 Wirtershall Dea Finance BV 250.000 WPC Eurobond BV  Perú 20.000 Bonos internacionales del Estado de Perú  Portugal 240.000 Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 144A(c) E Catar 210.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía 70.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía 230.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía  Financia 70.000 Bonos del Tesoro de Corea indexados a la inflación − Serie 2606 Kr Catar 210.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2906 Kr Catar 302.290.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 Kr Catar 302.290.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 Kr Catar 302.290.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 Kr Catar 302.290.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 Kr Catar 302.290.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 Kr Catar 302.290.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 Kr Catar 302.290.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 Kr A+470.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2912 Kr Catar 302.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2912 Kr Catar 302.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2912 Kr Catar 302.0000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2912	USD	4,950 %	23/03/2027	238.425	0,19
150.000   Helvetia Europe S.A. (©)   E   150.000   Logicor Financing SARL   E   175.000   Logicor City Airport Trust 144A(c)   U   175.000   Logicor City Airport	USD	8,625 %	28/04/2034	126.180	0,10
150.000   Logicor Financing SARL   375.000   Logicor Financing SARL   E	EUR	2.750 %	30/09/2041	184.811	0,1
México	EUR	0,750 %	15/07/2024	172.910	0,14
México         1.228.800 Bonos mexicanos – Serie M         M           2.191.900 Bonos mexicanos – Serie M 30         M           200.000 Mexico City Airport Trust 144A(c)         U           200.000 Bonos internacionales del Estado de México         U           Países Bajos           200.000 ABN AMRO Bank NV(d)         E           325.000 ABN AMRO Bank NV 144A(c)         U           100.000 Cooperatieve Rabobank UA         E           200.000 ING Groep NV(d)         E           200.000 ING Groep NV(d)         U           100.000 JAB Holdings BV         U           200.000 Ind Securities BV         U           200.000 ING Series NV         U           300.000 Stellantis NV         E           125.000 Stellantis NV         E           125.000 Stellantis NV         E           100.000 Volkswagen International Finance NV(d)         E           300.000 Wintershall Dea Finance BV         E           250.000 WPC Eurobond BV         E           150.000 WPC Eurobond BV         E           240.000 Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 144A(c)         E           210.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía         E           230.000 Bonos del Tesoro de Corea indexados a la inflación – Serie 2606         Kf     <	EUR	1,625 %	15/07/2027	444.594	0,36
1.228.800 Bonos mexicanos – Serie M 2.191.900 Bonos mexicanos – Serie M 3.191.900 Bonos mexicanos – Serie M 3.200.000 Mexico City Airport Trust 144A(c) 200.000 Bonos internacionales del Estado de México  Países Bajos 200.000 ABN AMRO Bank NV(d) 325.000 ABN AMRO Bank NV 144A(c) 100.000 Airbus S.E. E 100.000 Cooperatieve Rabobank UA 200.000 ING Groep NV(d) 200.000 ING Groep NV(d) 200.000 JAB Holdings BV 200.000 Lukoil Securities BV 200.000 Lukoil Securities BV 200.000 Volkswagen International Finance NV(d) 100.000 Volkswagen International Finance NV(d) 100.000 Volkswagen International Finance NV(d) 100.000 WPC Eurobond BV E Perú 20.000 Bonos internacionales del Estado de Perú  Portugal 20.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía 70.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía 200.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía 200.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía Finance NV(d) E Catar 210.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía 200.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía 200.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía E Catar 210.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía 200.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía Finance NV(d) E Catar 210.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía 200.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía Finance NV(d) E Catar 210.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía Finance NV(d) E Catar 210.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía Finance NV(d) E Catar 210.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía Finance NV(d) E Catar 210.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía Finance NV(d) E Catar 210.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía Finance NV(d) E Catar 210.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía Finance NV(d) E Catar 210.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía Finance NV(d) E Catar 210.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía Finance NV(d) E Catar 210.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía Finance NV(d) Finance NV(d) Finance NV(d) Finance NV(d) Finance				2.046.629	1,64
2.191.900 Bonos mexicanos – Serie M 30 200.000 Mexico City Airport Trust 144A <sup>(c)</sup> 200.000 Bonos internacionales del Estado de México  Países Bajos 200.000 ABN AMRO Bank NV <sup>(d)</sup> 325.000 ABN AMRO Bank NV <sup>(d)</sup> 401.0000 Airbus S.E. 100.000 Airbus S.E. 100.000 Alba Amro Bank NV 144A <sup>(c)</sup> 401.0000 Airbus S.E. 100.000 ING Groep NV <sup>(d)</sup> 502.0000 ING Groep NV <sup>(d)</sup> 503.0000 ING Groep NV <sup>(d)</sup> 503.0000 ING Groep NV <sup>(d)</sup> 503.0000 JAB Holdings BV 503.0000 JAB Holdings BV 503.0000 JAB Holdings BV 503.0000 Jestellantis NV 503.0000 Stellantis NV 503.0000 Stellantis NV 503.0000 Stellantis NV 503.0000 Stellantis NV 503.0000 Volkswagen International Finance NV <sup>(d)</sup> 503.0000 Wintershall Dea Finance BV 503.0000 Whore Shall Dea Finance BV 503.0000 WPC Eurobond BV 503.0000 Bonos internacionales del Estado de Perú 503.0000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía 603.0000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía 603.0000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía 603.0000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2912 603.0000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 603.700.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 603.700.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 603.700.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 603.700.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 603.700.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 603.700.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 603.700.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 603.700.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 603.700.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 603.700.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 603.700.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 603.700.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 603.700.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 603.700.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 603.700.					
200.000   Mexico City Airport Trust 144A(c)   U   200.000   Bonos internacionales del Estado de México   U   U   Securitiva SE.   E   E   E   E   E   E   E   E   E	MXN	5,750 %	05/03/2026	54.312	0,0
Países Bajos   200.000   ABN AMRO Bank NV(d)   E	MXN	10,000 %	20/11/2036	122.651	0,1
Países Bajos         200.000 ABN AMRO Bank NV (d)         EI           325.000 ABN AMRO Bank NV 144A(e)         U           100.000 Airbus S.E.         E           100.000 ING Groep NV(d)         EI           200.000 ING Groep NV(d)         U           200.000 ING Groep NV(d)         U           200.000 JAB Holdings BV         EI           200.000 Lukoli Securities BV         U           200.000 Prosus NV         U           300.000 Stellantis NV         E           100.000 Volkswagen International Finance NV(d)         E           100.000 Volkswagen International Finance NV(d)         E           300.000 WPC Eurobond BV         E           250.000 WPC Eurobond BV         E           150.000 WPC Eurobond BV         E           210.000 Bonos internacionales del Estado de Perú         U           Portugal         U           240.000 Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 144A(e)         E           Catar         210.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía         E           230.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía         E           230.000 Bonos del Tesoro de Corea indexados a la inflación – Serie 2606         Kf           1,177.260.00 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2912         Kf           1,177	USD	5,500 %	31/10/2046	193.540	0,16
200.000	USD	3,750 %	19/04/2071	175.104	0,14
200.000				545.607	0,44
325.000	EUR	4,375 %	Perp.	239.611	0,19
100.000   Airbus S.E.	USD	4,750 %	28/07/2025	356.779	0,1
100.000   Cooperatieve Rabobank UA   E   200.000   ING Groep NV <sup>(d)</sup>   E   200.000   ING Groep NV <sup>(d)</sup>   U   100.000   JAB Holdings BV   E   200.000   Lukoil Securities BV   U   200.000   Prosus NV   U   300.000   Stellantis NV   E   125.000   Stellantis NV   E   100.000   Volkswagen International Finance NV <sup>(d)</sup>   E   100.000   WPC Eurobond BV   E   250.000   WPC Eurobond BV   E   250.000   WPC Eurobond BV   E   200.000   Bonos internacionales del Estado de Perú   U   Portugal   240.000   Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 144A <sup>(c)</sup>   E   Catar   210.000   Qatar Energy   U   Rumanía   70.000   Bonos internacionales del Estado de Rumanía   E   230.000   Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6212   R   Corea del Sur   302.290.000   Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2906   Kf   620.700.000   Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912   Kf   745.420.000   Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912   Kf   745.420.000   Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912   Kf   745.420.000   Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912   Kf   745.420.000   Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912   Kf   745.420.000   Bonos Santander S.A.   U   400.000   Banco Santander S.A.   U   400.000   400.000   400.000   400.000   400.000   400.000   400.000   400.000   400.000   400.000   400.000   400.000   400.000   400.000   400.000   400.000   400.000   400.000   400.000   400.000   4	EUR	2,375 %	09/06/2040	128.799	0,1
200.000   ING Groep NV(d)	EUR	3,875 %	25/07/2023	121.588	0,10
200.000   ING Groep NV(d)	EUR	1,099 %	16/11/2032	225.527	0,18
100.000	USD	6,750 %	Perp.	215.500	0,1
200.000	EUR	1,000 %	20/12/2027	115.985	0,09
200.000   Prosus NV   300.000   Stellantis NV   E	USD	3,875 %	06/05/2030	205.150	0,1
300.000   Stellantis NV	USD	3,680 %	21/01/2030	204.093	0,10
125.000   Stellantis NV	EUR	3,875 %	05/01/2026	385.861	0,3
100.000 Volkswagen International Finance NV <sup>(d)</sup> 100.000 Volkswagen International Finance NV <sup>(d)</sup> 300.000 Wintershall Dea Finance BV 250.000 WPC Eurobond BV  150.000 WPC Eurobond BV  E  Perú  20.000 Bonos internacionales del Estado de Perú  UPortugal 240.000 Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 144A <sup>(c)</sup> E  Catar 210.000 Qatar Energy  U  Rumanía 70.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía 230.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía E  Rusia 4.470.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6212  R  Corea del Sur 302.290.000 Bonos del Tesoro de Corea indexados a la inflación - Serie 2606 620.700.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2906 KF 620.700.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912 KF 745.420.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912 KF 745.420.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 3106  España 200.000 Banco Santander S.A. 400.000 Banco Santander S.A.	EUR	4,500 %	07/07/2028	173.839	0,14
100.000 Volkswagen International Finance NV <sup>(d)</sup> 300.000 Wintershall Dea Finance BV 250.000 WPC Eurobond BV 150.000 WPC Eurobond BV  E  Perú 20.000 Bonos internacionales del Estado de Perú  20.000 Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 144A <sup>(c)</sup> E  Catar 210.000 Qatar Energy  U  Rumanía 70.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía E 230.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía E  Rusia 4.470.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6212  R  Corea del Sur 302.290.000 Bonos del Tesoro de Corea indexados a la inflación - Serie 2606 620.700.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2906  Kf 620.700.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kf 745.420.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kf F 545.420.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kf 620.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kf 620.700.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kf 620.700.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kf 620.700.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kf 620.700.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kf 620.700.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kf 620.700.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kf 620.700.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kf 620.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kf 620.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kf 620.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kf 620.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kf 620.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kf 620.0000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kf 620.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kf 620.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kf 620.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912  Kf 620.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912	EUR	3,500 %	Perp.	121.257	0,10
300.000   Wintershall Dea Finance BV   E	EUR	4,625 %	Perp.	128.858	0,10
250.000 WPC Eurobond BV E 150.000 WPC Eurobond BV E  Perú 20.000 Bonos internacionales del Estado de Perú 20.000 Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 144A <sup>(c)</sup> E  Catar 210.000 Qatar Energy U  Rumanía 70.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía E 230.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía E  Rusia 4.470.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ – Serie 6212 R  Corea del Sur 302.290.000 Bonos del Tesoro de Corea indexados a la inflación – Serie 2606 KF 620.700.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 KF 1.177.260.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2912 KF 745.420.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 3106 KF  España 200.000 Banco Santander S.A. 400.000 Banco Santander S.A. 400.000 Banco Santander S.A. 400.000 Banco Santander S.A. 400.000 Banco Santander S.A.	EUR	1,332 %	25/09/2028	350.138	0,28
Perú 20.000 Bonos internacionales del Estado de Perú 20.000 Portugal 240.000 Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 144A <sup>(c)</sup> E  Catar 210.000 Qatar Energy U  Rumanía 70.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía 230.000 Bonos internacionales del Estado de Rumanía E  Rusia 4.470.000 Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6212 R  Corea del Sur 302.290.000 Bonos del Tesoro de Corea indexados a la inflación - Serie 2606 KF 620.700.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2906 KF 1.177.260.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912 KF 745.420.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912 KF F 545.420.000 Bonos del Tesoro de Corea - Serie 3106 KF  España 200.000 Banco Santander S.A. 400.000 Banco Santander S.A. U 400.000 Banco Santander S.A. U 100.000 Banco Santander S.A.	EUR	1,350 %	15/04/2028	290.317	0,23
20.000   Bonos internacionales del Estado de Perú   U	EUR	0,950 %	01/06/2030	166.815	0,14
20.000   Bonos internacionales del Estado de Perú   U				3.430.117	2,75
Portugal	USD	3,230 %	28/07/2121	16.479	0,01
Catar           210.000         Qatar Energy         U           Rumanía           70.000         Bonos internacionales del Estado de Rumanía         E           230.000         Bonos internacionales del Estado de Rumanía         E           Rusia           4.470.000         Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6212         R           Corea del Sur           302.290.000         Bonos del Tesoro de Corea indexados a la inflación - Serie 2606         KF           620.700.000         Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2906         KF           1.177.260.000         Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912         KF           745.420.000         Bonos del Tesoro de Corea - Serie 3106         KF           España           200.000         Banco Santander S.A.         U           400.000         Banco Santander S.A.         U           100.000         Banco Santander S.A.         G					-,-
210.000   Qatar Energy   U	EUR	1,950 %	15/06/2029	313.023	0,25
Rumanía	USD	3,125 %	12/07/2041	210.945	0,17
70.000         Bonos internacionales del Estado de Rumanía         E           230.000         Bonos internacionales del Estado de Rumanía         E           Rusia           4.470.000         Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6212         R           Corea del Sur           302.290.000         Bonos del Tesoro de Corea indexados a la inflación - Serie 2606         Kf           620.700.000         Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2906         Kf           1.177.260.000         Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912         Kf           745.420.000         Bonos del Tesoro de Corea - Serie 3106         Kf           España           200.000         Banco Santander S.A.         U           400.000         Banco Santander S.A.         U           100.000         Banco Santander S.A.         G	000	3,123 /0	12/01/2041	210.545	0,17
Rusia	EUR	2.124 %	16/07/2031	76.364	0,0
4.470.000       Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6212       R         Corea del Sur         302.290.000       Bonos del Tesoro de Corea indexados a la inflación - Serie 2606       KF         620.700.000       Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2906       KF         1.177.260.000       Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912       KF         745.420.000       Bonos del Tesoro de Corea - Serie 3106       KF         España         200.000       Banco Santander S.A.       U         400.000       Banco Santander S.A.       U         100.000       Banco Santander S.A.       G	EUR	2,000 %	14/04/2033	238.479	0,19
4.470.000       Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6212       R         Corea del Sur         302.290.000       Bonos del Tesoro de Corea indexados a la inflación - Serie 2606       KF         620.700.000       Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2906       KF         1.177.260.000       Bonos del Tesoro de Corea - Serie 2912       KF         745.420.000       Bonos del Tesoro de Corea - Serie 3106       KF         España         200.000       Banco Santander S.A.       U         400.000       Banco Santander S.A.       U         100.000       Banco Santander S.A.       G				314.843	0,25
Corea del Sur           302.290.000         Bonos del Tesoro de Corea indexados a la inflación – Serie 2606         KF           620.700.000         Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906         KF           1.177.260.000         Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2912         KF           745.420.000         Bonos del Tesoro de Corea – Serie 3106         KF           España           200.000         Banco Santander S.A.         U           400.000         Banco Santander S.A.         U           100.000         Banco Santander S.A.         G	DUD	7.050.0/	40/04/0000	50,400	0.00
302.290.000       Bonos del Tesoro de Corea indexados a la inflación – Serie 2606       KF         620.700.000       Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906       KF         1.177.260.000       Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2912       KF         745.420.000       Bonos del Tesoro de Corea – Serie 3106       KF             España       200.000       Banco Santander S.A.       U         400.000       Banco Santander S.A.       U         100.000       Banco Santander S.A.       G	RUB	7,050 %	19/01/2028	56.462	0,0
620.700.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906 KF 1.177.260.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2912 KF 745.420.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 3106 KF  España  200.000 Banco Santander S.A. U 400.000 Banco Santander S.A. U 100.000 Banco Santander S.A. G	KRW	1,000 %	10/06/2026	282.794	0,23
1.177.260.000       Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2912       KF         745.420.000       Bonos del Tesoro de Corea – Serie 3106       KF             España       200.000       Banco Santander S.A.       U         400.000       Banco Santander S.A.       U         100.000       Banco Santander S.A.       G	KRW	1,875 %	10/06/2029	516.813	0,4
745.420.000 Bonos del Tesoro de Corea – Serie 3106 KF  España  200.000 Banco Santander S.A. U 400.000 Banco Santander S.A. U 100.000 Banco Santander S.A. G	KRW	1,375 %	10/12/2029	938.230	0,7
España           200.000         Banco Santander S.A.         U           400.000         Banco Santander S.A.         U           100.000         Banco Santander S.A.         G	KRW	2.000 %	10/06/2031	622.477	0,50
200.000         Banco Santander S.A.         U           400.000         Banco Santander S.A.         U           100.000         Banco Santander S.A. (d)         G				2.360.314	1,89
200.000         Banco Santander S.A.         U           400.000         Banco Santander S.A.         U           100.000         Banco Santander S.A. (d)         G					.,0
400.000 Banco Santander S.A. U 100.000 Banco Santander S.A. G	USD	2,706 %	27/06/2024	207.832	0,1
100.000 Banco Santander S.A. <sup>(d)</sup>	USD	2,749 %	03/12/2030	391.748	0,3
	GBP	2,250 %	04/10/2032	131.697	0,1
	EUR	0,375 %	18/11/2026	226.241	0,1
300.000 Cellnex Finance Co., S.A.	EUR	1,500 %	08/06/2028	336.021	0,2
	EUR	1,250 %	15/01/2029	327.742	0,20
	EUR	2,000 %	15/02/2033	108.718	0,09
·	EUR	2,629 %	08/06/2027	188.408	0,15

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos – (cont	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					
España – (cont	Iberdrola Finanzas S.A. <sup>(d)</sup>	EUR	1,575 %	Perp.	113.358	0,09
	Bonos del Estado de España 144A <sup>(c)</sup>	EUR	5,900 %	30/07/2026	191.189	0,09
	Bonos del Estado de España 144A(c)	EUR	1,500 %	30/04/2027	1.007.641	0,13
	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	EUR	0,100 %	30/04/2021	803.277	0,61
	Bonos del Estado de España 144A(c)					
	Bonos del Estado de España 144A(c)	EUR	5,150 %	31/10/2044	339.438	0,27
	Bonos del Estado de España 144A <sup>(c)</sup>	EUR	3,450 %	30/07/2066	327.111	0,26
2/5.000	Telefonica Emisiones S.A.	USD	4,103 %	08/03/2027	5.004.843	0,25 4,01
Supranacional	es				5.004.643	4,01
•	African Export-Import Bank	USD	2,634 %	17/05/2026	200.612	0,16
	African Export-Import Bank	USD	3,798 %	17/05/2031	203.238	0,16
	Banco Europeo de Inversiones	EUR	0,125 %	20/06/2029	628.799	0,50
	Banco Europeo de Inversiones	EUR	0,200 %	17/03/2036	453.839	0,36
	Banco Europeo de Inversiones	EUR	1,000 %	14/11/2042	208.942	0,17
	Unión Europea	EUR	(0,449 %)	06/07/2026	499.976	0,17
	Unión Europea	EUR	(0,449 %)	04/10/2028	104.387	0,40
	•	EUR				0,06
	Unión Europea		(0,061 %)	04/07/2031	68.713	
	Unión Europea	EUR	0,200 %	04/06/2036	296.205	0,24
	Unión Europea	EUR	0,400 %	04/02/2037	129.258	0,10
760.000	Banco Interamericano de Desarrollo	USD	7,000 %	15/06/2025	918.027	0,74
01-					3.711.996	2,97
Suecia 100.000	Heimstaden Bostad AB	EUR	1,125 %	21/01/2026	116.088	0,09
Suiza						
200.000	Credit Suisse Group AG <sup>(d)</sup>	EUR	0,650 %	14/01/2028	225.422	0,18
650.000	Credit Suisse Group AG 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	2,593 %	11/09/2025	666.867	0,54
375.000	UBS Group AG <sup>(d)</sup>	EUR	0,250 %	03/11/2026	425.478	0,34
					1.317.767	1,06
Tailandia	Panas dal Estado do Tailandia	TUD	3,650 %	17/12/2021	433.235	0.25
	Bonos del Estado de Tailandia	THB		17/12/2021		0,35
	Bonos del Estado de Tailandia	THB	1,875 %	17/06/2022	282.786	0,23
	Bonos del Estado de Tailandia	THB	2,400 %	17/12/2023	549.865	0,44
	Bonos del Estado de Tailandia	THB	1,600 %	17/12/2029	262.911	0,21
2.540.000	Bonos del Estado de Tailandia	THB	1,585 %	17/12/2035	1.597.908	0,05 1,28
Emiratos Árabe	es Unidos				1.597.906	1,20
	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC	USD	4.600 %	02/11/2047	339.300	0,27
	DP World Plc.	USD	5,625 %	25/09/2048	244.750	0,20
					584.050	0,47
Reino Unido						
	Barclays Plc. <sup>(d)</sup>	USD	4,610 %	15/02/2023	201.610	0,16
	Barclays Plc. <sup>(d)</sup>	USD	2,279 %	24/11/2027	200.762	0,16
250.000	Barclays Plc. (d)	GBP	3,750 %	22/11/2030	352.711	0,28
100.000	BAT International Finance Plc.	GBP	2,250 %	26/06/2028	132.121	0,11
25.000	BP Capital Markets Plc.	USD	3,814 %	10/02/2024	26.493	0,02
100.000	BP Capital Markets Plc. (d)	EUR	3,250 %	Perp.	120.193	0,10
	BP Capital Markets Plc.(d)	EUR	3,625 %	Perp.	122.154	0,10
	HSBC Holdings Plc.	USD	4,375 %	23/11/2026	301.334	0,24
	HSBC Holdings Plc.	USD	4,950 %	31/03/2030	294.070	0,24
	Legal & General Group Plc.(d)	GBP	3,750 %	26/11/2049	140.313	0,11
	Lloyds Banking Group Plc.	USD	3,750 %	11/01/2027	298.424	0,11
	M&G Plc. <sup>(d)</sup>	GBP	6,340 %	19/12/2063	171.730	0,14
	Nationwide Building Society 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,960 %	18/07/2030	442.996	0,14
	Natwest Group Plc.(d)	USD	3,754 %	01/11/2029	263.125	0,33
	NatWest Group Pic.(d)	USD	3,498 %	15/05/2023	202.480	0,16
	NatWest Group Pic.(d)	EUR	1,043 %	14/09/2032	139.468	0,10
	Pension Insurance Corp., Plc.	GBP	4,625 %	07/05/2031	148.280	0,11
	Phoenix Group Holdings Plc.	GBP	5,625 %	28/04/2031	158.473	0,12
	Pinewood Finance Co., Ltd.	GBP	3,250 %	30/09/2025	168.079	0,13
	Santander UK Group Holdings Plc. (d)	USD				0,13
			1,089 %	15/03/2025	397.204	
700.000	Standard Chartered Plc. 144A(c)(d)	USD	1,456 %	14/01/2027	680.785	0,54
200.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc.	GBP	1,875 %	02/11/2028	267.770	0,21
200.000 220.000	Bonos del Estado del Reino Unido (gilts) Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP GBP GBP	4,250 % 3,250 %	07/03/2036 22/01/2044	425.513 1.094.323	0,21 0,34 0,88

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos – (con	rtinuación) (continuación)					
	Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	3,500 %	22/01/2045	61.500	0,05
	Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	1,500 %	31/07/2053	364.897	0,29
	Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	1,750 %	22/07/2057	69.774	0,06
	Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	3,500 %	22/07/2068	401.930	0,32
	Virgin Money UK Plc. (d)	EUR	0,375 %	27/05/2024		0,14
	Virgin Money UK Plc. <sup>(d)</sup>	GBP	5,125 %	11/12/2030	145.135	0,12
					7.965.180	6,38
Estados Unido 50.000	os AbbVie, Inc.	USD	3,750 %	14/11/2023	52.640	0,04
	AbbVie, Inc.	USD	2,600 %	21/11/2024	181.696	0,15
	Air Lease Corp.	USD	3,875 %	03/07/2023	365.004	0,29
	Air Lease Corp.	USD	3,250 %	01/03/2025	130.524	0,10
	Air Lease Corp.	USD	2,875 %	15/01/2026	309.045	0,25
	Ameren Corp.	USD	2,500 %	15/09/2024	25.831	0,02
	American Homes 4 Rent LP	USD	4,250 %	15/02/2028	223.200	0,18
	AT&T, Inc.	EUR	1,800 %	14/09/2039	115.747	0,09
	AT&T, Inc.	USD	4,500 %	09/03/2048	118.317	0,09
	AT&T, Inc.	USD	3,650 %	01/06/2051	312.621	0,25
	Bank of America Corp. (d)	USD	3,366 %	23/01/2026	158.733	0,13
	Becton Dickinson and Co.	USD	3,363 %	06/06/2024		0,09
	Boeing Co.	USD	5,150 %	01/05/2030	116.312	0,09
	Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications		.,			
425.000	Operating Capital Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications	USD	4,500 %	01/02/2024	213.442	0,17
150.000	Operating Capital Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications	USD	4,908 %	23/07/2025	470.173	0,38
	Operating Capital	USD	4,800 %	01/03/2050	170.031	0,14
300.000	Citigroup, Inc. <sup>(d)</sup>	USD	0,776 %	30/10/2024	298.686	0,24
200.000	Citigroup, Inc.(d)	USD	3.106 %	08/04/2026	210.130	0,17
	Cleco Corporate Holdings LLC	USD	3,743 %	01/05/2026	214.942	0,17
	Comcast Corp.	USD	3,700 %	15/04/2024		0,13
	Comcast Corp.	USD	3,950 %	15/10/2025	109.285	0,09
	Constellation Brands, Inc.	USD	3,200 %	15/02/2023	51.378	0,04
	Constellation Brands, Inc.	USD	4,400 %	15/11/2025	82.844	0,07
	Constellation Brands, Inc.	USD	2,875 %	01/05/2030		0,31
	Crown Castle International Corp.	USD	3,650 %	01/09/2027		0,17
	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	6,020 %	15/06/2026		0,38
	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	4,900 %	01/10/2026		0,09
	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	5,300 %	01/10/2029	148.989	0,12
	Devon Energy Corp.	USD	5,850 %	15/12/2025		0,02
	Diamondback Energy, Inc.	USD	4,750 %	31/05/2025		0,18
	Dollar Tree, Inc.	USD	4,000 %	15/05/2025		0,07
	Energy Transfer LP	USD	5,300 %	01/04/2044		0,02
	Energy Transfer Operating LP	USD	5,250 %	15/04/2029		0,02
	Enterprise Products Operating LLC	USD	3,750 %	15/02/2025	294.522	0,02
	Expedia Group, Inc.	USD	3,250 %	15/02/2030		0,12
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	6,750 %	15/03/2031	578.924	0,46
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	6,625 %	15/11/2030	427.473	0,40
	General Motors Co.	USD	5,400 %	02/10/2023		0,09
	General Motors Financial Co., Inc.	USD	1,500 %	10/06/2026		0,09
	•			02/10/2023		
	Hewlett Packard Enterprise Co.	USD	4,450 %			0,09
	Hewlett Packard Enterprise Co.	USD USD	4,900 % 6.350 %	15/10/2025		0,40
	Hewlett Packard Enterprise Co.		6,350 %	15/10/2045		0,05
	Marathon Petroleum Corp.	USD	3,800 %	01/04/2028	108.295	0,09
	Marriott International, Inc.	USD	3,750 %	01/10/2025	214.104	0,17
	Moody's Corp.	USD	3,100 %	29/11/2061	131.273	0,11
	Morgan Stanley <sup>(d)</sup>	USD	2,484 %	16/09/2036	217.073	0,17
	MPLX LP	USD	4,125 %	01/03/2027	218.318	0,18
25.000	MPLX LP	USD	4,500 %	15/04/2038	27.991	0,02
25.000	MPLX LP	USD	5,500 %	15/02/2049	31.741	0,03
50.000	Occidental Petroleum Corp.	USD	5,550 %	15/03/2026	54.500	0,04
100.000	Otis Worldwide Corp.	USD	2,565 %	15/02/2030	102.006	0,08
	Pacific Gas and Electric Co.	USD	2,500 %	01/02/2031	24.005	0,02
	Pioneer Natural Resources Co.	USD	1,125 %	15/01/2026		0,02
	PNC Financial Services Group, Inc.	USD	3,500 %	23/01/2024		0,08
	Realty Income Corp.	USD	4,625 %	01/11/2025	167.303	0,00
	Sabine Pass Liquefaction LLC	USD				
	·		5,625 %	01/03/2025		0,16
	Sabine Pass Liquefaction LLC	USD	5,875 %	30/06/2026		0,16
75.000	Steel Dynamics, Inc.	USD	1,650 % 3,500 %	15/10/2027		0,06 0,02
	T-Mobile USA, Inc.	USD		15/04/2025		

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Valor Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	r de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
	s – (continuación)					
	T-Mobile USA, Inc.	USD	3,750 %	15/04/2027	512.620	0,41
	Valero Energy Partners LP	USD USD	4,375 %	15/12/2026	222.240 374.015	0,18
	Verizon Communications, Inc. Walgreens Boots Alliance, Inc.	GBP	4,329 % 3,600 %	21/09/2028 20/11/2025	502.474	0,30 0,40
	Wells Fargo & Co. <sup>(d)</sup>	USD	2,188 %	30/04/2026	281.330	0,40
	Williams Cos., Inc.	USD	3,900 %	15/01/2025	80.352	0,06
	WP Carey, Inc.	USD	4,000 %	01/02/2025	214.868	0,17
	,		<u> </u>		12.519.394	10,03
TOTAL DE BON					87.564.819	70,12
				Valor	de mercado	% de
Tenencias	Descripción del valor				en USD	patrimonio
Irlanda	versión – 0,07 %		(e)(f)		00.400	0.07
	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de NDOS DE INVERSIÓN	le distribucion X	(0)(1)		82.403	0,07
(coste USD 82.					82.403	0,07
TOTAL DE VAL (coste USD 85.	ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE V 988.391)	ALORES OFIC	AL		87.647.222	70,19
					Valor de	0/ 1
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo interés	<sup>(a)</sup> Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - 4,52	liarios negociados en otro mercado regulado %					
Australia	Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	2,950	% 22/07/2030	206.176	0,16
	Commonwealth Bank of Australia 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,610			0,10
	Macquarie Bank Ltd. 144A(c)(d)	USD	3,052			0,24
000.000	The second secon	002		70 00,00,2000	713.647	0,5
Islas Caimán						
25.000	Avolon Holdings Funding Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,950	% 01/07/2024	26.278	0,0
200.000	Avolon Holdings Funding Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250	% 15/04/2026	213.876	0,1
					240.154	0,19
Francia						
	BNP Paribas S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,375			0,2
	BNP Paribas S.A. 144A(c)(d)	USD	2,219			0,2
	BNP Paribas S.A. 144A <sup>(c)</sup> (d)	USD	4,375			0,18
	BPCE S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000			0,4:
550.000	Société Générale S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,488	% 14/12/2026 	1.853.434	1,4
Países Bajos					1.055.454	1,43
	Syngenta Finance NV 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,441	% 24/04/2023	207.762	0,1
	Syngenta Finance NV 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,892			0,1
	3, 3, 1, 1, 1, 1, 1, 1, 1, 1, 1, 1, 1, 1, 1,				424.882	0,34
Estados Unido	os .					
300.000	Aviation Capital Group LLC 144A(c)	USD	1,950	% 30/01/2026	296.217	0,2
290.000	Broadcom, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,137	% 15/11/2035	287.216	0,23
	Duquesne Light Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	2,532			0,0
	Glencore Funding LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625			0,2
	Hyundai Capital America 144A <sup>(c)</sup>	USD	1,650			0,3
	Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(c)(d)</sup>	IDR				0,1
	International Flavors & Fragrances, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	1,230			0,0
	International Flavors & Fragrances, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	1,832			0,0
	Penske Truck Leasing Co., LP Via PTL Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,400			0,1
350.000	State of Illinois	USD	6,725	% 01/04/2035	2.413.288	0,35
TOTAL DE BO	NOS				2.413.200	1,93

September   Comparison   Comp	Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
1.486   Feberar Home Leam Mortgage Coop, (FHLMC)	-		<b>'</b> %				
1.486   Federal Home Leam Mortgage Corp. (FHAMC)	3.710	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5.000 %	01/01/2033	4.090	0.00
372 Federal Home Leam Mortgage Corp. (FHLMC) 470 Federal Home Leam Mortgage Corp. (FHLMC) 470 Federal Home Leam Mortgage Corp. (FHLMC) 470 Federal Home Leam Mortgage Corp. (FHLMC) 480 Federal Home Leam Mortgage Corp. (FHLMC) 481 Federal Home Leam Mortgage Corp. (FHLMC) 482 Federal Home Leam Mortgage Corp. (FHLMC) 483 Federal Home Leam Mortgage Corp. (FHLMC) 483 Federal Home Leam Mortgage Corp. (FHLMC) 485 Federal Home Leam Mortgage Corp. (FHLMC) 486 Federal Home Leam Mortgage Corp. (FHLMC) 487 Federal Home Leam Mortgage Corp. (FHLMC) 488 Federal Home Leam Mortgage Corp. (FHLMC) 488 Federal Home Leam Mortgage Corp. (FHLMC) 489 Federal Home Leam Mortgage Corp. (FHLMC) 480 Federal Home Leam			USD	5,000 %	01/04/2033	1.642	
4.799 Federat Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 4.818 Fotors Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 5.516 Fotors Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 5.516 Fotors Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 5.516 Fotors Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 5.517 Fotors Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 5.518 Fotors Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 5.518 Fotors Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 5.519 Fotors Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 5.510 Fotors Home Loa	117	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/05/2033	130	0,00
### 448 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) ### 1515 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) ### 1516 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLM	372	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/06/2033	417	0,00
515   Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	4.790	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)		5,000 %	01/07/2033	5.444	
1.334 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)							
168   Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)							
311 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  932 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  933 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  934 Sederal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  935 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  936 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  937 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  938 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  938 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  939 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  940 Sederal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  950 Sederal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  951 Sederal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  952 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  953 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  954 Sederal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  955 Sederal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  955 Sederal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  956 Sederal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  957 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  958 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  959 Sederal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  950 Sederal Horne Loam Mo							
992 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 905 5,000 % 011102033 1-29 0,00 93.338 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 937 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 938 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 938 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 939 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 930 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 931 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 932 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 933 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 934 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 935 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 936 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 937 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 938 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 939 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 930 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 931 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 932 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 933 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 934 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 935 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 936 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 937 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 938 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 939 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 930 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 930 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 931 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 932 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 932 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 933 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 934 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 935 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 936 Federal Horne Loam Mortgage C							
666 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  13.338 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  13.00 5,000 % 0111/2033 3.673 0.00  14.40 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  13.00 5,000 % 0110/2034 1.117 0.00  58.7 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  13.7 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  13.8 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  13.9 Federal Horne Loam Mortgage Corp. (FHLMC)  13.0							
3.33 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  93 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  93 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  94 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  95 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  95 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  96 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  97 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  98 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  99 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  90 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  91 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  91 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  92 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  93 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  94 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  95 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  95 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  95 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  96 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  97 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  97 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  98 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  99 Federal Horne Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  99 Federal Horne Loa							
1.449   Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)   USD   5,000 %   0101/22034   1.117   0.00							
S57   Federal Home Loam Mortgage Cop. (FHLMC)			USD		01/12/2033		
3.737 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  722 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  723 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  724 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  725 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  726 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  727 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  728 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  729 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  730 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  730 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  731 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  732 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  733 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  734 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  735 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  735 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  736 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  737 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  737 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  738 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  739 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  730 Federal Home Loa	983	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/01/2034	1.117	0,00
792 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  137 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  138 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  139 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  130 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  130 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  131 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  132 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  133 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  134 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  135 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  136 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  137 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  138 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  139 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  130 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  131 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  132 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  133 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  134 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  135 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  136 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  137 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  137 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  138 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  139 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  130 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  130 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  131 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  132 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  133 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  134 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  135 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  136 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  137 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  138 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  139 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  130 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  130 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  131 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  132 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  133 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  134 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  135 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  136 Federal Home Loan	557	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/01/2034	634	0,00
237 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)							
13   Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)   USD   5,000 %   01/03/2034   450   0,00							
398 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)							
498   Federal Home Loam Mortgage Corp. (FHLMC)   USD   5,000 %   01/03/2034   1,006   0,00							
880 Federal Home Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 886 Federal Home Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 987 Federal Home Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 988 Federal Home Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 989 5,000 % 0104/2034 289 0,00 981 Federal Home Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 980 5,000 % 0104/2034 387 0,00 982 Federal Home Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 980 5,000 % 0104/2034 387 0,00 981 Federal Home Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 980 5,000 % 0104/2034 387 0,00 981 Federal Home Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 980 5,000 % 0104/2034 5,679 0,01 981 5,000 % 0104/2034 5,679 0,01 982 Federal Home Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 980 5,000 % 0106/2034 5,679 0,01 982 Federal Home Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 980 5,000 % 0106/2034 5,679 0,01 980 7,102 Federal Home Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 980 5,000 % 0106/2034 2,184 0,00 980 7,103 Federal Home Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 980 5,000 % 0106/2034 2,184 0,00 980 1,103 Federal Home Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 980 5,000 % 0106/2034 2,184 0,00 980 1,103 Federal Home Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 980 5,000 % 0104/2035 2,2377 0,02 981 Federal Home Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 980 5,000 % 0104/2035 2,2377 0,02 981 Federal Home Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 980 5,000 % 0104/2035 2,2377 0,02 981 Federal Home Loam Mortgage Corp. (FHLMC) 980 5,000 % 0104/2035 2,337 1,002 981 6,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000 % 0104/2035 1,000							
886 Federal Home Loam Mortgage Corp. (FHLMC)							
241 Federal Home Loam Mortgage Corp. (FHLMC)							
1.155   Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)							
2.83   Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)							
2.830 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 5.162 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 5.162 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 5.00 \$ 0.00% 0.10862034 \$ 8.167 0.01 7.172 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 5.00 \$ 0.00% 0.10862034 2.184 0.00 73.005 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 5.00 \$ 0.00% 0.10862034 2.184 0.00 73.005 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 5.00 \$ 0.00% 0.10862034 2.184 0.00 73.005 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 5.00 \$ 0.00% 0.10862034 2.184 0.00 73.005 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 5.00 \$ 0.00% 0.1182034 1.772 0.00 73.005 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 5.00 \$ 0.00% 0.10862034 2.184 0.00 73.005 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 5.00 \$ 0.00% 0.10862035 0.10862034 1.833 0.00 73.005 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 74.000 \$ 0.00% 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.10862035 0.108							
7.172         Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)         USD         5,000 %         01/06/2034         8,167         0,01           73.005         Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)         USD         5,000 %         01/06/2034         82,990         0,07           1.585         Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)         USD         5,000 %         01/11/2034         1,272         0,00           1.970         Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)         USD         5,000 %         01/04/2035         22,377         0,02           438         Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)         USD         5,000 %         01/04/2035         22,377         0,02           1.683         Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)         USD         5,000 %         01/02/2037         1,833         0,00           1.69.75         Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)         USD         4,000 %         01/02/2041         1,388         0,01           1.20.75         Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)         USD         4,000 %         01/02/2041         9,445         0,01           8.10.73         Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)         USD         4,000 %         25/06/2050         18.067         0,08           281.063         Federal Mortgage C							
1921   Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	5.162	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/05/2034	5.679	0,01
73.005 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 1.585 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 1.595 Federal No.00% 1.5125 Federal No.00% 1.5126 Federal No.00	7.172	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/06/2034	8.167	0,01
1.588   Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)   USD   5,000 %   01/11/2034   1.772   0.00	1.921	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)		5,000 %	01/06/2034	2.184	
19,709   Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)   USD   5,000 %   01/04/2035   22,377   0,02							
438   Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)							
1.883 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 1.897 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 1.807 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 1.807 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 1.807 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 1.808 4,000 % 01/02/2041 13.889 0.01 1.8173 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 1.809 4,000 % 01/02/2041 9.445 0.01 1.8173 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 1.809 4,000 % 01/02/2041 9.445 0.01 1.8173 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 1.809 3,000 % 25/08/2050 11.8057 0.09 261.063 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 1.809 3,000 % 25/08/2050 32.733 0.03 363.217 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 1.809 4,000 % 25/09/2050 61.21 0.05 331.871 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 1.809 4,000 % 25/09/2050 65.975 0.04 181.4378 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 1.809 4,000 % 25/09/2050 65.975 0.04 181.4378 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 1.809 4,000 % 25/09/2050 65.975 0.04 181.4378 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 1.809 1,700 % 25/01/2034 70.433 0.06 29.135 Federal National Mortgage Association (FNMA) 1.809 1,700 % 25/01/2034 70.433 0.06 29.135 Federal National Mortgage Association (FNMA) 1.809 1,700 % 25/01/2034 70.433 0.06 29.135 Federal National Mortgage Association (FNMA) 1.809 1,800 % 01/05/2039 4.195 0.00 4.631 Federal National Mortgage Association (FNMA) 1.809 4,500 % 01/05/2039 5.137 0.00 4.631 Federal National Mortgage Association (FNMA) 1.809 4,500 % 01/08/2039 5.837 0.01 5.125 Federal National Mortgage Association (FNMA) 1.809 4,500 % 01/08/2039 5.887 0.01 5.125 Federal National Mortgage Association (FNMA) 1.809 7,000 % 25/07/2042 55.557 0.04 1.3744 Federal National Mortgage Association (FNMA) 1.809 7,000 % 25/07/2042 55.557 0.04 1.3745 Federal National Mortgage Association (FNMA) 1.809 7,000 % 01/01/2043 11.342 0.01 1.0309 Federal National Mortgage Association (FNMA) 1.809 0.000 % 01/01/2043 11.342 0.01 1.0309 Federal National Mortgage Association (FNMA) 1.809 0.000 % 01/01/2043 11.080 0.01 1.14189 Federal National Mortga							
18.875   Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)   USD   5,000 %   01/12/2038   124.300   0.10							
12.607 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  8.577 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  8.578 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  8.517 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  8.51.063 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  8.51.063 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)  8.50							
8.573 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 812.173 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 812.173 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 812.173 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 813.187 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 815.231 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 816.331.871 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 817.000 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 818.331.871 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 819.300 % 811.22050 857.857 0.69 814.378 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 819.300 % 811.22050 857.857 0.69 819.300 % 811.22050 857.857 0.69 819.300 % 811.22050 857.857 0.69 819.300 % 811.22050 857.857 0.69 819.300 % 811.22050 857.857 0.69 819.300 % 811.22050 857.857 0.69 819.300 % 811.22050 857.857 0.69 819.300 % 811.22050 857.857 0.69 819.300 % 811.22050 857.857 0.69 819.300 % 811.22050 857.857 0.69 819.300 % 811.22050 857.857 0.69 819.300 % 811.22050 857.857 0.69 819.300 % 811.22050 857.857 0.69 819.300 % 811.22050 857.857 0.69 819.300 % 811.22050 857.857 0.69 819.300 % 811.22050 857.857 0.69 819.300 % 811.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 81.22050 857.857 0.69 819.300 85							
812.173 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 261.063 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 261.063 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 262.317 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 263.31.871 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 263.31.871 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 263.31.871 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 265.09.2050 50.975 0.04 275.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.09.2050 50.975 0.04 285.0950 50.975 0.04 285.0950 50.975 0.04 285.0950 50.975 0.04 285.0950 50.975 0.04 285.0950 50.975 0.04 285.0950 50.975 0.04 285.0950 50.975 0.04 285.0950 50.975 0.04 285.0950 50.975 0.04 285.0950 50.975 0.04 285.0950 50.975 0.04 285.0950 50.975 0.04 285.0950 50.975 0.04 285.0950 50.975 0.04 285.0950 50.975 0.04 285.0950 50.975 0.04 285.0950 50.975 0.04 285.0950 50.975 0.04 285.0950 50.975 0.04 285.0950 50.975 0.04 28							
281.083 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 331.871 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 331.872 Federal Nome Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 331.873 Federal Nome Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 331.873 Federal Nome Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 331.873 Federal National Mortgage Association (FNMA) 33.787 Federal National Mortgage Association (FNMA) 4.631 Federal National Mortgage Association (FNMA) 4.631 Federal National Mortgage Association (FNMA) 4.631 Federal National Mortgage Association (FNMA) 4.500 M 01/05/2039 5.137 0.00 4.631 Federal National Mortgage Association (FNMA) 4.500 M 01/05/2039 5.137 0.00 4.631 Federal National Mortgage Association (FNMA) 4.500 M 01/05/2039 5.687 0.01 5.125 Federal National Mortgage Association (FNMA) 4.500 M 01/06/2039 8.933 0.01 5.125 Federal National Mortgage Association (FNMA) 4.500 M 01/06/2039 8.933 0.01 5.125 Federal National Mortgage Association (FNMA) 4.500 M 01/06/2039 5.687 0.01 6.4545 Federal National Mortgage Association (FNMA) 4.500 M 01/06/2039 5.687 0.02 6.5045 Federal National Mortgage Association (FNMA) 4.500 M 01/06/2039 5.687 0.02 6.5046 Federal National Mortgage Association (FNMA) 4.500 M 01/06/2039 5.687 0.02 6.5046 Federal National Mortgage Association (FNMA) 4.500 M 01/06/2041 5.557 0.04 6.504 Federal National Mortgage Association (FNMA) 4.500 M 01/06/2042 5.557 0.04 6.504 Federal National Mortgage Association (FNMA) 4.500 M 01/06/2043 11.342 6.001 6.504 Federal National Mortgage Association (FNMA) 4.500 M 01/06/2043 11.342 6.001 6.504 Federal National Mortgage Association (FNMA) 4.505 M 01/06/2043 11.080 6.001 6.504 Federal National Mortgage Association (FNMA) 6.505 Federal National Mortgage Association (FNMA) 6.506 M 01/06/2043 11.080 6.001 6.506 Federal National							
331.871 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 814.378 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 814.378 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 815.370 No. 9 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 816.370 No. 9 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 817.000 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 818.370 No. 9 No.							
814.378 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	632.317	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	2,000 %	25/09/2050	61.291	0,05
70.000 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A(c)(d) 29.135 Federal National Mortgage Association (FNMA)(d) 29.135 Federal National Mortgage Association (FNMA) 3.787 Federal National Mortgage Association (FNMA) 4.631 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.049 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.040 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.050 Mortgage Association (FNMA) 8.070 Mortgage Association (FNMA) 8.070 Mortgage Association (FNMA) 8.070 Mortgage Association (FNMA) 8.080 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.090 Mort	331.871	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	25/09/2050	50.975	0,04
29.135   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   2,185 %   01/07/2034   30.749   0.03   3.787   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/05/2039   4.195   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.0			USD	3,000 %	01/12/2050	857.857	0,69
3.787 Federal National Mortgage Association (FNMA) 4.631 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.049 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.049 Federal National Mortgage Association (FNMA) 9.15125 Federal National Mortgage Association (FNMA) 9.15125 Federal National Mortgage Association (FNMA) 9.15126 Federal National Mortgage Association (FNMA) 9.15126 Federal National Mortgage Association (FNMA) 9.15127 Federal National Mortgage Association (FNMA) 9.15128 Federal National Mortgage Association (FNMA) 9.15128 Federal National Mortgage Association (FNMA) 9.15128 Federal National Mortgage Association (FNMA) 9.15129 Federal National Mortgage Associ							
4.631         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/05/2039         5.137         0,00           8.049         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/08/2039         8.933         0,01           5.125         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/08/2039         5.687         0,01           24.495         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         7,000 %         25/07/2042         55.557         0,04           13.744         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         7,000 %         25/10/2042         15.821         0,01           10.630         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/12/2042         11.342         0,01           15.496         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/12/2042         16.535         0,01           20.376         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/01/2043         21.742         0,02           15.543         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/01/2043         16.586         0,01           41.0							
8.049         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/06/2039         8.933         0,01           5.125         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/08/2039         5.687         0,01           24.495         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/08/2039         5.687         0,01           46.548         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         7,000 %         25/07/2042         55.557         0,04           13.744         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         7,000 %         25/10/2042         15.821         0,01           10.630         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/12/2042         11.342         0,01           20.376         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/01/2043         21.742         0,02           15.543         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/01/2043         43.815         0,04           41.062         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/01/2043         43.624         0,02           10.							
5.125         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/08/2039         5.687         0,01           24.495         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/08/2041         26.957         0,02           46.548         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         7,000 %         25/10/2042         55.557         0,04           13.744         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         7,000 %         25/10/2042         15.821         0,01           10.630         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/12/2042         11.342         0,01           15.496         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/01/2043         21.742         0,02           15.543         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/01/2043         16.586         0,01           4.1.062         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/01/2043         25.424         0,02           10.365         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/04/2043         15.177         0,01 <td< td=""><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></td<>							
24.495         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/08/2041         26,957         0,02           46.548         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         7,000 %         25/07/2042         55,557         0,04           13.744         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         7,000 %         25/10/2042         15.821         0,01           10.630         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/12/2042         11.342         0,01           15.496         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/01/2042         16.535         0,01           20.376         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/01/2043         21.742         0,02           15.543         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/01/2043         16.586         0,01           41.062         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/04/2043         25.424         0,02           10.365         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/04/2043         15.177         0,01 <t< td=""><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></t<>							
46.548 Federal National Mortgage Association (FNMA)  13.744 Federal National Mortgage Association (FNMA)  10.630 Federal National Mortgage Association (FNMA)  15.496 Federal National Mortgage Association (FNMA)  10.630 Federal National Mortgage Association (FNMA)  10.630 Federal National Mortgage Association (FNMA)  10.631 Federal National Mortgage Association (FNMA)  10.632 Federal National Mortgage Association (FNMA)  10.633 Federal National Mortgage Association (FNMA)  10.634 Federal National Mortgage Association (FNMA)  10.635 Federal National Mortgage Association (FNMA)  10.64 National Mortgage Association (FNMA)  10.65 Federal National Mortgage Association (FNMA)  10.66 Federal National Mortgage Association (FNMA)  10.67 Federal National Mortgage Association (FNMA)  10.68 Federal National Mortgage Association (FNMA)  10.69 National Mortgage Association (FNMA)  10.60 National Mortgage Association (FNMA)  10.60 National Mortgage Association (FNMA)  10.61 National Mortgage Association (FNMA)  10.62 National Mortgage Association (FNMA)  10.63 National Mortgage Association (FNMA)  10.64 National Mortgage Association (FNMA)  10.65 National Mortgage Association (FNMA)  10.66 National Mortgage Association (FNMA)  10.67 National Mortgage Association (FNMA)  10.68 National Mortgage Association (FNMA)  10.69 National Mortgage Association (FNMA)  10.60 National Mortgage Association (FNMA)							
13.744       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       7,000 %       25/10/2042       15.821       0,01         10.630       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/12/2042       11.342       0,01         15.496       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/10/2043       21.742       0,02         20.376       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/01/2043       21.742       0,02         15.543       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/01/2043       16.586       0,01         41.062       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/01/2043       43.815       0,04         23.784       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/04/2043       25.424       0,02         10.365       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/04/2043       11.080       0,01         43.299       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/04/2043       54.360       0,04         494.329       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %		, ,					
10.630         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/12/2042         11.342         0,01           15.496         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/12/2042         16.535         0,01           20.376         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/01/2043         21.742         0,02           15.543         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/01/2043         16.586         0,01           41.062         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/01/2043         43.815         0,04           23.784         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/04/2043         25.424         0,02           10.365         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/04/2043         11.080         0,01           14.198         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/04/2043         15.177         0,01           50.854         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/04/2043         15.177         0,01 <t< td=""><td></td><td>, ,</td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></t<>		, ,					
20.376   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/01/2043   21.742   0,02     15.543   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/01/2043   16.586   0,01     41.062   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/01/2043   43.815   0,04     23.784   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/04/2043   25.424   0,02     10.365   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/04/2043   11.080   0,01     14.198   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/04/2043   15.177   0,01     50.854   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/04/2043   54.360   0,04     43.299   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/04/2043   46.284   0,04     894.350   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/04/2043   46.284   0,04     894.350   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/01/2048   969.965   0,78     264.088   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   2,500 %   25/03/2048   15.946   0,01     652.046   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   25/06/2048   107.860   0,09     509.017   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   25/09/2050   172.864   0,44     308.210   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   2,000 %   25/09/2050   172.864   0,14     308.210   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   25/09/2050   172.864   0,14     308.210   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   25/09/2050   172.864   0,14     308.210   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   25/09/2050   172.864   0,14     308.210   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   25/09/2050   172.864   0,14     308.210   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   25/09/2050   172.864   0,14     308.210   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,00				3,000 %			
15.543       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/01/2043       16.586       0,01         41.062       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/01/2043       43.815       0,04         23.784       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/04/2043       25.424       0,02         10.365       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/04/2043       11.080       0,01         14.198       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/04/2043       15.177       0,01         50.854       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/04/2043       54.360       0,04         43.299       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/04/2043       46.284       0,04         894.350       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %       01/01/2048       969.955       0,78         264.088       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       2,500 %       25/03/2048       15.946       0,01         652.046       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 % <td>15.496</td> <td>Federal National Mortgage Association (FNMA)</td> <td>USD</td> <td>3,000 %</td> <td>01/12/2042</td> <td>16.535</td> <td>0,01</td>	15.496	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/12/2042	16.535	0,01
41.062       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/01/2043       43.815       0,04         23.784       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/04/2043       25.424       0,02         10.365       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/04/2043       11.080       0,01         14.198       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/04/2043       15.177       0,01         50.854       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/04/2043       54.360       0,04         43.299       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/04/2043       46.284       0,04         894.350       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %       01/01/2048       969.965       0,78         264.088       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       2,500 %       25/03/2048       15.946       0,01         652.046       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %       25/06/2048       107.860       0,09         509.017       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       5,000 % </td <td>20.376</td> <td>Federal National Mortgage Association (FNMA)</td> <td>USD</td> <td>3,000 %</td> <td>01/01/2043</td> <td>21.742</td> <td>0,02</td>	20.376	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/01/2043	21.742	0,02
23.784         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/04/2043         25,424         0,02           10.365         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/04/2043         11,080         0,01           14.198         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/04/2043         15,177         0,01           50.854         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/04/2043         54,360         0,04           43.299         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/04/2043         46,284         0,04           894.350         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/01/2048         969.965         0,78           264.088         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         2,500 %         25/03/2048         15.946         0,01           652.046         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         25/06/2048         107.860         0,09           509.017         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         5,000 %         01/11/2048         567.550         0,45	15.543	Federal National Mortgage Association (FNMA)		3,000 %	01/01/2043	16.586	0,01
10.365         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/04/2043         11.080         0,01           14.198         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/04/2043         15.177         0,01           50.854         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/04/2043         54.360         0,04           43.299         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/04/2043         46.284         0,04           894.350         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/01/2048         969.965         0,78           264.088         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         2,500 %         25/03/2048         15.946         0,01           652.046         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         25/06/2048         107.860         0,09           509.017         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         5,000 %         01/11/2048         567.550         0,45           1.777.285         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         2,000 %         25/09/2050         172.864         0,14							
14.198       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/04/2043       15.177       0,01         50.854       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/04/2043       54.360       0,04         43.299       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/04/2043       46.284       0,04         894.350       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %       01/01/2048       969.965       0,78         264.088       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       2,500 %       25/03/2048       15.946       0,01         652.046       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %       25/06/2048       107.860       0,09         509.017       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       5,000 %       01/11/2048       567.550       0,45         1.777.285       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       2,000 %       25/09/2050       172.864       0,14         308.210       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %       25/09/2050       172.864       0,14         987.372       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       2							
50.854         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/04/2043         54.360         0,04           43.299         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/04/2043         46.284         0,04           894.350         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/01/2048         969.965         0,78           264.088         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         2,500 %         25/03/2048         15.946         0,01           652.046         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         25/06/2048         107.860         0,09           509.017         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         5,000 %         01/11/2048         567.550         0,45           1.777.285         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         2,000 %         25/09/2050         172.864         0,14           308.210         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         25/09/2050         46.744         0,04           987.372         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         2,500 %         01/109/2051         1.022.245         0,82 </td <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>							
43.299       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,000 %       01/04/2043       46.284       0,04         894.350       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %       01/01/2048       969.965       0,78         264.088       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       2,500 %       25/03/2048       15.946       0,01         652.046       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %       25/06/2048       107.860       0,09         509.017       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       5,000 %       01/11/2048       567.550       0,45         1.777.285       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       2,000 %       25/09/2050       172.864       0,14         308.210       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %       25/09/2050       46.744       0,04         987.372       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       2,500 %       01/09/2051       1.022.245       0,82							
894.350       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD 4,000 % 01/01/2048 969.965       0,78         264.088       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD 2,500 % 25/03/2048 15.946       0,01         652.046       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD 4,000 % 25/06/2048 107.860       0,09         509.017       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD 5,000 % 01/11/2048 567.550       0,45         1.777.285       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD 2,000 % 25/09/2050 172.864       0,14         308.210       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD 4,000 % 25/09/2050 46.744       0,04         987.372       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD 2,500 % 01/09/2051 1.022.245       0,82							
264.088       Federal National Mortgage Association (FNMA)(d)       USD       2,500 %       25/03/2048       15.946       0,01         652.046       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %       25/06/2048       107.860       0,09         509.017       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       5,000 %       01/11/2048       567.550       0,45         1.777.285       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       2,000 %       25/09/2050       172.864       0,14         308.210       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %       25/09/2050       46.744       0,04         987.372       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       2,500 %       01/09/2051       1.022.245       0,82							
652.046         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD 4,000 %         25/06/2048 107.860         0,09           509.017         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD 5,000 %         01/11/2048 567.550         0,45           1.777.285         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD 2,000 %         25/09/2050 172.864         0,14           308.210         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD 4,000 %         25/09/2050 46.744         0,04           987.372         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD 2,500 %         01/09/2051 1.022.245         0,82							
509.017         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         5,000 %         01/11/2048         567.550         0,45           1.777.285         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         2,000 %         25/09/2050         172.864         0,14           308.210         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         25/09/2050         46.744         0,04           987.372         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         2,500 %         01/09/2051         1.022.245         0,82		, ,					
1.777.285       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD 2,000 %       25/09/2050       172.864       0,14         308.210       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD 4,000 %       25/09/2050       46.744       0,04         987.372       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD 2,500 %       01/09/2051       1.022.245       0,82							
308.210 Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD 4,000 %         25/09/2050 46.744         0,04           987.372 Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD 2,500 %         01/09/2051 1.022.245         0,82							
		, ,					
1.000.000 Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(g)</sup> USD 3,000 % 13/12/2051 1.039.648 0,83	987.372	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	2,500 %	01/09/2051	1.022.245	0,82
	1.000.000	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(g)</sup>	USD	3,000 %	13/12/2051	1.039.648	0,83

Tenencias	Descripción del valor		Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Obligaciones	con garantía de activos emitidos o gar	antizados por agencias – (c	ontinuación)				
	s – (continuación)	(-)					
	Federal National Mortgage Association (FNN Government National Mortgage Association	*	USD USD	4,500 % 1,875 %	14/01/2052 20/06/2023	1.075.664 261	0,86 0,00
	Government National Mortgage Association		USD	1,625 %	20/07/2023	178	0,00
	Government National Mortgage Association	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	1,625 %	20/08/2023	169	0,00
398	Government National Mortgage Association	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	1,625 %	20/09/2023	400	0,00
	Government National Mortgage Association	4.0	USD	2,000 %	20/03/2024	137	0,00
846 420	Government National Mortgage Association Government National Mortgage Association	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD USD	1,875 % 1,875 %	20/04/2024 20/04/2024	853 424	0,00 0,00
175	Government National Mortgage Association		USD	1,875 %	20/05/2024	177	0,00
381	Government National Mortgage Association		USD	1,875 %	20/06/2024	384	0,00
873	Government National Mortgage Association	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	1,875 %	20/06/2024	881	0,00
306	Government National Mortgage Association		USD	2,000 %	20/06/2024	310	0,00
490 597	Government National Mortgage Association Government National Mortgage Association	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD USD	1,625 % 2,000 %	20/07/2024 20/07/2024	494 605	0,00 0,00
952	Government National Mortgage Association	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	1,625 %	20/08/2024	960	0,00
549	Government National Mortgage Association	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	2,000 %	20/08/2024	556	0,00
181	Government National Mortgage Association	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	1,625 %	20/09/2024	182	0,00
295	Government National Mortgage Association		USD	1,625 %	20/09/2024	298	0,00
507 177	Government National Mortgage Association Government National Mortgage Association	` '	USD USD	2,125 % 2,125 %	20/11/2024 20/12/2024	514 180	0,00 0,00
421	Government National Mortgage Association	4.0	USD	2,500 %	20/12/2024	430	0,00
348	Government National Mortgage Association	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	2,000 %	20/01/2025	354	0,00
216	Government National Mortgage Association		USD	2,000 %	20/02/2025	219	0,00
879	Government National Mortgage Association	4.0	USD	2,000 %	20/05/2025	892	0,00
989 356	Government National Mortgage Association Government National Mortgage Association		USD USD	2,000 % 2,000 %	20/07/2025 20/02/2026	1.004 362	0,00 0,00
22	Government National Mortgage Association	` '	USD	1,625 %	20/07/2026	22	0,00
566	Government National Mortgage Association	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	2,000 %	20/01/2027	577	0,00
363	Government National Mortgage Association	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	2,000 %	20/01/2027	372	0,00
357	Government National Mortgage Association	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	2,000 %	20/02/2027	364	0,00
1.437 1.663	Government National Mortgage Association Government National Mortgage Association	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD USD	1,875 % 1,875 %	20/04/2027 20/04/2027	1.462 1.692	0,00 0,00
319	Government National Mortgage Association	4.0	USD	1,875 %	20/05/2027	324	0,00
517	Government National Mortgage Association	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	1,875 %	20/06/2027	526	0,00
157	Government National Mortgage Association	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	2,125 %	20/11/2027	160	0,00
499	Government National Mortgage Association	4.0	USD	2,125 %	20/12/2027	508	0,00
1.079 419	Government National Mortgage Association Government National Mortgage Association	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD USD	2,000 % 2,000 %	20/01/2028 20/02/2028	1.102 428	0,00 0,00
	Government National Mortgage Association	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	2,000 %	20/03/2028	373	0,00
2.259	Government National Mortgage Association		USD	1,625 %	20/07/2029	2.310	0,00
929	Government National Mortgage Association	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	1,625 %	20/08/2029	950	0,00
237	Government National Mortgage Association		USD	1,625 %	20/09/2029	242	0,00
618 372	Government National Mortgage Association Government National Mortgage Association		USD USD	2,125 % 2,125 %	20/10/2029 20/10/2029	631 380	0,00 0,00
520	Government National Mortgage Association		USD	2,125 %	20/11/2029	533	0,00
910	Government National Mortgage Association	(GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	2,125 %	20/11/2029	930	0,00
220	Government National Mortgage Association		USD	2,125 %	20/12/2029	226	0,00
40	Government National Mortgage Association		USD USD	2,125 % 2,000 %	20/12/2029 20/01/2030	41	0,00 0,00
464 149	Government National Mortgage Association Government National Mortgage Association		USD	2,000 %	20/02/2030	476 153	0,00
	Government National Mortgage Association		USD	2,000 %	20/03/2030	1.156	0,00
234	Government National Mortgage Association		USD	1,875 %	20/04/2030	239	0,00
805	Government National Mortgage Association		USD	1,875 %	20/04/2030	824	0,00
1.517 1.428	Government National Mortgage Association Government National Mortgage Association	` '	USD USD	1,875 % 2,000 %	20/05/2030 20/05/2030	1.553 1.471	0,00 0,00
	Government National Mortgage Association		USD	1,875 %	20/06/2030	382	0,00
	Government National Mortgage Association		USD	2,000 %	20/07/2030	3.114	0,00
683	Government National Mortgage Association		USD	2,000 %	20/09/2030	704	0,00
	Government National Mortgage Association	` '	USD	2,125 %	20/10/2030	1.000	0,00
57.152 312.018	Government National Mortgage Association Government National Mortgage Association	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD USD	6,159 % 6,349 %	20/02/2040 20/07/2043	9.965 55.912	0,01 0,05
	Government National Mortgage Association		USD	5,509 %	20/09/2044	24.075	0,03
	Government National Mortgage Association	, ,	USD	4,000 %	20/01/2045	172.479	0,14
220.748	3.9.	` ,	USD	4,000 %	20/10/2045	25.361	0,02
	Government National Mortgage Association	, ,	USD	4,000 %	20/10/2046	10.135	0,01
	Government National Mortgage Association Government National Mortgage Association		USD USD	4,500 % 5,000 %	20/05/2048 20/08/2048	211.697 59.792	0,17 0,05
	Government National Mortgage Association		USD	5,000 %	20/10/2048	202.086	0,16
	Government National Mortgage Association	(GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	6,109 %	20/10/2048	46.440	0,04
184.311	0 0	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	5,000 %	20/11/2048	198.036	0,16
321.918	Government National Mortgage Association	(GINIVIA)(G)	USD	5,960 %	20/11/2048	44.349	0,04

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de patrimonio
-	con garantía de activos emitidos o garantizados por agencias -	- (continuación)				
	os – (continuación) Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/12/2048	64.740	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/01/2049	289.838	0,23
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	5,959 %	20/01/2049	11.559	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)(d)	USD	3,699 %	20/02/2049	4.096	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/02/2049	575.035	0,46
11.663	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/03/2049	12.407	0,0
140.987	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/03/2049	151.872	0,12
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	3,179 %	20/06/2049	15.043	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/06/2049	258.784	0,2
	Government National Mortgage Association (GNMA)(d)	USD	5,959 %	20/08/2049	56.560	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)(d)	USD	6,009 %	20/08/2049	8.731	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	5,959 %	20/09/2049	45.721	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)(d)	USD	6,009 %	20/09/2049	20.737	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	6,009 %	20/09/2049	16.314	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/10/2049	15.092	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/10/2049	395.060	0,3
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/12/2049	30.819	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/12/2049	357.643	0,2
	Government National Mortgage Association (GNMA) Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD USD	3,000 % 5,959 %	20/01/2050 20/02/2050	1.039.247 68.885	0,8 0,0
	` ,	USD	5,959 % 5,959 %	20/02/2050	36.309	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)(d)	USD	5,000 %		23.748	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA) Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	2,500 %	20/05/2050 20/10/2050	84.923	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/10/2050	1.039.261	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(g)</sup>	USD	2,500 %	20/12/2051	1.039.201	0,8
	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(g)</sup>	USD	3,000 %	20/12/2051	2.073.302	1,6
	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(g)</sup>	USD	4,500 %	20/12/2051	1.060.135	0,8
					16.823.664	13,4
	LIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZA	DOS POR AGENCIAS	1		16.823.664	12.4
Coste USD 16	con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agenci	ias – 13 64 %			16.623.664	13,4
Islas Caimán	oon garanna ao aontoo no ominaco m garannizadoo por agono	10,04 //				
250.000	Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(c)(d)	USD	1,182 %	18/04/2034	249.586	0,2
250.000	Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(c)(d)	USD	3,032 %	18/04/2034	248.411	0,2
114.133	Catamaran CLO Ltd. 2013-1A "AR" 144A(c)(d)	USD	0,985 %	27/01/2028	114.167	0,0
600.000	ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(c)(d)	USD	1,492 %	16/01/2033	600.180	0,4
2.100.000	ICG US CLO Ltd. 2017-1A "ARR" 144A(c)(d)	USD	1,306 %	28/07/2034	2.101.739	1,6
500.000	ICG US CLO Ltd. 2017-1A "DRR" 144A(c)(d)	USD	3,686 %	28/07/2034	496.799	0,4
895.217	Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(c)(d)	USD	0,874 %	15/04/2029	895.512	0,7
450.000	Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(d)	USD	1,412 %	20/01/2032	450.634	0,3
500.000	Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(c)(d)	USD	1,432 %	20/04/2033	500.443	0,4
1.800.000	MP CLO VIII Ltd. 2015-2A "ARR" 144A(c)(d)	USD	1,336 %	28/04/2034	1.800.895	1,4
500.000	Ocean Trails Clo XI "D" 144A(c)(d)	USD	3,852 %	20/07/2034	495.982	0,4
650.000	Sounds Point CLO Ltd. 2013-3RA "A" 144A(c)(d)	USD	1,272 %	18/04/2031	650.178	0,5
650.000	Tikehau US CLO I Ltd. 2021-1A "A1" 144A(c)(d)	USD	0,000 %	18/01/2035	650.325	0,5
536.201	Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "1SR"144A(c)(d)	USD	1,014 %	15/04/2029	536.495	0,4
450.000	Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "1N" 144A(c)(d)	USD	1,462 %	20/01/2034	450.377	0,3
					10.241.723	8,2
1rlanda 399 892	Haus European Loan Conduit No 39 DAC 39X "A1" (d)	EUR	0,650 %	28/07/2051	455.885	0,3
	Primrose Residential 2021-1 DAC "A" (d)	EUR	0,650 %	28/07/2051	455.885 542.204	0,3
	Viridis European Loan Conduit No 38 DAC "A" (d)	GBP	1,251 %	22/07/2029	269.633	0,4
		-			1.267.722	1,0
Reino Unido						
	Eurohome UK Mortgages Plc. 2007-2 "A2" (d)	GBP	0,260 %	15/09/2044	63.565	0,0
	Finsbury Square 2021-1GRX "AGRN" (d)	GBP	0,700 %	16/12/2067	655.061	0,5
	Finsbury Square Plc. 2018-2 "A" (d)	GBP	1,017 %	12/09/2068	199.908	0,1
	Harben Finance 2017-1X Plc. "A" (d)	GBP	0,914 %	20/08/2056	173.444	0,1
	London Wall Mortgage Capital Plc. 2021-FL2 "A" (d)	GBP	0,000 %	15/05/2052	133.641	0,1
374.827	Stratton Mortgage Funding 2019-1 Plc. "A" (d)	GBP	1,250 %	25/05/2051	502.462	0,4
					1.728.081	1,3
Estados Unido		HeD	0.542.9/	25/04/2027	33 007	0.0
	Alternative Loan Trust 2006-39CB "2A4" (d)	USD	0,542 %	25/01/2037	33.907	0,0
	American Home Mortgage Assets Trust 2006-2 "1A1"(d)	USD	1,043 %	25/09/2046	221.410	0,1
54.736	Banc of America Funding 2006-I Trust "6A1" (d)	USD	0,471 %	20/12/2046	51.171	0,04

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
•	s con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias - os - (continuación)	(continuación	)			_
	Bank 2017-BNK4 "C" (d)	USD	4,372 %	15/05/2050	213.236	0,17
250.000	Bank 2017-BNK6 "A4"	USD	3,254 %	15/07/2060	264.797	0,21
	) Bank 2018-BNK15 "D" 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,000 %	15/11/2061	92.164	0,07
	Benchmark Mortgage Trust 2018-B6 "D" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,261 %	10/10/2051	190.762	0,15
	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C6 "D" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	4,338 %	10/11/2049	91.324	0,07
	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P7 "D" 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,250 %	14/04/2050	80.992	0,07
	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(c)	USD	3,000 %	15/09/2050	91.010	0,07
	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01 "1M2" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,600 %	25/10/2041	88.596	0,07
	GMACM Home Equity Loan Trust 2007-HE3 "2A1" (d)	USD	7,000 %	25/09/2037	21.290	0,07
		USD	0,880 %	25/08/2048	65.300	0,02
	Goal Capital Funding Trust 2010-1 "A" 144A <sup>(c)(d)</sup>					
	Higher Education Funding I 2014-1 "A" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,230 %	25/05/2034	227.466	0,18
	6 Home Equity Asset Trust 2007-3 "2A3" (d)	USD	0,329 %	25/08/2037	152.376	0,12
	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2017-C7 "D" 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,000 %	15/10/2050	92.851	0,08
92.757	KnowledgeWorks Foundation 2010-1 "A" (d)	USD	1,130 %	25/02/2042	92.641	0,07
376.002	Lehman Mortgage Trust 2006-5 "2A1" (d)	USD	0,442 %	25/09/2036	50.946	0,04
82.021	Lehman XS Trust Series 2006-14N "1A1A" (d)	USD	0,472 %	25/09/2046	80.337	0,07
192.263	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-3 "A2B" (d)	USD	0,222 %	25/06/2037	161.753	0,13
200.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C34 "D" 144A(c)	USD	2,700 %	15/11/2052	176.433	0,14
235.933	PHEAA Student Loan Trust 2016-1A "A" 144A(c)(d)	USD	1,242 %	25/09/2065	240.864	0,19
337.574	SLM Student Loan Trust 2003-1 "A5A" 144A(c)(d)	USD	0.226 %	15/12/2032	318.803	0,26
	SLM Student Loan Trust 2007-2 "A4" (d)	USD	0,184 %	25/07/2022	423.110	0,34
	S SLM Student Loan Trust 2008-4 "A4" (d)	USD	1,774 %	25/07/2022	90.676	0,07
	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C37 "D" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,342 %	15/12/2049	93.285	0,08
						-
100.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C38 "D" 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,000 %	15/07/2050	90.428	3,04
TOTAL DE OB	ILIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS NO EMITIDOS NI GARANTIZA (* 461 382)	DOS POR AGEN	ICIAS		17.035.454	13,64
·	LORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO				17.000.404	10,04
(coste USD 39	0.628.426)				39.504.523	31,63
(coste USD 12	ERCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS 5.616.817)				127.151.745	101,82
	garantía de activos hipotecarios a plazo cubiertos – (1,66 %) ) Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(g)(h)</sup>	USD	3,000 %	20/12/2051	(2.073.302)	(1,66)
TOTAL DE VA (coste USD (2	LORES HIPOTECARIOS A PLAZO CUBIERTOS .072.891))				(2.073.302)	(1,66)
Contratos de	futuros – 0,33 %					
Número de contratos				Valor de mercado	Plusvalía	
	Descripción del valor			Valor de mercado de la asignación en USD	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
	Descripción del valor AUD			de la asignación en USD	latente	% del
16	<u> </u>		Larga	de la asignación	latente	% del
	AUD		Larga Larga	de la asignación en USD	latente en USD	% del patrimonio
	AUD Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021		-	de la asignación en USD 1.596.661	latente en USD	% del patrimonio
	AUD  Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 3 años 15/12/2021		-	de la asignación en USD 1.596.661 1.066.966	16.034 4.433	% del patrimonio 0,01 0,01
13	AUD Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 3 años 15/12/2021  EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/20	21	-	de la asignación en USD 1.596.661 1.066.966	16.034 4.433	% del patrimonio 0,01 0,01
8	AUD Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 3 años 15/12/2021  EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/20  GBP	21	Larga	1.596.661 1.066.966 2.663.627	16.034 4.433 20.467 85.361	% del patrimonio 0,01 0,01 0,02 0,07
8	AUD Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 3 años 15/12/2021  EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/20  GBP Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022	21	Larga	1.596.661 1.066.966 2.663.627	16.034 4.433 20.467	% del patrimonio 0,01 0,01 0,02
8	AUD Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 3 años 15/12/2021  EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/20  GBP Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022  USD	21	Larga  Larga	1.596.661 1.066.966 2.663.627 1.983.865	16.034 4.433 20.467 85.361	% del patrimonio  0,01 0,01 0,02 0,07
8 19	AUD Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 3 años 15/12/2021  EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/20  GBP Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022  USD Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022	21	Larga Larga Larga	1.596.661 1.066.966 2.663.627 1.983.865 3.217.048	16.034 4.433 20.467 85.361 42.871	% del patrimonio  0,01 0,01 0,02  0,07  0,03
8 19 41 88	AUD Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 3 años 15/12/2021  EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/20  GBP Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022  USD Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022  Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022	21	Larga Larga Larga Larga Larga	1.596.661 1.066.966 2.663.627 1.983.865 3.217.048 6.640.719 11.533.500	16.034 4.433 20.467 85.361 42.871 156.915 176.955	% del patrimonio  0,01 0,01 0,02  0,07 0,03  0,13 0,14
8 19 41 88	AUD Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 3 años 15/12/2021  EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/20  GBP Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022  USD Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022	21	Larga Larga Larga	1.596.661 1.066.966 2.663.627 1.983.865 3.217.048	16.034 4.433 20.467 85.361 42.871	% del patrimonio  0,01 0,01 0,02  0,07  0,03
8 19 41 88	AUD Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 3 años 15/12/2021  EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/20  GBP Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022  USD Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022  Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022	21	Larga Larga Larga Larga Larga	1.596.661 1.066.966 2.663.627 1.983.865 3.217.048 6.640.719 11.533.500 4.993.750	16.034 4.433 20.467 85.361 42.871 156.915 176.955 179.161	% del patrimonio  0,01 0,01 0,02  0,07  0,03  0,13 0,14 0,14
8 19 41 88 25	AUD Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 3 años 15/12/2021  EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/20  GBP Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022  USD Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022  Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022	21	Larga Larga Larga Larga Larga	1.596.661 1.066.966 2.663.627 1.983.865 3.217.048 6.640.719 11.533.500	16.034 4.433 20.467 85.361 42.871 156.915 176.955	% del patrimonio  0,01 0,01 0,02  0,07 0,03  0,13 0,14
8 19 41 88 25	AUD Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 3 años 15/12/2021  EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/20  GBP Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022  USD Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022	21	Larga Larga Larga Larga Larga	1.596.661 1.066.966 2.663.627 1.983.865 3.217.048 6.640.719 11.533.500 4.993.750 23.167.969	16.034 4.433 20.467 85.361 42.871 156.915 176.955 179.161 513.031 661.730	% del patrimonio  0,01 0,01 0,02  0,07  0,03  0,13 0,14 0,14 0,41
8 19 41 88 25	AUD Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 3 años 15/12/2021  EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/20  GBP Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022  USD Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022	21	Larga Larga Larga Larga Larga	1.596.661 1.066.966 2.663.627 1.983.865 3.217.048 6.640.719 11.533.500 4.993.750	16.034 4.433 20.467 85.361 42.871 156.915 176.955 179.161 513.031	% del patrimonio  0,01 0,01 0,02  0,07  0,03  0,13 0,14 0,14 0,41
13  8  19  41 88 25  PLUSVALÍA L	Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 3 años 15/12/2021  EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/20  GBP Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022  USD Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS	21	Larga Larga Larga Larga Larga	de la asignación en USD  1.596.661 1.066.966 2.663.627  1.983.865  3.217.048  6.640.719 11.533.500 4.993.750 23.167.969  Valor de mercado de la asignación	16.034 4.433 20.467 85.361 42.871 156.915 176.955 179.161 513.031 661.730 Minusvalía latente	% del patrimonio  0,01 0,01 0,02  0,07  0,03  0,13 0,14 0,14 0,41 0,53
8 19 41 88 25 PLUSVALÍA L Número de contratos	Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 3 años 15/12/2021  EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/20  GBP Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022  USD Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS  Descripción del valor	21	Larga Larga Larga Larga Larga	de la asignación en USD  1.596.661 1.066.966 2.663.627  1.983.865  3.217.048  6.640.719 11.533.500 4.993.750 23.167.969  Valor de mercado de la asignación	16.034 4.433 20.467 85.361 42.871 156.915 176.955 179.161 513.031 661.730 Minusvalía latente	% del patrimonio  0,01 0,01 0,02  0,07  0,03  0,13 0,14 0,14 0,41 0,53

Número de contratos	Descripción del valor				Valor de mercado de la asignación en USD	Minusvalía latente USD	% de
	EUR – (continuación)						•
(37)	,	República Federal d	le Alemania a 10 años 08/12/2021	Corta	(7.264.437)	(73.608)	(0,06
, ,			le Alemania a 2 años 08/12/2021	Corta	(1.407.402)	(63)	(0,00
. ,		•	le Alemania a 5 años 08/12/2021	Corta	(1.080.366)	(4.301)	(0,00
9	Futuros sobre bonos del Es	stado de Italia en eu	ros a corto plazo 08/12/2021	Larga	1.165.796	(410)	(0,00
					(2.872.123)	(84.799)	(0,07
(6)	<b>USD</b> Futuros sobre pagarés del	Tesoro de EE IIII :	2 2 años 31/03/2022	Corta	(1.314.141)	(4.643)	(0,01
	Futuros sobre pagarés del			Corta	(4.015.945)	(34.156)	(0,03
			a muy largo plazo a 10 años 22/03/202		(6.026.359)	(116.273)	(0,09
					(11.356.445)	(155.072)	(0,13
MINUSVALÍA I	ATENTE SOBRE CONTRA	TOS DE FUTUROS	3			(239.871)	(0,20
Contratos de	divisas a plazo – (0,03 %	<b>%</b> )					
						Plusvalía	0/ 1
Divisa	Compra	Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	latente en USD	% del patrimonio
USD	1.010.050	KRW	1.196.481.305		13/12/2021	957	0,00
USD	99.097	CAD	124.859		15/12/2021	1.307	0,00
USD	90.142	NZD	126.997		15/12/2021	3.307	0,00
USD	1.382.717	THB	45.290.879		15/12/2021	38.688	0,03
IDR	3.872.545.000	USD	269.451		17/12/2021	581	0,00
USD	4.578.825	GBP	3.371.754		21/01/2022	70.440	0,06
CNH	26.205.126	USD	4.079.868		28/01/2022	16.646	0,01
USD	844.778	AUD	1.143.381		31/01/2022	25.396	0,02
USD EUR	1.721.381	CAD USD	2.134.311		31/01/2022	49.256 42.659	0,04
LUK	4.173.576	USD	4.717.059		10/02/2022	42.039	0,03
JPY	694.209.109	USD	6.104.467		16/02/2022	67.832	0,06
	694.209.109  ATENTE SOBRE CONTRAT		6.104.467 <b>PLAZO</b>		16/02/2022	67.832 <b>317.069</b>	0,06 <b>0,25</b>
					16/02/2022	317.069	
					16/02/2022  Fecha de vencimiento		
PLUSVALÍA LA	ATENTE SOBRE CONTRAT	OS DE DIVISAS A	PLAZO Venta		Fecha de vencimiento	317.069 Minusvalía latente en USD	0,25 % del patrimonio
PLUSVALÍA LA Divisa EUR	ATENTE SOBRE CONTRAT	OS DE DIVISAS A	PLAZO		Fecha	317.069 Minusvalía latente	0,25 % del
PLUSVALÍA LA	Compra 105.738	Divisa USD	PLAZO  Venta  125.490		Fecha de vencimiento 15/12/2021	317.069 Minusvalía latente en USD (5.122)	% del patrimonio
PLUSVALÍA LA  Divisa  EUR  JPY	Compra 105.738 12.630.698	Divisa USD USD	Venta 125.490 114.719		Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021	317.069 Minusvalia latente en USD (5.122) (2.523)	% del patrimonio (0,01) (0,00)
PLUSVALÍA LA  Divisa  EUR  JPY  THB	Compra 105.738 12.630.698 3.332.807	Divisa USD USD USD	Venta 125.490 114.719 99.788		Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021	317.069  Minusvalía latente en USD  (5.122) (2.523) (885)	% del patrimonio (0,01) (0,00) (0,00)
Divisa EUR JPY THB SEK GBP MXN	Compra 105.738 12.630.698 3.332.807 6.508.407 1.588.643 6.288.917	Divisa USD	Venta  125.490 114.719 99.788 755.579 2.132.667 307.417		Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 20/01/2022 21/01/2022 24/01/2022	317.069  Minusvalia latente en USD (5.122) (2.523) (885) (32.424) (8.488) (15.484)	% del patrimonio (0,01) (0,00) (0,00) (0,03)
PLUSVALÍA LA  Divisa  EUR  JPY  THB  SEK  GBP  MXN  CHF	Compra 105.738 12.630.698 3.332.807 6.508.407 1.588.643 6.288.917 774.507	Divisa USD	Venta  125.490 114.719 99.788 755.579 2.132.667		Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 20/01/2022 21/01/2022 24/01/2022 25/01/2022	317.069  Minusvalia latente en USD (5.122) (2.523) (885) (32.424) (8.488) (15.484) (1.313)	% del patrimonio (0,01) (0,00) (0,00) (0,03) (0,00)
Divisa EUR JPY THB SEK GBP MXN CHF NOK	Compra 105.738 12.630.698 3.332.807 6.508.407 1.588.643 6.288.917 774.507 1.304.969	Divisa USD	Venta  125.490 114.719 99.788 755.579 2.132.667 307.417 848.642 151.926		Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021 20/01/2022 21/01/2022 24/01/2022 25/01/2022 25/01/2022	317.069  Minusvalia latente en USD (5.122) (2.523) (885) (32.424) (8.488) (15.484) (1.313) (7.753)	% del patrimonio (0,01) (0,00) (0,00) (0,03) (0,00) (0,01) (0,00) (0,01)
Divisa EUR JPY THB SEK GBP MXN CHF NOK USD	Compra 105.738 12.630.698 3.332.807 6.508.407 1.588.643 6.288.917 774.507 1.304.969 5.007.628	Divisa USD	Venta  125.490 114.719 99.788 755.579 2.132.667 307.417 848.642 151.926 32.193.090		Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 20/01/2022 21/01/2022 24/01/2022 25/01/2022 25/01/2022 28/01/2022	317.069  Minusvalia latente en USD (5.122) (2.523) (885) (32.424) (8.488) (15.484) (1.313) (7.753) (24.954)	0,25 % del patrimonio (0,01) (0,00) (0,00) (0,03) (0,00) (0,01) (0,00) (0,01) (0,00)
Divisa EUR JPY THB SEK GBP MXN CHF NOK USD AUD	Compra 105.738 12.630.698 3.332.807 6.508.407 1.588.643 6.288.917 774.507 1.304.969 5.007.628 3.392.439	Divisa  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	Venta  125.490 114.719 99.788 755.579 2.132.667 307.417 848.642 151.926 32.193.090 2.512.298		Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 20/01/2022 21/01/2022 24/01/2022 25/01/2022 25/01/2022 28/01/2022 31/01/2022	317.069  Minusvalia latente en USD  (5.122) (2.523) (885) (32.424) (8.488) (15.484) (1.313) (7.753) (24.954) (81.173)	% del patrimonio (0,01) (0,00) (0,03) (0,00) (0,01) (0,00) (0,01) (0,00) (0,01) (0,00) (0,01) (0,02) (0,07)
Divisa EUR JPY THB SEK GBP MXN CHF NOK USD AUD CAD	Compra 105.738 12.630.698 3.332.807 6.508.407 1.588.643 6.288.917 774.507 1.304.969 5.007.628 3.392.439 4.338.647	Divisa  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	Venta  125.490 114.719 99.788 755.579 2.132.667 307.417 848.642 151.926 32.193.090 2.512.298 3.485.067		Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 20/01/2022 21/01/2022 24/01/2022 25/01/2022 28/01/2022 28/01/2022 31/01/2022 31/01/2022	317.069  Minusvalia latente en USD  (5.122) (2.523) (885) (32.424) (8.488) (15.484) (1.313) (7.753) (24.954) (81.173) (85.955)	0,25 % del patrimonio (0,01) (0,00) (0,03) (0,00) (0,01) (0,00) (0,01) (0,00) (0,01) (0,02) (0,07) (0,07)
Divisa EUR JPY THB SEK GBP MXN CHF NOK USD AUD CAD CZK	Compra 105.738 12.630.698 3.332.807 6.508.407 1.588.643 6.288.917 774.507 1.304.969 5.007.628 3.392.439 4.338.647 3.318.446	Divisa  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	Venta  125.490 114.719 99.788 755.579 2.132.667 307.417 848.642 151.926 32.193.090 2.512.298 3.485.067 152.093		Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 20/01/2022 21/01/2022 25/01/2022 25/01/2022 28/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022	317.069  Minusvalia latente en USD  (5.122) (2.523) (885) (32.424) (8.488) (15.484) (1.313) (7.753) (24.954) (81.173) (85.955) (4.585)	% del patrimonio (0,01) (0,00) (0,03) (0,00) (0,01) (0,01) (0,01) (0,02) (0,07) (0,07) (0,07)
Divisa EUR JPY THB SEK GBP MXN CHF NOK USD AUD CAD CZK SGD	Compra 105.738 12.630.698 3.332.807 6.508.407 1.588.643 6.288.917 774.507 1.304.969 5.007.628 3.392.439 4.338.647 3.318.446 352.761	Divisa USD	Venta  125.490 114.719 99.788 755.579 2.132.667 307.417 848.642 151.926 32.193.090 2.512.298 3.485.067 152.093 261.369		Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 20/01/2022 21/01/2022 25/01/2022 25/01/2022 28/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022	317.069  Minusvalia latente en USD (5.122) (2.523) (885) (32.424) (8.488) (15.484) (1.313) (7.753) (24.954) (81.173) (85.955) (4.585) (2.775)	% del patrimonio (0,01) (0,00) (0,00) (0,01) (0,00) (0,01) (0,02) (0,07) (0,07) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
Divisa EUR JPY THB SEK GBP MXN CHF NOK USD AUD CAD CCZK SGD MYR	Compra 105.738 12.630.698 3.332.807 6.508.407 1.588.643 6.288.917 774.507 1.304.969 5.007.628 3.392.439 4.338.647 3.318.446 352.761 1.442.525	Divisa  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	Venta  125.490 114.719 99.788 755.579 2.132.667 307.417 848.642 151.926 32.193.090 2.512.298 3.485.067 152.093 261.369 345.126		Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 20/01/2022 21/01/2022 25/01/2022 25/01/2022 28/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 07/02/2022	317.069  Minusvalia latente en USD (5.122) (2.523) (885) (32.424) (8.488) (15.484) (1.313) (7.753) (24.954) (81.173) (85.955) (4.585) (2.775) (3.345)	0,25  % del patrimonio (0,01) (0,00) (0,00) (0,03) (0,00) (0,01) (0,02) (0,07) (0,07) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
Divisa EUR JPY THB SEK GBP MXN CHF NOK USD AUD CAD CZK SGD MYR PLN	Compra 105.738 12.630.698 3.332.807 6.508.407 1.588.643 6.288.917 774.507 1.304.969 5.007.628 3.392.439 4.338.647 3.318.446 352.761 1.442.525 923.160	Divisa  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	Venta  125.490 114.719 99.788 755.579 2.132.667 307.417 848.642 151.926 32.193.090 2.512.298 3.485.067 152.093 261.369 345.126 226.776		Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 20/01/2022 21/01/2022 24/01/2022 25/01/2022 25/01/2022 28/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 09/02/2022	317.069  Minusvalia latente en USD (5.122) (2.523) (885) (32.424) (8.488) (15.484) (1.313) (7.753) (24.954) (81.173) (85.955) (4.585) (2.775) (3.345) (3.038)	0,25 % del patrimonio (0,01) (0,00) (0,00) (0,03) (0,00) (0,01) (0,00) (0,01) (0,07) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
Divisa  EUR JPY THB SEK GBP MXN CHF NOK USD AUD CAD CZK SGD MYR PLN USD	Compra 105.738 12.630.698 3.332.807 6.508.407 1.588.643 6.288.917 774.507 1.304.969 5.007.628 3.392.439 4.338.647 3.318.446 352.761 1.442.525 923.160 705.195	Divisa  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	Venta  125.490 114.719 99.788 755.579 2.132.667 307.417 848.642 151.926 32.193.090 2.512.298 3.485.067 152.093 261.369 345.126 226.776 626.822		Fecha de vencimiento  15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 20/01/2022 21/01/2022 24/01/2022 25/01/2022 25/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 09/02/2022 10/02/2022	317.069  Minusvalia latente en USD  (5.122) (2.523) (885) (32.424) (8.488) (15.484) (1.313) (7.753) (24.954) (81.173) (85.955) (4.585) (2.775) (3.345) (3.038) (9.659)	% del patrimonio (0,01) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
Divisa EUR JPY THB SEK GBP MXN CHF NOK USD AUD CAD CZK SGD MYR PLN USD NZD	Compra 105.738 12.630.698 3.332.807 6.508.407 1.588.643 6.288.917 774.507 1.304.969 5.007.628 3.392.439 4.338.647 3.318.446 352.761 1.442.525 923.160	Divisa  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	Venta  125.490 114.719 99.788 755.579 2.132.667 307.417 848.642 151.926 32.193.090 2.512.298 3.485.067 152.093 261.369 345.126 226.776		Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 20/01/2022 21/01/2022 24/01/2022 25/01/2022 25/01/2022 28/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 09/02/2022	317.069  Minusvalia latente en USD (5.122) (2.523) (885) (32.424) (8.488) (15.484) (1.313) (7.753) (24.954) (81.173) (85.955) (4.585) (2.775) (3.345) (3.038)	0,25 % del patrimonio (0,01) (0,00) (0,00) (0,03) (0,00) (0,01) (0,00) (0,01) (0,07) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
Divisa EUR JPY THB SEK GBP MXN CHF NOK USD AUD CZK SGD MYR PLN USD NZD USD	Compra 105.738 12.630.698 3.332.807 6.508.407 1.588.643 6.288.917 774.507 1.304.969 5.007.628 3.392.439 4.338.647 3.318.446 352.761 1.442.525 923.160 705.195 342.991	Divisa  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	Venta  125.490 114.719 99.788 755.579 2.132.667 307.417 848.642 151.926 32.193.090 2.512.298 3.485.067 152.093 261.369 345.126 226.776 626.822 238.883 657.645.162		Fecha de vencimiento  15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 20/01/2022 21/01/2022 24/01/2022 25/01/2022 25/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 09/02/2022 10/02/2022 10/02/2022	317.069  Minusvalia latente en USD (5.122) (2.523) (885) (32.424) (8.488) (15.484) (1.313) (7.753) (24.954) (81.173) (85.955) (4.585) (2.775) (3.345) (3.038) (9.659) (4.566)	0,25  % del patrimonio (0,01) (0,00) (0,03) (0,00) (0,01) (0,00) (0,01) (0,02) (0,07) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
Divisa EUR JPY THB SEK GBP MXN CHF NOK USD AUD CZK SGD MYR PLN USD NZD USD	Compra 105.738 12.630.698 3.332.807 6.508.407 1.588.643 6.288.917 774.507 1.304.969 5.007.628 3.392.439 4.338.647 3.318.446 352.761 1.442.525 923.160 705.195 342.991 5.785.830	Divisa  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	Venta  125.490 114.719 99.788 755.579 2.132.667 307.417 848.642 151.926 32.193.090 2.512.298 3.485.067 152.093 261.369 345.126 226.776 626.822 238.883 657.645.162		Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 20/01/2022 21/01/2022 24/01/2022 25/01/2022 25/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 10/02/2022 16/02/2022 16/02/2022	317.069  Minusvalia latente en USD (5.122) (2.523) (885) (32.424) (8.488) (15.484) (1.313) (7.753) (24.954) (81.173) (85.955) (4.585) (2.775) (3.345) (3.038) (9.659) (4.566) (61.375) (355.417)	0,25  % del patrimonio (0,01) (0,00) (0,03) (0,00) (0,01) (0,00) (0,01) (0,02) (0,07) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
Divisa  EUR JPY THB SEK GBP NOK USD AUD CAD CZK SGD MYR PLN USD MINUSVALÍA I  Opciones – (6	Compra 105.738 12.630.698 3.332.807 6.508.407 1.588.643 6.288.917 774.507 1.304.969 5.007.628 3.392.439 4.338.647 3.318.446 352.761 1.442.525 923.160 705.195 342.991 5.785.830  ATENTE SOBRE CONTRA 0,266 %)	Divisa  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	Venta  125.490 114.719 99.788 755.579 2.132.667 307.417 848.642 151.926 32.193.090 2.512.298 3.485.067 152.093 261.369 345.126 226.776 626.822 238.883 657.645.162		Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 20/01/2022 21/01/2022 24/01/2022 25/01/2022 28/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 10/02/2022 10/02/2022 16/02/2022 16/02/2022	317.069  Minusvalia latente en USD (5.122) (2.523) (885) (32.424) (8.488) (15.484) (1.313) (7.753) (24.954) (81.173) (85.955) (4.585) (2.775) (3.345) (3.038) (9.659) (4.566) (61.375) (355.417)	0,25  % del patrimonio (0,01) (0,00) (0,03) (0,00) (0,01) (0,02) (0,07) (0,07) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
Divisa  EUR JPY THB SEK GBP MXN CHF NOK USD AUD CAD CZK SGD MYR PLN USD NZD USD MINUSVALÍA I	Compra 105.738 12.630.698 3.332.807 6.508.407 1.588.643 6.288.917 774.507 1.304.969 5.007.628 3.392.439 4.338.647 3.318.446 352.761 1.442.525 923.160 705.195 342.991 5.785.830  ATENTE SOBRE CONTRA  0,26 %)	Divisa  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	Venta  125.490 114.719 99.788 755.579 2.132.667 307.417 848.642 151.926 32.193.090 2.512.298 3.485.067 152.093 261.369 345.126 226.776 626.822 238.883 657.645.162		Fecha de vencimiento  15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 20/01/2022 21/01/2022 25/01/2022 25/01/2022 28/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 09/02/2022 10/02/2022 10/02/2022 16/02/2022	317.069  Minusvalia latente en USD (5.122) (2.523) (885) (32.424) (8.488) (15.484) (1.313) (7.753) (24.954) (81.173) (85.955) (4.585) (2.775) (3.345) (3.038) (9.659) (4.566) (61.375) (355.417)	0,25  % del patrimonio (0,01) (0,00) (0,00) (0,03) (0,00) (0,01) (0,02) (0,07) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
Divisa  EUR JPY THB SEK GBP MXN CHF NOK USD AUD CAD CZK SGD MYR PLN USD MINUSVALÍA I	Compra 105.738 12.630.698 3.332.807 6.508.407 1.588.643 6.288.917 774.507 1.304.969 5.007.628 3.392.439 4.338.647 3.318.446 352.761 1.442.525 923.160 705.195 342.991 5.785.830  ATENTE SOBRE CONTRA 0,266 %)	Divisa  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	Venta  125.490 114.719 99.788 755.579 2.132.667 307.417 848.642 151.926 32.193.090 2.512.298 3.485.067 152.093 261.369 345.126 226.776 626.822 238.883 657.645.162		Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 20/01/2022 21/01/2022 24/01/2022 25/01/2022 28/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 10/02/2022 10/02/2022 16/02/2022 16/02/2022	317.069  Minusvalia latente en USD (5.122) (2.523) (885) (32.424) (8.488) (15.484) (1.313) (7.753) (24.954) (81.173) (85.955) (4.585) (2.775) (3.345) (3.038) (9.659) (4.566) (61.375) (355.417)	0,25  % del patrimonio (0,01) (0,00) (0,03) (0,00) (0,01) (0,02) (0,07) (0,07) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
PLUSVALÍA LA  Divisa  EUR JPY THB SEK GBP MXN CHF NOK USD AUD CAD CZK SGD MYR PLN USD NZD USD MINUSVALÍA I  Opciones – (I  Tenencias	Compra  105.738 12.630.698 3.332.807 6.508.407 1.588.643 6.288.917 774.507 1.304.969 5.007.628 3.392.439 4.338.647 3.318.446 352.761 1.442.525 923.160 705.195 342.991 5.785.830  ATENTE SOBRE CONTRA  0,26 %)  Descripción del valor  Opciones adquirio GBP 00 Call Swaption del SO	DIVISAS A  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	Venta  125.490 114.719 99.788 755.579 2.132.667 307.417 848.642 151.926 32.193.090 2.512.298 3.485.067 152.093 261.369 345.126 226.776 626.822 238.883 657.645.162  A PLAZO	Precio de ejercicio 0,28	Fecha de vencimiento  15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 20/01/2022 21/01/2022 24/01/2022 25/01/2022 25/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 09/02/2022 10/02/2022 10/02/2022 16/02/2022 16/02/2022 Plusvalía/ (minusvalía) latente USD	317.069  Minusvalia latente en USD  (5.122) (2.523) (885) (32.424) (8.488) (15.484) (1.313) (7.753) (24.954) (81.173) (85.955) (4.585) (2.775) (3.345) (3.345) (3.080) (9.659) (4.566) (61.375)  Valor de mercado en USD	0,25  % del patrimonio (0,01) (0,00) (0,00) (0,03) (0,00) (0,01) (0,02) (0,07) (0,07) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
PLUSVALÍA LA  Divisa  EUR JPY THB SEK GBP MXN CHF NOK USD AUD CAD CZK SGD MYR PLN USD NZD USD MINUSVALÍA I  Opciones – (I	Compra 105.738 12.630.698 3.332.807 6.508.407 1.588.643 6.288.917 774.507 1.304.969 5.007.628 3.392.439 4.338.647 3.318.446 352.761 1.442.525 923.160 705.195 342.991 5.785.830  ATENTE SOBRE CONTRA  0,26 %)  Descripción del valor Opciones adquiric GBP 00 Call Swaption del SO 00 Call Swaption del SO 00 Call Swaption del SO	DIVISAS A  DIVISA  USD  USD  USD  USD  USD  USD  USD  U	Venta  125.490 114.719 99.788 755.579 2.132.667 307.417 848.642 151.926 32.193.090 2.512.298 3.485.067 152.093 261.369 345.126 226.776 626.822 238.883 657.645.162	Precio de ejercicio 0,28 Precio de ejercicio 0,30 Precio de ejercicio 0,42	Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 20/01/2022 21/01/2022 24/01/2022 25/01/2022 28/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 31/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 10/02/2022 16/02/2022 16/02/2022 Plusvalia/ (minusvalia) latente USD	317.069  Minusvalia latente en USD (5.122) (2.523) (885) (32.424) (8.488) (15.484) (1.313) (7.753) (24.954) (81.173) (85.955) (4.585) (2.775) (3.345) (3.038) (9.659) (4.566) (61.375)  Valor de mercado en USD	0,25  % del patrimonio  (0,01) (0,00) (0,03) (0,00) (0,01) (0,02) (0,07) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)

enencias	Descripción del valor			Plusvalía/ (minusvalía) latente USD	Valor de mercado en USD	% de
<u> </u>	Opciones adquiridas – (continuació GBP – (continuación)	n)				
5.900.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 15/11/2022	Precio de ejercicio 0,52	(9.362)	4.498	0,01
5.370.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,54	(8.157)	4.474	0,01
				(54.061)	19.127	0,02
77.950.000	JPY Put Swaption del LIBOR a 6 meses	Vence 26/05/2022	Precio de ejercicio 0,43	(8.366)	5.228	0,00
77.930.000	<u> </u>	Verice 20/03/2022		(0.300)	3.220	0,00
5.390.000	USD Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 0,63	(13.898)	1.170	0,00
5.330.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 07/01/2022	Precio de ejercicio 0,63	(13.791)	1.653	0,00
5.480.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/02/2022	Precio de ejercicio 0,47	(5.910)	1.067	0,00
5.390.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/03/2022	Precio de ejercicio 0,86	(13.037)	11.512	0,01
3.340.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 21/06/2022	Precio de ejercicio 1,05	(13.452)	16.350	0,01
3.340.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 14/11/2022	Precio de ejercicio 1,03  Precio de ejercicio 0,70		7.172	0,01
	Call Swaption del Libort à 3 meses	Venice 14/11/2022	—	(24.204)	38.924	0,03
OTAL DE OPCION	NES ADQUIRIDAS			(04.292)	36.924	0,03
coste USD 209.99					63.279	0,05
	Opciones suscritas EUR					
(670.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 0,20	(2.423)	(7.487)	(0,01
(670.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 0,19	(2.841)	(7.632)	(0,01)
(670.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 0,23	(5.550)	(10.584)	(0,01)
(670.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 06/01/2022	Precio de ejercicio 0,18	(2.220)	(7.926)	(0,01)
(660.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(2.885)	(12.076)	(0,01)
(620.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(860)	(12.070)	(0,01
	•	Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022	•	164		
(620.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13		(11.344)	(0,01)
(610.000) (620.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses		Precio de ejercicio 0,13	(847)	(11.161)	(0,01)
	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(860)	(11.344)	(0,01)
(660.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	(3.772)	(14.698)	(0,01)
(550.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	(3.045)	(12.248)	(0,01)
(670.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 0,20	3.448	(1.616)	(0,00)
(670.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 0,19	1.774	(3.017)	(0,00)
(670.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses		Precio de ejercicio 0,23	2.253 974	(2.782)	(0,00)
(670.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 06/01/2022	Precio de ejercicio 0,18		(4.732)	(0,00)
(1.380.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 26/05/2022	Precio de ejercicio 0,11	458	(13.651)	(0,01)
(660.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	2.749	(6.422)	(0,01)
(620.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(266)	(6.032)	(0,01)
(620.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(243)	(6.032)	(0,00)
(610.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(309)	(5.935)	(0,00)
(620.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(314)	(6.033)	(0,01)
(660.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	4.915	(5.502)	(0,00)
(550.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	4.618	(4.585)	(0,00)
				(5.082)	(184.183)	(0,15)
(520.000)	GBP Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,36	2.603	(7.023)	(0,00
(670.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,40	2.689	(9.947)	(0,00)
(610.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,38	3.337	(9.491)	(0,01)
(550.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,42	2.251	(9.511)	(0,01)
(600.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 15/11/2022	Precio de ejercicio 0,55	(1.321)	(14.965)	(0,01)
(560.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,60	(2.608)	(15.357)	(0,01)
	Gail Gwaption del GONIA à 12 meses	Venee 10/11/2022		6.951	(66.294)	(0,05)
	USD			0.501	(00.294)	(0,05
(1.060.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 06/12/2021	Precio de ejercicio 1,58	(1.753)	(9.769)	(0,01)
(1.060.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,64	(6.681)	(15.837)	(0,01)
(1.060.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 1,67	(10.724)	(19.787)	(0,02)
(1.750.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 1,30	11.570	(3.494)	(0,00)
(1.060.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 1,60	(4.922)	(14.780)	(0,00)
(1.730.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 07/01/2022	Precio de ejercicio 1,12	13.692		(0,01)
		Vence 22/02/2022	•		(1.741)	
(1.730.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses		Precio de ejercicio 0,85	5.610	(1.365)	(0,00
(1.750.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/03/2022	Precio de ejercicio 1,41	4.838	(19.703)	(0,02
(1.760.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 21/06/2022	Precio de ejercicio 1,38	5.387	(24.417)	(0,02
(600.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 14/11/2022	Precio de ejercicio 1,06	17.181	(13.984)	(0,01
(1.060.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 06/12/2021	Precio de ejercicio 1,58	6.360	(1.656)	(0,00
(1.060.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,64	6.840	(2.316)	(0,00

Tenencias	Descripción del valor			Plusvalía/ (minusvalía) latente USD	Valor de mercado en USD	% de patrimonio
	Opciones suscritas – (continuaci USD – (continuación)	ión)				
(1.060.000) (1.060.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/12/2021 Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 1,67 Precio de ejercicio 1,60	5.648 3.456	(3.415) (6.402)	(0,00 (0,01
, ,	·		-	56.502	(138.666)	(0,11
TOTAL DE OPCION (coste USD (447.51					(389.143)	(0,31)
TOTAL DE OPCION (coste USD (237.51					(325.864)	(0,26
Contratos de perr	mutas financieras – (0,02 %)				-	
Importe					Plusvalía	
teórico	A	A	Distan	Facha daimianta	latente	% de
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	en USD	patrimonic
	Permutas de tipos de interés					
1.750.000		Fijo 2,000 %	AUD	17/03/2032	8.818	0,01
4.680.000	Fijo 5,800 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2023	35.859	0,03
1.790.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,400 %	BRL	02/01/2023	2.664	0,00
3.690.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,300 %	BRL	02/01/2024	6.463	0,01
2.792.078	Fijo 6,320 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2025	47.968	0,04
3.500.000	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 11,230 %	BRL	04/01/2027	4.162	0,00
2.960.000	Fijo 1,750 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2026	4.050	0,00
2.340.000	Fijo 1,680 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	22/08/2028	32.077	0,03
1.570.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,500 %	CAD	14/10/2031	11.876	0,01
2.130.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,250 %	CAD	15/12/2051	32.112	0,03
250.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,180 %	CAD	22/08/2052	87	0,00
2.230.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,000 %	CHF	16/03/2032	23.904	0,02
820.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,500 %	CHF	17/03/2032	5.534	0,01
8.680.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,500 %	CNY	15/09/2023	2.436	0,00
1.710.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,500 %	CNY	15/12/2026	2.134	0,00
11.400.000	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	•	EUR	03/11/2023	14.314	0,01
939.022	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	•	EUR	15/12/2023	713	0,00
2.520.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2024	12.360	0,01
1.910.875	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	,	EUR	15/12/2026	7.881	0,01
1.700.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	•	EUR	03/11/2027	5.363	0,00
930.000	Fijo 0,000 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2028	9.043	0,00
240.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	,	EUR	15/12/2030	3.814	0,00
180.000	,	•	EUR		649	0,00
	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	•		15/12/2031		
1.030.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	•	EUR	17/03/2032	5.361	0,00
70.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	•	EUR	15/12/2033	1.641	0,00
590.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	•	EUR	15/12/2036	4.046	0,00
380.000	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	Fijo 0,750 %	GBP	15/12/2051	11.450	0,01
4.002.190.000	Fijo 1,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en KRW)	KRW	16/03/2024	10.673	0,01
38.130.000	Fijo 6,200 %	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	13/12/2023	28.706	0,02
1.780.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	•	MYR	27/02/2024	10.982	0,01
325.000	Fijo 1,700 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2026	4.330	0,00
26.850.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	•	SEK	16/03/2024	6.739	0,01
14.990.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)		SEK	15/12/2031	5.281	0,00
3.720.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	•	SEK	17/03/2032	375	0,00
8.360.000	Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD	25/07/2024	173	0,00
1.560.000	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	Fijo 1,530 %	USD	22/09/2031	20.486	0,02
3.070.000	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)		USD	15/12/2031	12.511	0,01
3.725.000	Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	Fijo 7,400 %	ZAR	15/12/2031	4.535	0,00
PLUSVALÍA LATEN	ITE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE	INTERÉS			401.570	0,32
	Permutas de incumplimiento crediti	icio (CDS)				
5.800.000	Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 28 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2022	2.409	0,00
270.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Indonesia)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2024	3.429	0,00
200.000	Variable (Bonos internacionales del Estado saudí)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2024	3.109	0,00
870.000	Variable (Bonos internacionales del Estado saudí)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	62	0,00
450.000 100.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 11 Index) Variable (The Markit CMBX North	Fijo 3,000 % Fijo 3,000 %	USD	18/11/2054 18/11/2054	70.792 9.456	0,06

co neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% patrimo
	Permutas de incumplimiento					
	crediticio (CDS) – (continuación)					
100.000	Variable (The Markit CMBX North	Fijo 3,000 %	USD	18/11/2054	5.632	0,
250.000	America BBB- 11 Index) Variable (The Markit CMBX North	Fijo 3,000 %	USD	17/10/2057	31.094	0.
200.000	America BBB- 8 Index)	. 1,0 0,000 /0	005	11710/2001	01.001	0,
100.000	Variable (The Markit CMBX North	Fijo 3,000 %	USD	17/10/2057	4.834	0,
100.000	America BBB- 8 Index) Variable (The Markit CMBX North	Fijo 3,000 %	USD	17/10/2057	1.981	0.
100.000	America BBB- 8 Index)	1 130 3,000 78	03D	17/10/2037	1.901	U,
200.000	Variable (The Markit CMBX North	Fijo 3,000 %	USD	17/10/2057	2.686	0,
200.000	America BBB- 8 Index)	Fiio 2 000 %	USD	17/11/2059	24.670	0.
200.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 10 Index)	Fijo 3,000 %	030	17/11/2059	24.070	U,
400.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 10 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/11/2059	23.451	0
SVALÍA LATE	NTE SOBRE PERMUTAS DE					
JMPLIMIENTO	CREDITICIO (CDS)				183.605	0
370.000	Permutas de inflación Fijo 2,250 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/10/2023	180	0
500.000	Fijo 3,250 %	Variable (LIBOR a 12 meses en USD)	USD	07/10/2022	5.787	0
CVALÍA LATE	NTE SOBRE PERMUTAS DE INFLACIÓ	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·			5.967	0
AL DE PLUSV	ALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS D	PE PERMUTAS FINANCIERAS			591.142	0
orte					Minusvalía	
со	A	Aibi-	Distan	Facha da	latente	%
neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	en USD	patrimo
	Permutas de tipos de interés					
13.690.000	,	Fijo 0,190 %	AUD	22/02/2023	(22.650)	(0
10.180.000	,	Fijo 1,250 %	AUD	15/12/2026	(111.708)	(0
2.330.000	,	Fijo 2,000 %	AUD	15/12/2031	(30.153)	(0
2.010.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 10,565 %	BRL	02/01/2023	(2.942)	(0
5.390.000	Variable (LIBOR a 1 mes en BRL)	Fijo 7,200 %	BRL	02/01/2023	(36.501)	(0
250.000	Fijo 11,814 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(187)	(0
250.000	Fijo 11,905 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(211)	(0
200.000		E::- 4 000 0/	BRL	02/01/2024	(30.620)	(0
1.920.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 4,930 %		02.0 202 .		
	•	Fijo 9,200 %	BRL	02/01/2024	(7.380)	(0
1.920.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	•	BRL CAD		, ,	(0 (0
1.920.000 3.322.227 3.290.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 %	CAD	02/01/2024 22/08/2025	(7.380) (28.716)	(0
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.260.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD CAD	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031	(7.380) (28.716) (26.992)	(0
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.260.000 2.660.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,000 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	CAD CAD EUR	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027	(7.380) (28.716)	(0
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.260.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en	CAD CAD	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622)	(0)
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.260.000 2.660.000 440.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,250 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	CAD CAD EUR EUR	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052)	(0)
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.260.000 440.000 2.470.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,250 % Fijo 0,500 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	CAD CAD EUR EUR GBP	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115)	(C (C (C) (C)
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.260.000 440.000 2.470.000 290.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,250 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 %	CAD CAD EUR EUR GBP GBP	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/2026 15/12/2028	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578)	(0 (0 (0 (0 (0
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.260.000 440.000 440.000 2.470.000 290.000 5.470.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,250 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	CAD CAD EUR EUR GBP GBP GBP	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/2026 15/12/2028 15/12/2031	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948)	(0 (0 (0 (0 (0 (0
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.260.000 440.000 2.470.000 290.000 5.470.000 2.420.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,250 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,000 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	CAD CAD EUR EUR GBP GBP GBP GBP	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/2026 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307)	(0 (0 (0 (0 (0 (0
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.660.000 2.660.000 440.000 2.470.000 2.90.000 5.470.000 2.420.000 235.880.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,250 % Fijo 0,550 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,000 % Fijo 0,000 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)	CAD CAD EUR EUR GBP GBP GBP GBP GBP JPY	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/2026 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553)	(0 (0 (0 (0 (0 (0 (0
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.260.000 440.000 2.470.000 290.000 5.470.000 2.420.000 235.880.000 722.600.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,750 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (LIBOR a 12 meses en JPY) Variable (KWCDC a 3 meses en KRW)	CAD CAD EUR EUR GBP GBP GBP GBP JPY KRW	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/2026 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 15/09/2031	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553) (15.715)	(0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0)
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.260.000 440.000 2.470.000 2.90.000 5.470.000 2.420.000 722.600.000 1.550.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,750 % Fijo 7,750 % Fijo 7,750 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)	CAD CAD EUR EUR GBP GBP GBP GBP JPY KRW MXN	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/2056 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 15/09/2031 03/12/2031	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553)	(0 (0 (0 (0 (0 (0 (0
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.260.000 440.000 2.470.000 290.000 5.470.000 2.420.000 235.880.000 722.600.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,0250 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,050 % Variable (KLIBOR a 3 meses en	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (LIBOR a 12 meses en JPY) Variable (KWCDC a 3 meses en KRW) Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	CAD CAD EUR EUR GBP GBP GBP GBP JPY KRW	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/2026 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 15/09/2031	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553) (15.715) (1.588)	(0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0)
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.660.000 2.660.000 440.000 2.470.000 2.420.000 2.420.000 2.35.880.000 722.600.000 1.550.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,250 % Fijo 0,550 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 1,750 % Fijo 1,000 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 7,150 % Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (KORIA a 1 mes en GBP) Variable (LIBOR a 12 meses en JPY) Variable (KWCDC a 3 meses en KRW) Variable (TIIE a 1 mes en MXN) Fijo 2,000 %	CAD CAD EUR EUR GBP GBP GBP GBP JPY KRW MXN MYR	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/2026 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 15/09/2031 03/12/2031 16/06/2026	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553) (15.715) (1.588)	(0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0)
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.660.000 2.660.000 440.000 2.470.000 2.90.000 5.470.000 2.420.000 235.880.000 722.600.000 1.550.000 1.860.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,750 % Fijo 7,150 % Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR) Fijo 2,000 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (EURIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (IBOR a 12 meses en JPY) Variable (KWCDC a 3 meses en KRW) Variable (TIIE a 1 mes en MXN) Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	CAD CAD EUR EUR GBP GBP GBP JPY KRW MXN MYR	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/2026 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 03/12/2031 03/12/2031 16/06/2026	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553) (15.715) (1.588) (13.231) (15.637)	(0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0)
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.260.000 2.660.000 440.000 2.470.000 2.420.000 5.470.000 2.420.000 1.550.000 1.860.000 12.610.000 14.440.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,250 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,750 % Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR) Fijo 2,000 % Fijo 7,150 % Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR) Fijo 2,000 % Fijo 2,130 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (LIBOR a 12 meses en JPY) Variable (KWCDC a 3 meses en KRW) Variable (TIIE a 1 mes en MXN) Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	CAD CAD EUR EUR GBP GBP GBP JPY KRW MXN MYR NOK	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/2056 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 15/09/2031 03/12/2031 16/06/2026	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553) (15.715) (1.588) (13.231) (15.637) (18.626)	(0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0)
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.660.000 440.000 2.470.000 290.000 5.470.000 2.420.000 235.880.000 1.550.000 1.860.000 12.610.000 14.440.000 2.130.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CEDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,750 % Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR) Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR) Fijo 2,000 % Fijo 2,130 % Fijo 2,130 % Fijo 2,000 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (KIBOR a 12 meses en JPY) Variable (KIWCDC a 3 meses en KRW) Variable (TIIE a 1 mes en MXN) Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	CAD CAD EUR EUR GBP GBP GBP GBP JPY KRW MXN MYR NOK NOK	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/206 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 15/09/2031 03/12/2031 16/06/2026	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553) (15.715) (1.588) (13.231) (15.637) (18.626) (4.412)	
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.660.000 2.660.000 440.000 2.470.000 2.420.000 2.35.880.000 722.600.000 1.550.000 1.860.000 12.610.000 14.440.000 2.130.000 2.590.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,750 % Fijo 7,150 % Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR) Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 2,130 % Fijo 2,130 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (LIBOR a 12 meses en JPY) Variable (KIBOR a 12 meses en KRW) Variable (TIIE a 1 mes en MXN) Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	CAD CAD EUR EUR GBP GBP GBP GBP JPY KRW MXN MYR NOK NOK NOK NZD	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/2026 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 15/09/2031 03/12/2031 16/06/2026 16/03/2027 11/05/2031 16/03/2032 15/12/2032	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553) (15.715) (1.588) (13.231) (15.637) (18.626) (4.412) (3.215)	
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.660.000 2.660.000 440.000 2.470.000 2.420.000 2.420.000 2.35.880.000 722.600.000 1.550.000 1.860.000 14.440.000 2.130.000 2.590.000 840.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,550 % Fijo 0,550 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,750 % Fijo 7,150 % Fijo 7,150 % Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (EURIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (KWCDC a 3 meses en JPY) Variable (TIIE a 1 mes en MXN) Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Fijo 1,250 % Fijo 3,000 %	CAD CAD EUR EUR GBP GBP GBP JPY KRW MXN MYR NOK NOK NOK NZD NZD	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/2026 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 15/09/2031 16/06/2026 16/03/2027 11/05/2031 16/03/2032 15/12/2022 16/09/2031	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553) (15.715) (1.588) (13.231) (15.637) (18.626) (4.412) (3.215) (255)	
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.260.000 2.660.000 440.000  2.470.000 2.90.000 5.470.000 2.420.000 1.550.000 1.550.000 12.610.000 12.610.000 14.440.000 2.130.000 840.000 1.360.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,250 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,750 % Fijo 7,150 % Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR) Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 2,000 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Fijo 1,560 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (KWCDC a 3 meses en KRW) Variable (TIIE a 1 mes en MXN) Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Fijo 1,250 % Fijo 3,000 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	CAD CAD EUR EUR GBP GBP GBP JPY KRW MXN MYR NOK NOK NOK NZD NZD	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/2026 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 03/12/2031 03/12/2031 16/06/2026 16/03/2027 11/05/2031 16/03/2032 15/12/2022 16/09/2031 15/12/2022	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553) (15.715) (1.588) (13.231) (15.637) (18.626) (4.412) (3.215) (255) (4.519)	
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.260.000 2.660.000 440.000 2.470.000 2.90.000 5.470.000 2.420.000 2.35.880.000 1.550.000 1.860.000 12.610.000 14.440.000 2.130.000 2.590.000 1.360.000 7.980.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,250 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,750 % Fijo 7,150 % Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR) Fijo 2,000 % Fijo 2,130 % Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 2,000 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (KWCDC a 3 meses en JPY) Variable (IIBC a 12 meses en JRW) Variable (TIIE a 1 mes en MXN) Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 3 meses en NOK) Variable (NIBOR a 3 meses en NZD) Variable (WZDBB a 3 meses en PLN)	CAD CAD EUR EUR  GBP GBP GBP JPY KRW MXN MYR  NOK NOK NOK NZD NZD PLN	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2026 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 15/09/2031 03/12/2031 16/03/2027 11/05/2031 16/03/2032 15/12/2031 16/03/2032 15/12/2031	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553) (15.715) (1.588) (13.231) (15.637) (18.626) (4.412) (3.215) (255) (4.519) (3.665)	
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.660.000 440.000 2.470.000 2.990.000 5.470.000 2.420.000 2.35.880.000 1.860.000 1.2610.000 1.4440.000 2.130.000 2.590.000 840.000 1.360.000 1.360.000 1.360.000 1.360.000 1.370.000 1.370.000 1.370.000 1.370.000 1.370.000 1.370.000 1.370.000 1.370.000 1.370.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,550 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,050 % Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR) Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 2,130 % Fijo 2,130 % Fijo 2,130 % Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 2,000 % Fijo 0,250 % Fijo 1,750 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (LIBOR a 12 meses en JPY) Variable (LIBOR a 12 meses en JPY) Variable (KIBODC a 3 meses en KRW) Variable (TIIE a 1 mes en MXN) Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 3 meses en NOK) Variable (NIBOR a 3 meses en NZD) Variable (WIBOR a 3 meses en PLN) Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	CAD CAD EUR EUR GBP GBP GBP GBP JPY KRW MXN MYR NOK NOK NOK NOK NZD NZD PLN PLN	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/206 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 15/09/2031 03/12/2031 16/06/2026 16/03/2027 11/05/2031 16/03/2032 15/12/2031 16/03/2032 15/12/2031 16/12/2021 16/12/2021 15/12/2031	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553) (15.715) (1.588) (13.231) (15.637) (18.626) (4.412) (3.215) (255) (4.519) (3.665) (221)	
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.660.000 2.660.000 440.000 2.470.000 2.420.000 2.420.000 2.420.000 1.550.000 1.860.000 12.610.000 14.440.000 2.130.000 2.590.000 840.000 1.360.000 7.980.000 2.97.971 1.375.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CEDR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,750 % Fijo 7,150 % Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR) Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 2,130 % Fijo 2,130 % Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 2,000 % Fijo 1,750 % Fijo 0,250 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 2,000 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (EURIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (IBOR a 12 meses en JPY) Variable (IHBOR a 12 meses en JPY) Variable (TIIE a 1 mes en MXN) Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 3 meses en NOK) Variable (NIBOR a 3 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en PLN) Variable (WIBOR a 6 meses en PLN) Variable (WIBOR a 6 meses en PLN) Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	CAD CAD EUR EUR GBP GBP GBP JPY KRW MXN MYR NOK NOK NOK NOK NZD NZD PLN PLN PLN	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/2051 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 15/09/2031 16/03/2032 16/03/2027 11/05/2031 16/03/2032 15/12/2021 16/09/2031 15/12/2021 16/12/2021 15/12/2031	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553) (15.715) (1.588) (13.231) (15.637) (18.626) (4.412) (255) (4.519) (3.665) (221) (1.831)	
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.260.000 2.660.000 440.000 2.470.000 2.470.000 2.420.000 3.550.000 1.550.000 1.550.000 1.2610.000 12.610.000 12.610.000 1360.000 7.920.000 840.000 7.980.000 7.980.000 1.375.000 10.750.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,250 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR) Fijo 2,000 % Fijo 1,750 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 2,000 % Fijo 1,750 % Fijo 1,000 % Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (EURIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (KWCDC a 3 meses en JPY) Variable (HIBOR a 12 meses en JPY) Variable (TIIE a 1 mes en MXN) Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en PLN) Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	CAD CAD CAD EUR EUR  GBP GBP GBP GBP JPY KRW MXN MYR  NOK NOK NOK NOK NZD NZD PLN PLN PLN PLN SEK	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/2051 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 15/09/2031 16/06/2026 16/03/2027 11/05/2031 16/09/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553) (15.715) (1.588) (13.231) (15.637) (18.626) (4.412) (3.215) (255) (4.519) (3.665) (221) (1.831) (1.889)	
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.660.000 2.660.000 440.000 2.470.000 2.420.000 2.420.000 2.420.000 1.550.000 1.860.000 12.610.000 14.440.000 2.130.000 2.590.000 840.000 1.360.000 7.980.000 2.97.971 1.375.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CEDR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,750 % Fijo 7,150 % Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR) Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 2,130 % Fijo 2,130 % Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 2,000 % Fijo 1,750 % Fijo 0,250 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 2,000 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (EURIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (KWCDC a 3 meses en JPY) Variable (HIBOR a 12 meses en JPY) Variable (TIIE a 1 mes en MXN) Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en PLN) Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	CAD CAD EUR EUR GBP GBP GBP JPY KRW MXN MYR NOK NOK NOK NOK NZD NZD PLN PLN PLN	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/2051 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 15/09/2031 16/03/2032 16/03/2027 11/05/2031 16/03/2032 15/12/2021 16/09/2031 15/12/2021 16/12/2021 15/12/2031	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553) (15.715) (1.588) (13.231) (15.637) (18.626) (4.412) (255) (4.519) (3.665) (221) (1.831)	
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.260.000 2.660.000 440.000 2.470.000 2.470.000 2.420.000 3.550.000 1.550.000 1.550.000 1.2610.000 12.610.000 12.610.000 1360.000 7.920.000 840.000 7.980.000 7.980.000 1.375.000 10.750.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,250 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR) Fijo 2,000 % Fijo 1,750 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 2,000 % Fijo 1,750 % Fijo 1,000 % Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (EURIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (KWCDC a 3 meses en JPY) Variable (HIBOR a 12 meses en JPY) Variable (TIIE a 1 mes en MXN) Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en PLN) Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	CAD CAD CAD EUR EUR  GBP GBP GBP GBP JPY KRW MXN MYR  NOK NOK NOK NOK NZD NZD PLN PLN PLN PLN SEK	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/2051 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 15/09/2031 16/06/2026 16/03/2027 11/05/2031 16/09/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553) (15.715) (1.588) (13.231) (15.637) (18.626) (4.412) (3.215) (255) (4.519) (3.665) (221) (1.831) (1.889)	
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.260.000 2.660.000 440.000 2.470.000 2.420.000 5.470.000 2.420.000 1.550.000 1.550.000 14.440.000 2.130.000 2.130.000 2.97.971 1.75.000 13.75.000 13.070.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,250 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,750 % Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR) Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 2,000 % Fijo 1,750 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 2,000 % Fijo 1,750 % Fijo 2,000 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 2,000 % Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Variable (LIBOR a 6 meses en THB)	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (KWCDC a 3 meses en JPY) Variable (KWCDC a 3 meses en KRW) Variable (TIIE a 1 mes en MXN) Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Fijo 1,250 % Fijo 3,000 % Variable (WIBOR a 3 meses en PLN) Variable (WIBOR a 6 meses en PLN) Fijo 0,250 % Fijo 1,000 %	CAD CAD CAD EUR EUR  GBP GBP GBP JPY KRW MXN MYR  NOK NOK NOK NZD NZD NZD PLN PLN PLN SEK THB	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2026 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 15/09/2031 03/12/2031 16/06/2026 16/03/2027 11/05/2031 16/03/2032 15/12/2031 16/03/2032 15/12/2031 16/12/2021 15/12/2031 16/12/2021 15/12/2031 16/12/2021 15/12/2031	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553) (15.715) (1.588) (13.231) (15.637) (18.626) (4.412) (3.215) (255) (4.519) (3.665) (221) (1.831) (1.889) (1.324) (7.758)	
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.660.000 2.660.000 440.000 2.470.000 2.420.000 2.420.000 2.420.000 1.550.000 1.860.000 1.2.610.000 1.360.000 2.590.000 840.000 2.590.000 840.000 1.375.000 1.375.000 10.750.000 13.070.000 1.880.000 2.960.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CEDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 2,000 % Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR) Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 2,130 % Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 2,000 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 2,000 % Variable (NZDBR a 3 meses en SEK) Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Variable (LIBOR a 6 meses en THB) Fijo 0,250 % Fijo 1,000 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (EURIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (LIBOR a 12 meses en JPY) Variable (LIBOR a 12 meses en JPY) Variable (KIBOR a 6 meses en NOK) Variable (TIIE a 1 mes en MXN) Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 3 meses en NOK) Fijo 1,250 % Fijo 3,000 % Variable (WIBOR a 3 meses en PLN) Variable (WIBOR a 6 meses en PLN) Variable (WIBOR a 6 meses en PLN) Variable (WIBOR a 6 meses en PLN) Fijo 0,250 % Fijo 1,000 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) Variable (SOFR a 1 mes en USD)	CAD CAD CAD EUR EUR GBP GBP GBP GBP JPY KRW MXN MYR NOK NOK NOK NOK NZD NZD NZD PLN PLN PLN PLN SEK THB USD	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 15/09/2031 03/12/2031 16/03/2027 11/05/2031 16/03/2032 15/12/2022 16/09/2031 15/12/2031 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553) (15.715) (1.588) (13.231) (15.637) (18.626) (4.412) (3.215) (255) (4.519) (3.665) (221) (1.831) (1.889) (1.324) (7.758) (10.596)	
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.260.000 2.660.000 440.000 2.470.000 2.90.000 5.470.000 2.35.880.000 1.550.000 1.860.000 12.610.000 14.440.000 2.130.000 2.590.000 840.000 1.360.000 7.980.000 0.980.000 1.375.000 1.375.000 1.375.000 1.375.000 1.375.000 1.375.000 1.375.000 1.380.000 2.980.000 2.980.000 2.980.000 2.980.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,250 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 7,150 % Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR) Fijo 2,000 % Fijo 2,130 % Fijo 2,130 % Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 0,250 % Fijo 1,750 % Fijo 0,250 % Fijo 1,000 % Fijo 2,500 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (EURIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (KIBOR a 12 meses en JPY) Variable (IIBOR a 12 meses en JPY) Variable (TIIE a 1 mes en MXN) Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Fijo 1,250 % Fijo 3,000 % Variable (WIBOR a 3 meses en PLN) Variable (WIBOR a 6 meses en PLN) Variable (WIBOR a 1 mes en USD) Variable (SOFR a 1 mes en USD) Variable (SOFR a 1 mes en USD)	CAD CAD CAD EUR EUR GBP GBP GBP GBP JPY KRW MXN MYR NOK	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/2051 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 15/09/2031 16/03/2027 11/05/2031 16/03/2032 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553) (15.715) (1.588) (13.231) (15.637) (18.626) (4.412) (255) (4.519) (3.665) (221) (1.831) (1.889) (1.324) (7.758) (1.989)	
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.260.000 2.660.000 440.000 2.470.000 2.90.000 5.470.000 2.420.000 1.550.000 1.550.000 1.860.000 2.130.000 2.130.000 2.990.000 3.60.000 3.750.000 1.360.000 3.980.000 1.3750.000 1.3750.000 1.3750.000 1.380.000 1.380.000 1.380.000 1.380.000 1.380.000 1.910.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,250 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR) Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 2,000 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 0,250 % Fijo 1,750 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (KWCDC a 3 meses en KRW) Variable (KIBOR a 12 meses en JPY) Variable (RIBOR a 12 meses en KRW) Variable (RIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Variable (WIBOR a 6 meses en PLN) Variable (WIBOR a 1 mese en USD) Variable (SOFR a 1 mese en USD) Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	CAD CAD CAD EUR EUR  GBP GBP GBP GBP JPY KRW MXN MYR  NOK NOK NOK NZD NZD PLN PLN PLN PLN PLN SEK THB USD USD	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051  15/12/206 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 15/09/2031 03/12/2031 16/03/2027 11/05/2031 16/03/2032 15/12/2031 15/12/2031 16/03/2031 16/12/2021 15/12/2023 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2031 16/03/2027 16/03/2027 16/03/2027 16/03/2027 16/03/2027 17/09/2031 22/09/2036	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553) (15.715) (1.588) (13.231) (15.637) (18.626) (4.412) (3.215) (255) (4.519) (3.665) (221) (1.831) (1.889) (1.324) (7.758) (10.596) (1.989) (19.496)	
1.920.000 3.322.227 3.290.000 2.260.000 2.660.000 440.000 2.470.000 2.90.000 5.470.000 2.35.880.000 1.550.000 1.860.000 12.610.000 14.440.000 2.130.000 2.590.000 840.000 1.360.000 7.980.000 0.980.000 1.375.000 1.375.000 1.375.000 1.375.000 1.375.000 1.375.000 1.375.000 1.380.000 2.980.000 2.980.000 2.980.000 2.980.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL) Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,000 % Fijo 0,250 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 7,150 % Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR) Fijo 2,000 % Fijo 2,130 % Fijo 2,130 % Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 2,000 % Fijo 2,000 % Fijo 1,750 % Fijo 1,750 % Fijo 0,250 % Fijo 1,750 % Fijo 0,250 % Fijo 1,000 % Fijo 2,500 %	Fijo 9,200 % Fijo 1,560 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (EURIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (KIBOR a 12 meses en JPY) Variable (IIBOR a 12 meses en JPY) Variable (TIIE a 1 mes en MXN) Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) Fijo 1,250 % Fijo 3,000 % Variable (WIBOR a 3 meses en PLN) Variable (WIBOR a 6 meses en PLN) Variable (WIBOR a 1 mes en USD) Variable (SOFR a 1 mes en USD) Variable (SOFR a 1 mes en USD)	CAD CAD CAD EUR EUR GBP GBP GBP GBP JPY KRW MXN MYR NOK	02/01/2024 22/08/2025 15/12/2031 03/11/2027 15/12/2051 15/12/2051 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2031 15/09/2031 16/03/2027 11/05/2031 16/03/2032 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031 15/12/2031	(7.380) (28.716) (26.992) (16.622) (9.052) (10.115) (29.578) (7.948) (21.307) (3.553) (15.715) (1.588) (13.231) (15.637) (18.626) (4.412) (255) (4.519) (3.665) (221) (1.831) (1.889) (1.324) (7.758) (1.989)	

#### Contratos de permutas financieras - (continuación)

Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente en USD	% del
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)					
200.000	Variable (Unibail-Rodamco-Westfield S.E.)	Fijo 1,000 %	EUR	20/06/2024	(998)	(0,00
1.000.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de México)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	(4.829)	(0,00
800.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Indonesia)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(5.362)	(0,01
80.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de México)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(895)	(0,00
350.000	Variable (Bonos extranjeros rusos - Eurobono)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(5.071)	(0,00
MINUSVALÍA LATE INCUMPLIMIENTO	NTE SOBRE PERMUTAS DE CREDITICIO (CDS)				(17.155)	(0,01
	Permutas de inflación					
450.000	Fijo 1,920 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/11/2031	(3.451)	(0,00
670.000	Variable (LIBOR a 12 meses en GBP	) Fijo 4,170 %	GBP	15/11/2028	(51.313)	(0,04
TOTAL DE MINUSV	NTE SOBRE PERMUTAS DE VALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS				(54.764)	(0,04
DE PERMUTAS FIN	IANCIERAS				(618.005)	(0,49
VALOR DE MERCA (coste USD 123.306	DO DE LAS INVERSIONES 6.410)				125.109.227	100,18
OTROS ACTIVOS Y	/ PASIVOS				(226.000)	(0,18
PATRIMONIO					124.883.227	100,00
TOTAL DE INVERS	IONES				Valor de mercado en USD	% de patrimonio
	cluyendo derivados (coste USD 125.616	*			127.151.745	101,82
	e títulos con garantía hipotecaria a plazo	cubiertos (coste USD (2.072.891))			(2.073.302)	(1,66
Plusvalía latente sob	ore contratos de futuros				661.730	0,53
	obre contratos de futuros				(239.871)	(0,20)
	ore contratos de divisas a plazo				317.069	0,25
	obre contratos de divisas a plazo				(355.417)	(0,28
	e opciones compradas (coste USD 209.				63.279	0,05
	e opciones suscritas (coste USD (447.5	15))			(389.143)	(0,31)
	ore contratos de permutas financieras				591.142	0,47
Otros activos y pasiv	obre contratos de permutas financieras vos				(618.005) (226.000)	(0,49) (0,18)
Patrimonio					124.883.227	100,00

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Natwest Markets Plc., Royal Bank of Canada, State Street Bank & Trust y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc. y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Citibank N.A., Credit Suisse, Merrill Lynch International y Morgan Stanley & Co. International Plc.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,53 %.

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (d) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (e) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- (f) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.
- (9) Los valores TBA (por confirmar) se compran sobre una vez suscrito un compromiso a plazo con un importe de principal aproximado (por lo general +/-2,5 %) y sin fecha definitiva de vencimiento. El importe real del principal y la fecha de vencimiento se determinarán tras la liquidación cuando se asignen los "pools" de hipotecas específicos.
- (h) Estos valores representan ventas por confirmar (TBA) cubiertas con posiciones GNMA largas. Estos importes se declaran por separado en el Balance de situación como Valores hipotecarios a plazo cubiertos.

			Tipo de		Valor de mercado	% de
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en EUR	patrimoni
Valores mobiliar	rios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial					
Bonos – 74,12 %	0					
Australia	Management Organia Lad	EUD	0.005.0/	00/00/007	200.040	0.00
	Macquarie Group Ltd. Westpac Banking Corp.(c)	EUR USD	0,625 % 2,894 %	03/02/2027 04/02/2030	302.946 1.174.347	0,02 0,10
	Westpac Banking Corp.(c)	USD	2,668 %	15/11/2035	1.292.450	0,10
	Troopad Balliang Colp.		2,000 70	10/11/2000		
					2.769.743	0,2
Austria						
	Bonos del Estado de Austria 144A(d)	EUR	2,100 %	Perp.	668.331	0,0
	Bonos del Estado de Austria 144A <sup>(d)</sup>	EUR	0,850 %	Perp.	392.092	0,0
1.900.000	Volksbank Wien AG	EUR	0,875 %	23/03/2026	1.912.198	0,10
					2.972.621	0,24
Bélgica						
-	Ageas S.A.(c)	EUR	1,875 %	24/11/2051	1.205.508	0,10
4.760.000	Bonos del Estado de Bélgica – Serie 60 144A <sup>(d)</sup>	EUR	4,250 %	28/03/2041	8.106.709	0,66
610.000	Bonos del Estado de Bélgica – Serie 80 144A <sup>(d)</sup>	EUR	2,150 %	22/06/2066	911.718	0,07
2.700.000	KBC Group NV <sup>(c)</sup>	EUR	0,125 %	14/01/2029	2.631.771	0,22
		-			12.855.706	1,0
lelae Vírganaa Bri	itánicas					
Islas Vírgenes Bri 200 000	rtanicas China Cinda 2020 I Management Ltd.	USD	3,000 %	20/01/2031	172.147	0,0
	Huarong Finance 2017 Co., Ltd. (c)	USD	4,000 %	Perp.	295.821	0,0
	Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	USD	3,625 %	30/09/2030	323.043	0,03
	TSMC Global Ltd.	USD	2,250 %	23/04/2031	263.834	0,02
		-			1.054.845	0,09
					1.004.040	
Canadá	5 1 (1) 0 "	000	4.050.0/	47/40/0005	0 077 407	0.00
	Bank of Nova Scotia	GBP CAD	1,250 % 2,750 %	17/12/2025 01/12/2048	3.677.407 4.282.117	0,30
	Bonos del Estado de Canadá Provincia de Columbia Británica, Canadá	CAD	2,750 %	18/06/2025	1.300.467	0,35 0,1
	Provincia de Columbia Británica, Canadá – Serie BCCD	CAD	4,950 %	18/06/2040	1.028.890	0,1
	Provincia de Ontario, Canadá	CAD	2,600 %	02/06/2025	1.501.645	0,12
	Provincia de Ontario, Canadá	CAD	4,650 %	02/06/2041	723.204	0,06
500.000	Provincia de Quebec, Canadá	CAD	4,250 %	01/12/2043	440.385	0,04
1.050.000	Suncor Energy, Inc.	USD	3,100 %	15/05/2025	970.353	0,08
		•			13.924.468	1,14
Inter Online for						
Islas Caimán	Baidu, Inc.	USD	3,425 %	07/04/2030	706.606	0,06
	CK Hutchison International 20 Ltd.	USD	2,500 %	08/05/2030	179.416	0,00
	CK Hutchison International 21 Ltd.	USD	2,500 %	15/04/2031	556.899	0,05
	DP World Crescent Ltd.	USD	3,875 %	18/07/2029	187.283	0,01
7.920.000	SA Global Sukuk Ltd.	USD	2,694 %	17/06/2031	6.977.893	0,57
660.000	Tencent Holdings Ltd.	USD	3,595 %	19/01/2028	621.508	0,05
890.000	Tencent Holdings Ltd.	USD	2,880 %	22/04/2031	798.516	0,07
		-			10.028.121	0,82
China						
China 11 590 000	Agricultural Development Bank of China – Serie 1906	CNY	3,740 %	12/07/2029	1 655 087	0,14
	Agricultural Development Bank of China – Serie 2004	CNY	2,960 %	17/04/2030		1,08
	Agricultural Development Bank of China – Serie 2105	CNY	3,520 %	24/05/2031	4.935.490	0,41
	China Development Bank – Serie 1710	CNY	4,040 %	10/04/2027	699.984	0,06
	China Development Bank – Serie 1909	CNY	3,500 %	13/08/2026	2.412.255	0,20
36.900.000	China Development Bank – Serie 1915	CNY	3,450 %	20/09/2029	5.170.193	0,43
	China Development Bank – Serie 2010	CNY	3,090 %	18/06/2030		0,92
52.020.000	China Development Bank – Serie 2012	CNY	3,340 %	14/07/2025		0,60
	China Development Bank – Serie 2103	CNY	3,300 %	03/03/2026		0,82
	Bonos del Estado de China	CNY	1,990 %	09/04/2025	6.371.174	0,5
	Bonos del Estado de China Bonos del Estado de China	CNY	2,850 %	04/06/2027 03/12/2027	4.664.870 6.277.550	0,38
	Bonos del Estado de China Bonos del Estado de China	CNY CNY	3,280 % 3,390 %	16/03/2050	6.277.550 3.443.139	0,52 0,28
	Bonos del Estado de China – Serie 1824	CNY	4,080 %	22/10/2048	1.923.702	0,2
	Bonos del Estado de China – Serie 1827	CNY	3,250 %	22/11/2028	3.047.246	0,1
	Bonos del Estado de China – Serie 1906	CNY	3,290 %	23/05/2029	4.013.683	0,3
	Bonos del Estado de China – Serie 1907	CNY	3,250 %	06/06/2026	2.188.783	0,18
15.480.000	Donot do: Lotado do Crimia Corio 1001					
	Bonos del Estado de China – Serie 1910	CNY	3,860 %	22/07/2049	5.167.515	0,42

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en EUR	% de
	· · ·	Divisa	interes	recha de vencimiento.	ellEUK	patrinonic
Bonos – (contin	uacion)					
1 010 000	Bonos internacionales del Estado de Croacia	EUR	1,500 %	17/06/2031	1.017.070	0,08
	Borios internacionales del Estado de Oroacia	LOIX	1,500 70	17700/2001	1.017.070	
Dinamarca	Danske Bank A/S <sup>(c)</sup>	EUR	(0,018 %)	10/11/2024	2.377.470	0,19
	Danske Bank A/S <sup>(c)</sup>	EUR	1,375 %	12/02/2030	556.440	0,18
	Bonos del Estado de Dinamarca	DKK	4,500 %	15/11/2039	391.977	0,03
					3.325.887	0,27
Finlandia					3.323.007	
	SBB Treasury OYJ	EUR	0,750 %	14/12/2028	1.869.796	0,15
Francia						
3.300.000	Agence Francaise de Developpement EPIC	EUR	0,125 %	29/09/2031	3.289.308	0,27
1.300.000	BNP Paribas S.A.	EUR	1,125 %	22/11/2023	1.331.291	0,11
	BNP Paribas S.A. (c)	EUR	0,875 %	31/08/2033	2.033.115	0,17
	BPCE S.A. – Serie NC5 <sup>(c)</sup>	EUR	1,500 %	13/01/2042	992.700	0,08
	Caisse Centrale du Credit Immobilier de France S.A.	EUR	(0,472 %)	17/01/2024	1.010.620	0,08
	Crédit Agricole S.A. (c)	EUR	1,625 %	05/06/2030	718.585	0,06
	Crédit Agricole S.A.(c)	GBP	1,874 %	09/12/2031	1.037.627	0,09
	Électricité de France S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	2,875 %	Perp.	2.050.000	0,17
	EssilorLuxottica S.A.	USD	2,500 %	30/06/2022	1.066.527	0,09
	Bonos del Estado de Francia OAT	EUR	3,250 %	25/05/2045	4.440.840	0,36
	Bonos del Estado de Francia OAT 144A <sup>(d)</sup>	EUR	1,750 %	25/05/2066	881.205	0,07
	La Mondiale SAM	EUR	0,750 %	20/04/2026	601.320	0,05
	La Mondiale SAM	EUR	2,125 %	23/06/2031	1.882.620	0,16
400.000		EUR	(0,354 %)	21/03/2022	400.428	0,03
	Société Générale S.A.(c)	EUR	0,875 %	22/09/2028	403.764	0,03
	Société Générale S.A.(c)	EUR	1,125 %	30/06/2031	1.990.300	0,16
1.100.000	Valeo S.A.	EUR	1,000 %	03/08/2028	1.062.363	0,09
					25.192.613	2,07
Alemania	Allianz S.E.(c)	EUR	2,625 %	Perp.	1.742.184	0,14
	Allianz S.E. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,200 %	Perp.	1.327.044	0,11
	Bayerische Landesbank <sup>(c)</sup>	EUR	1,184 %	23/09/2031	893.772	0,07
	Commerzbank AG <sup>(c)</sup>	EUR	4,000 %	05/12/2030	543.125	0,04
	Commerzbank AG <sup>(c)</sup>	EUR	1,375 %	29/12/2031	1.668.125	0,14
	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	USD	2,222 %	18/09/2024	849.143	0,07
	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	USD	2,129 %	24/11/2026	484.808	0,04
	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	EUR	1,750 %	19/11/2030	3.546.982	0,29
2.075.000	Deutsche Bank AG – Serie E	USD	0,962 %	08/11/2023	1.823.723	0,15
900.000		EUR	0,625 %	22/02/2027	945.963	0,08
1.000.000	KFW	EUR	0,625 %	07/01/2028	1.056.890	0,09
					14.881.759	1,22
Hong Kong						-
290.000	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	USD	3,875 %	19/06/2029	273.631	0,02
Hungría	5	EUD	4.500.0/	47/44/0050	04.404	0.04
	Bonos internacionales del Estado de Hungría	EUR	1,500 %	17/11/2050	94.404	0,01
Indonesia	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	4,125 %	15/01/2025	1 12/ 500	0,09
	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	EUR	•	24/04/2025	1.124.588 4.474.150	0,08
	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	1,750 % 3,350 %	12/03/2071	783.781	0,37
	Bonos del Tesoro de Indonesia – Serie FR73	IDR	8,750 %	15/05/2031	878.068	0,00
	Pertamina Persero PT	USD	2,300 %	09/02/2031	291.064	0,07
	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III	USD	4,550 %	29/03/2026	1.029.006	0,02
	· orden dan i onosin ober macrosia m	002			8.580.657	0,70
 Irlanda					5.560.057	
	Abbott Ireland Financing DAC	EUR	0,875 %	27/09/2023	765.525	0,06
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	3,500 %	26/05/2022	322.797	0,03
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	4,625 %	01/07/2022	1.483.368	0,12
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	3,000 %	29/10/2028	1.152.799	0,09
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	3,300 %	30/01/2032	664.734	0,05
	AIB Group Pic.(c)	EUR	0,500 %	17/11/2027	1.814.032	0,15
	AIB Group Plc. (c)	EUR	1,875 %	19/11/2029	508.125	0,04
	AIB Group Plc. (c)	EUR	2,875 %	30/05/2031	1.153.328	0,10
	and the second s					
1.300.000	Bank of Ireland Group Plc.(c)	EUR	0,375 %	10/05/2027	1.285.206	0,11

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en EUR	% de patrimonio
Bonos – (contini	uación)					
Irlanda – (continu	ación)					
800.000	Dell Bank International DAC	EUR	0,625 %	17/10/2022	805.960	0,07
	Dell Bank International DAC	EUR	1,625 %	24/06/2024	1.972.124	0,16
	Bonos del Estado de Irlanda	EUR	0,200 %	18/10/2030	2.028.506	0,17
	Bonos del Estado de Irlanda	EUR	0,106 %	18/10/2031	534.362	0,04
1.475.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. (c)	USD	3,000 %	19/04/2051	1.247.433	0,10
Israel					17.410.136	1,43
	Bono del Estado de Israel - Fijo – Serie 327	ILS	2,000 %	31/03/2027	501.562	0,04
1.200.000	Bonos internacionales del Estado de Israel	USD	3,800 %	13/05/2060	1.205.739	0,10
					1.707.301	0,14
1talia	Engl SpA Sorio & F. a(f)	EUR	1,375 %	Porn	2.363.211	0.20
	Enel SpA – Serie 6,5 a <sup>(c)</sup> Intesa Sanpaolo SpA	EUR	0,625 %	Perp. 24/02/2026	1.689.069	0,20 0,14
	Intesa Sanpaolo SpA	EUR	1,350 %	24/02/2020	1.205.045	0,12
	Buoni poliennali del Tesoro Italia	EUR	0,050 %	15/01/2023	342.244	0,03
	Buoni poliennali del Tesoro Italia	EUR	(0,335 %)	15/01/2024		1,6
	Buoni poliennali del Tesoro Italia	EUR	0,144 %		1.502.405	0,12
	Buoni poliennali del Tesoro Italia	EUR	6,500 %	01/11/2027	3.699.445	0,12
	Buoni poliennali del Tesoro Italia	EUR	2,800 %	01/11/2027	1.459.723	0,30
	Buoni poliennali del Tesoro Italia	EUR	2,800 % 0,950 %	01/08/2030	894.256	0,12
	Buoni poliennali del Tesoro Italia	EUR	6,000 %	01/05/2031		0,07
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup>	EUR	3,500 %	01/03/2031	1.856.122	0,08
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup>	EUR	2,950 %	01/09/2038	5.113.728	0,10
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup>	EUR	2,800 %		1.079.358	0,42
	UniCredit SpA <sup>(c)</sup>	EUR	2,200 %	22/07/2027	526.255	0,04
	UniCredit SpA <sup>(c)</sup>	EUR	2,731 %	15/01/2032	505.625	0,04
					52.718.271	4,32
Japón 1 830 000 000	Bono del Estado de Japón – Serie 14	JPY	0,700 %	20/03/2061	14 110 556	1,16
	Bono del Estado de Japón – Serie 141	JPY	0,100 %	20/09/2024		1,10
	Bono del Estado de Japón – Serie 141  Bono del Estado de Japón – Serie 150	JPY	1,400 %		9.476.433	0,78
	Bono del Estado de Japón – Serie 130	JPY	0,300 %	20/06/2039	293.054	0,70
	Bono del Estado de Japón – Serie 103	JPY	0,300 %		3.617.757	0,02
	Bono del Estado de Japón – Serie 176	JPY	0,500 %	20/03/2041	63.199	0,00
	Bono del Estado de Japón – Serie 178	JPY	0,500 %	20/09/2041		1,12
	Bono del Estado de Japón – Serie 34	JPY	2,200 %	20/03/2041	258.732	0,02
	Bono del Estado de Japón – Serie 354	JPY	0,100 %	20/03/2029	7.311.825	0,60
	Bono del Estado de Japón – Serie 364	JPY	0,100 %	20/09/2031	603.808	0,0
	Bono del Estado de Japón – Serie 430	JPY	0,005 %	01/11/2023		4,26
	Bono del Estado de Japón – Serie 71	JPY	0,700 %	20/06/2051	355.912	0,03
	Bono del Estado de Japón – Serie 72	JPY	0,700 %		9.208.923	0,75
	Depósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1018	JPY	(0,163 %)	25/02/2022		4,91
	Depósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028	JPY	(0,147 %)	11/04/2022		7,56
	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	EUR	0,339 %	19/07/2024	655.863	0,05
	Nomura Holdings, Inc.	USD	2,608 %		1.020.815	0,08
	Norinchukin Bank 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,284 %	22/09/2026	2.556.601	0,21
				2	81.984.629	23,12
Jersey 200,000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,625 %	31/03/2036	171.815	0,01
	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.  Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,940 %	30/09/2040	2.587.345	0,0
	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.  Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,940 % 3,250 %	30/09/2040	237.883	0,02
	Gatwick Funding Ltd.	GBP	2,500 %	15/04/2030	557.485	0,02
	Heathrow Funding Ltd.	EUR	1,125 %	08/10/2030	1.170.876	0,10
					4.725.404	0,39
Kazajistán 200.000	KazMunayGas National Co., JSC	USD	6,375 %	24/10/2048	222.389	0,02
Luxemburgo			-,0.0 /0	2 13,2040		
_	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR	2,000 %	15/02/2024	569.239	0,05
	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR	1,000 %	04/05/2028	1.076.020	0,09
	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	GBP	2,625 %	20/10/2028	1.225.752	0,10
	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR	1,750 %	12/03/2029	2.598.947	0,21
	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR	1,625 %	20/04/2030	1.631.402	0,13
760.000	Fondo Europeo de Estabilidad Financiera	EUR	0,875 %	10/04/2035	828.134	0,07

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en EUR	% del patrimonio
	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	2.77.00				
Bonos – (contin	•					
Luxemburgo – (co	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.	USD	8,625 %	28/04/2034	135.536	0,01
	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.	USD	7,288 %	16/08/2037	268.588	0,02
	Helvetia Europe S.A.(c)	EUR	2,750 %	30/09/2041	649.686	0,02
	Logicor Financing SARL	EUR	0,750 %	15/07/2024	658.502	0,06
	Logicor Financing SARL	EUR	1,625 %	15/07/2027	1.979.705	0,16
	Medtronic Global Holdings S.C.A.	EUR	0,375 %	07/03/2023	1.007.950	0,08
	Medtronic Global Holdings S.C.A.	EUR	0,250 %	02/07/2025	352.748	0,03
	3 <b>3</b>				13.192.474	1,08
México					10.102.474	
	Mexico City Airport Trust	USD	4,250 %	31/10/2026	185.222	0,02
	Mexico City Airport Trust	USD	5,500 %	31/07/2047	169.794	0,02
	Mexico City Airport Trust 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,875 %	30/04/2028	262.031	0,02
	Mexico City Airport Trust 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,500 %	31/07/2047	254.691	0,02
	Bonos internacionales del Estado de México	USD	3,250 %	16/04/2030	295.361	0,02
	Bonos internacionales del Estado de México	USD	3,771 %	24/05/2061	1.293.396	0,11
	Bonos internacionales del Estado de México	USD	3,750 %	19/04/2071	799.457	0,07
					3.259.952	0,27
Países Bajos						
	ABN AMRO Bank NV <sup>(c)</sup>	EUR	4,375 %	Perp.	1.052.910	0,09
	ABN AMRO Bank NV 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,750 %	28/07/2025	1.013.023	0,08
	Airbus S.E.	EUR	2,375 %	09/06/2040	1.754.522	0,14
1.025.000	Akelius Residential Property Financing BV	EUR	0,750 %	22/02/2030	979.931	0,08
	BAT Netherlands Finance BV	EUR	3.125 %	07/04/2028	669.120	0,06
1.010.000	BNG Bank NV	GBP	0,375 %	15/12/2025	1.162.610	0,10
	Cooperatieve Rabobank UA	EUR	3,875 %	25/07/2023	480.861	0,04
	Heimstaden Bostad Treasury BV	EUR	1,625 %	13/10/2031	2.744.892	0,23
	Iberdrola International BV – Serie NC6 <sup>(c)</sup>	EUR	1,450 %	Perp.	1.497.270	0,12
400.000	ING Groep NV	EUR	1,000 %	20/09/2023	408.292	0,03
400.000	ING Groep NV <sup>(c)</sup>	EUR	2,125 %	26/05/2031	419.036	0,03
1.200.000	ING Groep NV <sup>(c)</sup>	EUR	1,099 %	16/11/2032	1.189.224	0,10
600.000	ING Groep NV <sup>(c)</sup>	USD	6,750 %	Perp.	568.177	0,05
2.700.000	JAB Holdings BV	EUR	1,000 %	20/12/2027	2.752.191	0,23
250.000	Koninklijke Philips NV	EUR	1,375 %	30/03/2025	260.595	0,02
2.830.000	Lukoil Securities BV	USD	3,875 %	06/05/2030	2.551.189	0,21
2.710.000	Prosus NV	USD	3,680 %	21/01/2030	2.430.419	0,20
150.000	Prosus NV	EUR	2,031 %	03/08/2032	148.125	0,01
210.000	Prosus NV	USD	4,027 %	03/08/2050	172.562	0,01
	Technip Energies NV	EUR	1,125 %	28/05/2028	2.327.738	0,19
1.350.000	Thermo Fisher Scientific Finance I BV	EUR	0,070 %	18/11/2025	1.347.395	0,11
1.300.000	Volkswagen International Finance NV <sup>(c)</sup>	EUR	3,500 %	Perp.	1.385.371	0,11
	Volkswagen International Finance NV <sup>(c)</sup>	EUR	4,625 %	Perp.	1.132.470	0,09
	Wintershall Dea Finance BV	EUR	0,840 %	25/09/2025	406.872	0,03
	Wintershall Dea Finance BV	EUR	1,332 %	25/09/2028	1.641.168	0,14
	WPC Eurobond BV	EUR	1,350 %	15/04/2028	2.857.624	0,23
600.000	WPC Eurobond BV	EUR .	0,950 %	01/06/2030	586.422	0,05
_					33.940.009	2,78
Panamá	Ponos internacionales del Fetade de Bernard	HOD	4 E00 0/	46/04/0050	272.024	0.00
	Bonos internacionales del Estado de Panamá Bonos internacionales del Estado de Panamá	USD USD	4,500 % 3,870 %	16/04/2050 23/07/2060	272.934 169.776	0,02 0,02
200.000	Bonos internacionales del Estado de Panama	050	3,670 %	23/07/2060		
					442.710	0,04
Perú 270.000	Bonos internacionales del Estado de Perú	USD	3,230 %	28/07/2121	195.515	0,02
Portugal						
-	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 144A <sup>(d)</sup>	EUR	1,950 %	15/06/2029	1.834.000	0,15
Catar						_
	Qatar Energy	USD	2,250 %	12/07/2031	416.575	0,03
1.600.000	Qatar Energy	USD	3,125 %	12/07/2041	1.412.488	0,12
1.500.000	Qatar Energy	USD	3,300 %	12/07/2051	1.353.703	0,11
200.000	Bonos internacionales del Estado de Catar	USD	3,875 %	23/04/2023	183.328	0,01
6.490.000	Bonos internacionales del Estado de Catar	USD	4,500 %	23/04/2028	6.545.038	0,54
	Bonos internacionales del Estado de Catar	USD	3,750 %	16/04/2030	4.607.679	0,38
	Bonos internacionales del Estado de Catar	USD	5,103 %	23/04/2048	410.835	0,03
					14.929.646	1,22
					14.525.040	1,22

			Tipo de		Valor de mercado	% del
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en EUR	patrimonio
Bonos – (contin	uación)					
Rumanía 560 000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	USD	3,000 %	14/02/2031	486.004	0,04
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,000 %	28/01/2032	65.013	0,01
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	USD	6,125 %	22/01/2044	882.618	0,07
410.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	USD	5,125 %	15/06/2048	412.126	0,03
380.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	3,375 %	28/01/2050	356.487	0,03
360.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	USD	4,000 %	14/02/2051	308.674	0,03
					2.510.922	0,21
Rusia						
17.600.000	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6212	RUB	7,050 %	19/01/2028	195.380	0,02
3.200.000	Bonos extranjeros rusos – Eurobono	USD	4,750 %	27/05/2026	3.103.395	0,25
					3.298.775	0,27
Arabia Saudí						
220.000	Bonos internacionales del Estado saudí	USD	3,250 %	22/10/2030	205.794	0,01
	Bonos internacionales del Estado saudí	USD	3,250 %	17/11/2051	462.477	0,04
310.000	Bonos internacionales del Estado saudí	USD	4,500 %	22/04/2060	329.657	0,03
					997.928	0,08
Corea del Sur						
	Bonos del Tesoro de Corea indexados a la inflación – Serie 2606	KRW	1,000 %	10/06/2026	885.163	0,07
	Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906	KRW	1,875 %	10/06/2029	1.244.827	0,10
	Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2912	KRW	1,375 %	10/12/2029	6.563.359	0,54
7.131.800.000	Bonos del Tesoro de Corea – Serie 3106	KRW	2,000 %	10/06/2031	5.234.029	0,43
					13.927.378	1,14
España	About's Informations O.A.	EUD	0.075.0/	07/00/0007	047.050	0.00
	Abertis Infraestructuras S.A. Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	EUR EUR	2,375 % 0,750 %	27/09/2027 11/09/2022	217.652 403.520	0,02 0,03
	Banco Santander S.A.	USD	2,706 %	27/06/2024	730.613	0,03
	Banco Santander S.A.	EUR	1,375 %	05/01/2026	416.272	0,00
	Banco Santander S.A.	USD	3,490 %	28/05/2030	372.088	0,03
1.600.000	Banco Santander S.A.	USD	2,749 %	03/12/2030	1.377.151	0,11
1.500.000	Banco Santander S.A.(c)	GBP	2,250 %	04/10/2032	1.736.124	0,14
300.000	CaixaBank S.A.	EUR	1,125 %	17/05/2024	307.602	0,03
	CaixaBank S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	0,375 %	18/11/2026	1.988.320	0,16
	Cellnex Finance Co., S.A.	EUR	0,750 %	15/11/2026	591.057	0,05
	Cellnex Finance Co., S.A.	EUR EUR	1,500 %	08/06/2028 15/01/2029	2.165.625 672.084	0,18 0,06
	Cellnex Finance Co., S.A. Cellnex Finance Co., S.A.	EUR	1,250 % 2,000 %	15/02/2033	668.825	0,06
	Cellnex Finance Co., S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,875 %	07/07/2041	422.397	0,00
	FCC Aqualia S.A.	EUR	2,629 %	08/06/2027	524.343	0,04
	FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU	EUR	1,661 %	04/12/2026	211.626	0,02
1.000.000	Iberdrola Finanzas S.A.(c)	EUR	1,575 %	Perp.	996.250	0,08
	Bonos del Estado de España 144A <sup>(d)</sup>	EUR	1,500 %	30/04/2027	9.063.374	0,74
	Bonos del Estado de España 144A <sup>(d)</sup>	EUR	1,250 %	31/10/2030		0,97
	Bonos del Estado de España 144A <sup>(d)</sup>	EUR	0,100 %	30/04/2031	7.491.020	0,61
1.360.000	Bonos del Estado de España 144A <sup>(d)</sup>	EUR	3,450 %	30/07/2066	2.172.083	0,18
					44.396.600	3,64
Supranacionales			2			_
	African Export-Import Bank	USD	2,634 %	17/05/2026	555.370	0,04
	African Export-Import Bank	USD	3,798 %	17/05/2031	660.878	0,05
	Banco Europeo de Inversiones	SEK	1,750 %	12/11/2026	701.164	0,06
	Banco Europeo de Inversiones Banco Europeo de Inversiones	EUR	0,875 %	14/01/2028	2.156.690	0,18
	Banco Europeo de Inversiones Banco Europeo de Inversiones	EUR EUR	0,200 % 1,000 %	17/03/2036 14/11/2042	3.210.791 1.193.587	0,26 0,10
	Unión Europea	EUR	(0,449 %)	06/07/2026	3.494.795	0,10
	Unión Europea	EUR	(0,449 %)	04/10/2028	733.925	0,29
	Unión Europea	EUR	(0,074 %)	22/04/2031	4.484.131	0,00
	Unión Europea	EUR	(0,061 %)	04/07/2031	1.046.739	0,08
	Unión Europea	EUR	0,400 %	04/02/2037	815.841	0,07
	International Development Association	GBP	0,750 %	21/09/2028	1.570.183	0,13
					20.624.094	1,69
Suecia						
350.000	Heimstaden Bostad AB	EUR	1,125 %	21/01/2026	357.084	0,03
1.700.000	Volvo Treasury AB	EUR	0,125 %	17/09/2024	1.709.316	0,14
					2.066.400	0,17
					∠.000.400	

Tenenc	iaa	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en EUR	% del
		· ·	DIVISA	interes	recha de vencimiento	encok	patrimonio
	s – (contini	uacion)					
Suiza	1 100 000	Credit Suisse AG	USD	2,950 %	09/04/2025	1.017.576	0,08
		Crédit Suisse Group AG <sup>(c)</sup>	EUR	3,250 %	02/04/2026	763.357	0,06
		Crédit Suisse Group AG <sup>(c)</sup>	EUR	0,650 %	14/01/2028	1.386.784	0,11
		Credit Suisse Group AG 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	2,593 %	11/09/2025	1.172.153	0,10
	3.150.000	UBS AG	GBP	0,625 %	18/12/2023	3.671.859	0,30
	2.875.000	UBS Group AG <sup>(c)</sup>	EUR	0,250 %	03/11/2026	2.866.806	0,24
						10.878.535	0,89
Tailand	dia						
	72.680.000	Bonos del Estado de Tailandia	THB	1,875 %	17/06/2022	1.909.397	0,16
		Bonos del Estado de Tailandia	THB	3,625 %	16/06/2023	833.525	0,0
		Bonos del Estado de Tailandia	THB	2,400 %	17/12/2023	2.204.315	0,18
		Bonos del Estado de Tailandia	THB	1,600 %	17/12/2029	2.270.358	0,18
	19.220.000	Bonos del Estado de Tailandia	THB	1,585 %	17/12/2035	459.599	0,04
						7.677.194	0,63
Emirat	os Árabes I		Hen	4 600 0/	00/44/0047	902 020	0.00
		Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC Bonos internacionales del Estado de Abu Dabi	USD USD	4,600 % 3,125 %	02/11/2047 11/10/2027	802.039 481.605	0,07 0,04
		DP World Plc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,125 % 6,850 %	02/07/2037	115.679	0,02
	100.000	DE WORD FIG. 144A	030	0,830 %	02/07/2037		
						1.399.323	0,12
Reino		Avivo Plo (C)	GBP	6 405 0/	4.4.4.4.10000	602 540	0.01
		Aviva Plc. (c) Barclays Plc. (c)		6,125 %	14/11/2036	623.542 575.851	0,05
		Barclays Pic. (c)	USD EUR	4,610 % 3,375 %	15/02/2023 02/04/2025	1.180.608	0,05 0,10
		Barclays Pic. <sup>(c)</sup>	USD	2,279 %	24/11/2027	1.852.617	0,10
		Barclays Plc.(c)	GBP	3,750 %	22/11/2030	1.921.875	0,16
		BAT International Finance Plc.	GBP	2,250 %	26/06/2028	696.690	0,06
		BP Capital Markets Plc.	USD	3,814 %	10/02/2024	186.263	0,02
	500.000	BP Capital Markets Plc.(c)	EUR	3,250 %	Perp.	528.160	0,04
	450.000	BP Capital Markets Plc.(c)	EUR	3,625 %	Perp.	483.097	0,04
		Gazprom PJSC Via Gaz Finance Plc.	USD	3,250 %	25/02/2030	799.299	0,07
		HSBC Holdings Plc. (c)	USD	3,803 %	11/03/2025	2.643.735	0,22
		HSBC Holdings Plc.	USD	4,950 %	31/03/2030	827.019	0,07
		Legal & General Group Plc.(c)	GBP	3,750 %	26/11/2049	554.915	0,05
		M&G Plc. <sup>(c)</sup> Nationwide Building Society 144A <sup>(c)(d)</sup>	GBP USD	6,340 % 3,960 %	19/12/2063 18/07/2030	150.925 1.897.969	0,01 0,16
		NatWest Group Plc. (c)	USD	3,498 %	15/05/2023	756.286	0,16
		NatWest Group Plc. <sup>(c)</sup>	USD	1,642 %	14/06/2027	1.279.504	0,10
		NatWest Group Plc. <sup>(c)</sup>	GBP	2,105 %	28/11/2031	2.251.466	0,18
		NatWest Group Plc. (c)	EUR	1,043 %	14/09/2032	1.054.118	0,09
	400.000	Pension Insurance Corp., Plc.	GBP	4,625 %	07/05/2031	521.263	0,04
	600.000	Phoenix Group Holdings Plc.	GBP	5,625 %	28/04/2031	835.644	0,07
	775.000	Pinewood Finance Co., Ltd.	GBP	3,250 %	30/09/2025	915.842	0,07
		Santander UK Group Holdings Plc.(c)	USD	1,089 %	15/03/2025	2.312.673	0,19
		Santander UK Group Holdings Plc.(c)	USD	1,532 %	21/08/2026	1.305.474	0,1
		Standard Chartered Plc. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,214 %	23/03/2025	546.947	0,04
		Standard Chartered Plc. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,456 %	14/01/2027		0,21
		Swiss Re Finance UK Plc.(c)	EUR	2,714 %	04/06/2052		0,1
		Tesco Corporate Treasury Services Plc. Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP GBP	1,875 % 4,500 %	02/11/2028 07/09/2034	1.853.220 2.259.454	0,15 0,19
		Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)  Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	4,500 % 3,250 %	22/01/2044		0,18
		Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	3,500 %	22/01/2045	1.495.355	0,10
		Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	4,250 %	07/12/2046	1.184.847	0,12
		Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	1,500 %	31/07/2053		0,20
	3.650.000	Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	1,750 %	22/07/2057	5.595.530	0,46
	1.100.000	Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	3,500 %	22/07/2068	2.775.428	0,23
	975.000	Virgin Money UK Plc. <sup>(c)</sup>	EUR	0,375 %	27/05/2024	979.885	0,08
						51.311.503	4,21
Estado	s Unidos						
		AbbVie, Inc.	USD	2,300 %	21/11/2022	580.193	0,0
		AbbVie, Inc.	USD	3,750 %	14/11/2023	323.839	0,03
		AbbVie, Inc.	USD	2,600 %	21/11/2024	1.186.217	0,10
		Air Lease Corp.	USD	3,250 %	01/03/2025	2.340.100	0,19
		Air Lease Corp.	USD	2,875 %	15/01/2026	701.644	0,06
		American Express Co.	USD	2,500 %	15/09/2024	90.807	0,0
		American Express Co. American Express Co.	USD USD	2,500 % 2,500 %	01/08/2022 30/07/2024	315.892 263.963	0,03 0,02
	200.000	ranonour Express oo.	030	2,000 /0	30/01/2024	200.800	0,02

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en EUR	% del patrimonio
Bonos - (contin	uación)					
Estados Unidos -	·					
125.000	American International Group, Inc.	USD	4,125 %	15/02/2024	117.243	0,01
	American International Group, Inc.	USD	3,900 %	01/04/2026	2.304.977	0,19
	Anheuser-Busch Cos., LLC Via Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	USD USD	4,900 %	01/02/2046	1.170.442	0,10
	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. AT&T, Inc.	USD	4,600 % 3,000 %	15/04/2048 30/06/2022	1.132.682 221.923	0,09 0,02
	AT&T, Inc.	USD	2,550 %	01/12/2033	599.827	0,02
	AT&T, Inc.	EUR	1,800 %	14/09/2039	559.482	0,04
150.000	AT&T, Inc.	USD	4,350 %	15/06/2045	149.773	0,01
	AT&T, Inc.	USD	4,850 %	15/07/2045	53.707	0,00
	AT&T, Inc.	USD	5,450 %	01/03/2047	641.206	0,05
	AT&T, Inc.	USD	4,500 %	09/03/2048	675.889	0,06
	AT&T, Inc. AutoNation, Inc.	USD USD	3,650 % 1,950 %	01/06/2051 01/08/2028	1.190.570 366.459	0,10 0,03
	Bank of America Corp. (c)	USD	3,366 %	23/01/2026	8.928.160	0,03
	Bank of America Corp. (c)	EUR	3,648 %	31/03/2029	1.006.026	0,08
	Bank of America Corp.(c)	USD	2,592 %	29/04/2031	378.262	0,03
771.000	Becton Dickinson and Co.	USD	3,363 %	06/06/2024	711.947	0,06
4.300.000	Becton Dickinson and Co.	USD	3,700 %	06/06/2027	4.108.853	0,34
	Boeing Co.	USD	5,150 %	01/05/2030	766.656	0,06
	BP Capital Markets America, Inc.	USD	3,790 %	06/02/2024	652.125	0,05
	Capital One Financial Corp.	USD	3,500 %	15/06/2023	503.857	0,04
	Capital One Financial Corp.	USD USD	3,300 %	30/10/2024 29/10/2025	543.155 1.100.810	0,04 0,09
	Capital One Financial Corp. Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications	USD	4,200 %	29/10/2025	1.100.610	0,09
	Operating Capital Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications	USD	4,500 %	01/02/2024	844.126	0,07
	Operating Capital Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications	USD	4,908 %	23/07/2025	5.760.658	0,47
	Operating Capital	USD	4,800 %	01/03/2050	1.444.507	0,12
	Citigroup, Inc.	USD	3,500 %	15/05/2023	1.194.594	0,10
	Citigroup, Inc.	GBP	2,750 %	24/01/2024	666.781	0,05
	Citigroup, Inc. <sup>(c)</sup> Citigroup, Inc. <sup>(c)</sup>	USD USD	0,776 % 3,106 %	30/10/2024 08/04/2026	2.493.752 6.301.958	0,20 0,52
	Citigroup, Inc.(c)	USD	4,412 %	31/03/2031	50.240	0,00
	Citizens Bank NA Via Providence RI	USD	3,250 %	14/02/2022	242.539	0,02
	Comcast Corp.	USD	3,700 %	15/04/2024	746.980	0,06
600.000	Comcast Corp.	USD	3,950 %	15/10/2025	576.271	0,05
1.250.000	Constellation Brands, Inc.	USD	3,200 %	15/02/2023	1.128.839	0,09
	Constellation Brands, Inc.	USD	4,400 %	15/11/2025	2.232.748	0,18
	Constellation Brands, Inc.	USD	3,700 %	06/12/2026	622.214	0,05
	CVS Health Corp.	USD USD	3,700 % 2,625 %	09/03/2023 15/08/2024	120.165 300.861	0,01 0,02
	CVS Health Corp.  Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	6,020 %	15/06/2024	3.653.642	0,30
	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	4,900 %	01/10/2026	797.026	0,07
	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	5,300 %	01/10/2029	1.806.955	0,15
	DTE Energy Co.	USD	2,250 %	01/11/2022	511.316	0,04
1.700.000	DuPont de Nemours, Inc.	USD	4,493 %	15/11/2025	1.655.716	0,14
	Energy Transfer LP	USD	5,300 %	01/04/2044	252.984	0,02
	Energy Transfer LP	USD	5,400 %	01/10/2047	52.065	0,00
	Energy Transfer LP	USD	5,000 %	15/05/2050	604.445	0,05
	Enterprise Products Operating LLC Expedia Group, Inc.	USD USD	3,750 % 3,250 %	15/02/2025 15/02/2030	1.882.479	0,15 0,07
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	6,750 %	15/03/2031	814.694 635.984	0,07
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	6,625 %	15/11/2030	751.369	0,06
	Fidelity National Information Services, Inc.	EUR	0,750 %	21/05/2023	354.189	0,03
550.000	Fidelity National Information Services, Inc.	EUR	0,625 %	03/12/2025	557.012	0,05
630.000	Fifth Third Bancorp	USD	2,375 %	28/01/2025	571.509	0,05
1.700.000	General Electric Co.	USD	6,750 %	15/03/2032	2.077.021	0,17
	General Motors Co.	USD	5,400 %	02/10/2023	663.715	0,05
	General Motors Financial Co., Inc.	USD	1,500 %	10/06/2026	1.297.499	0,11
	General Motors Financial Co., Inc.	USD	5,650 %	17/01/2029	733.159	0,06
	Hewlett Packard Enterprise Co. Hewlett Packard Enterprise Co.	USD USD	4,450 % 4,900 %	02/10/2023 15/10/2025	1.210.621 4.234.989	0,10 0,35
	Hewlett Packard Enterprise Co.	USD	6,350 %	15/10/2045	535.499	0,33
	Huntington National Bank	USD	1,800 %	03/02/2023	289.425	0,02
	JPMorgan Chase & Co. <sup>(c)</sup>	USD	3,559 %	23/04/2024	301.186	0,03
	JPMorgan Chase & Co. <sup>(c)</sup>	USD	3,797 %	23/07/2024	298.991	0,02
800.000	JPMorgan Chase & Co.(c)	USD	2,956 %	13/05/2031	727.667	0,06
	Keurig Dr Pepper, Inc.	USD	2,550 %	15/09/2026	1.374.816	0,11
	Kinder Morgan Energy Partners LP	USD	4,300 %	01/05/2024	46.932	0,00
600.000	Marathon Petroleum Corp.	USD	3,800 %	01/04/2028	571.050	0,05

Jación) S Corp. Stanley(c) P P I Retail Properties, Inc. Ital Petroleum Corp. Ital Italian	USD	3,100 % 2,484 % 4,500 % 5,500 % 5,550 % 6,450 % 1,100 % 0,900 % 2,500 % 3,300 % 3,500 % 4,625 % 5,750 % 5,625 % 5,750 % 3,250 % 3,400 % 3,500 % 3,500 % 3,500 % 3,400 % 3,500 % 3,500 % 3,400 % 4,625 % 5,750 % 3,250 % 3,400 % 4,329 % 2,550 % 3,000 % 4,329 % 2,550 %	15/04/2025 15/04/2027	1.242.436 1.399.015 245.997 223.166 383.728 287.384 329.569 2.314.117 1.315.533 253.164 125.591 209.590 321.860 508.807 1.935.945 1.154.725 2.059.913 300.534 568.459 1.116.273 602.334 1.782.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055	0,10 0,12 0,02 0,03 0,03 0,03 0,15 0,11 0,02 0,01 0,04 0,16 0,17 0,02 0,05 0,05 0,05 0,05 0,05 0,05 0,05
S Corp. Stanley(c) P P P Retail Properties, Inc. Ital Petroleum Corp. Ital Petroleum Corp. Ital Petroleum Corp. Sas and Electric Co. Sas and Electric Co. Sas and Electric Co. Natural Resources Co. Inancial Services Group, Inc. Income Corp. Pass Liquefaction LLC Pass Liquefaction LLC Inancing USA LLC Inancing USA LLC Inancing USA LC Inc. In Co.	USD	2,484 % 4,500 % 5,500 % 3,900 % 5,550 % 6,450 % 1,100 % 2,550 % 3,300 % 3,500 % 1,125 % 3,500 % 4,625 % 5,750 % 5,625 % 5,750 % 3,250 % 3,400 % 1,650 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 %	16/09/2036 15/04/2038 15/04/2038 15/02/2049 15/06/2024 15/03/2026 15/09/2036 11/03/2024 08/11/2024 01/02/2031 01/08/2050 15/01/2026 23/01/2024 01/11/2025 15/05/2024 01/03/2025 27/03/2024 01/07/2026 15/01/203 01/07/2026 15/01/203 15/01/2031 15/04/2031 15/04/2031 15/02/2031 15/02/2031	1.399.015 245.997 223.166 383.728 287.384 329.569 2.314.117 1.315.533 253.164 125.591 209.590 321.860 508.807 1.935.945 1.154.725 2.059.913 300.534 568.459 1.116.273 602.334 1.782.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,12 0,02 0,03 0,03 0,03 0,04 0,05 0,07 0,02 0,03 0,04 0,16 0,17 0,02 0,06 0,06 0,06 0,06 0,06 0,06 0,06
Stanley(c) P P P I Retail Properties, Inc. Ital Petroleum Corp. Ital Services Group. Ital Services Group, Inc. Income Corp. Ital Petroleum Corp. Ital Petrol	USD	2,484 % 4,500 % 5,500 % 3,900 % 5,550 % 6,450 % 1,100 % 2,550 % 3,300 % 3,500 % 1,125 % 3,500 % 4,625 % 5,750 % 5,625 % 5,750 % 3,250 % 3,400 % 1,650 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 %	16/09/2036 15/04/2038 15/04/2038 15/02/2049 15/06/2024 15/03/2026 15/09/2036 11/03/2024 08/11/2024 01/02/2031 01/08/2050 15/01/2026 23/01/2024 01/11/2025 15/05/2024 01/03/2025 27/03/2024 01/07/2026 15/01/203 01/07/2026 15/01/203 15/01/2031 15/04/2031 15/04/2031 15/02/2031 15/02/2031	1.399.015 245.997 223.166 383.728 287.384 329.569 2.314.117 1.315.533 253.164 125.591 209.590 321.860 508.807 1.935.945 1.154.725 2.059.913 300.534 568.459 1.116.273 602.334 1.782.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,12 0,02 0,03 0,03 0,03 0,04 0,05 0,07 0,02 0,03 0,04 0,16 0,17 0,02 0,06 0,06 0,06 0,06 0,06 0,06 0,06
P P R Retail Properties, Inc. Ital Petroleum Corp. Ital Italian Italia	USD	4,500 % 5,500 % 3,900 % 5,550 % 6,450 % 1,100 % 0,900 % 2,500 % 3,300 % 3,500 % 1,125 % 5,750 % 5,625 % 5,750 % 3,250 % 3,400 % 1,650 % 3,750 % 3,750 % 3,875 % 2,550 % 3,000 % 4,329 % 2,550 %	15/04/2038 15/02/2049 15/06/2024 15/03/2026 15/09/2036 11/03/2024 08/11/2024 01/02/2031 01/08/2040 01/08/2050 15/01/2026 23/01/2024 01/11/2025 15/05/2024 01/03/2025 27/03/2024 01/06/2023 01/07/2026 15/01/2030 15/10/2027 15/04/2030 15/04/2031 15/02/2031 15/02/2031	245.997 223.166 383.728 287.384 329.569 2.314.117 1.315.533 253.164 125.591 209.590 321.860 508.807 1.935.945 1.154.725 2.059.913 300.534 568.459 1.116.273 602.334 1.782.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,02 0,02 0,03 0,03 0,01 0,11 0,12 0,02 0,03 0,04 0,16 0,17 0,02 0,05 0,06 0,06 0,06 0,06 0,06 0,07 0,07 0,07
P I Retail Properties, Inc. tal Petroleum Corp. tatal Petroleum Corp. tatal Petroleum Corp. tas, Inc. R Financial Corp. Gas and Electric Co. Gas and Electric Co. Gas and Electric Co. Natural Resources Co. Natural Resources Co. Natural Resources Group, Inc. Income Corp. Pass Liquefaction LLC Pass Liquefaction LLC Pass Liquefaction LLC inancing USA LLC Property Group LP In Co. salty LP Inamics, Inc. Su USA, Inc. Communications, Inc. Communications, Inc. Communications, Inc. Inc. Inc. Inc. Inc. Inc. Inc. Inc.	USD	5,500 % 3,900 % 5,550 % 6,450 % 1,100 % 0,900 % 2,500 % 3,300 % 1,125 % 3,500 % 4,625 % 5,750 % 5,625 % 5,875 % 2,750 % 3,250 % 3,400 % 1,650 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 %	15/02/2049 15/06/2024 15/03/2026 15/03/2036 11/03/2024 08/11/2024 01/02/2031 01/08/2050 15/01/2026 23/01/2024 01/11/2025 15/05/2024 01/03/2025 27/03/2024 01/06/2023 01/07/2026 15/01/2030 15/01/2030 15/10/2027 15/04/2025 15/04/2027 15/04/2027 15/04/2031 15/02/2031 15/02/2031	223.166 383.728 287.384 329.569 2.314.117 1.315.533 253.164 125.591 209.590 321.860 508.807 1.935.945 1.154.725 2.059.913 300.534 568.459 1.116.273 602.334 1.782.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,02 0,03 0,02 0,03 0,15 0,11 0,02 0,03 0,04 0,16 0,17 0,02 0,05 0,05 0,05 0,05 0,05 0,05
Retail Properties, Inc. Ital Petroleum Corp. Ital Ital Ital Ital Ital Ital Ital Ital	USD	3,900 % 5,550 % 6,450 % 1,100 % 0,900 % 2,500 % 3,300 % 1,125 % 3,500 % 4,625 % 5,750 % 5,625 % 5,875 % 2,750 % 3,250 % 3,400 % 1,650 % 3,500 % 3,750 % 3,875 % 2,550 % 3,000 % 4,329 % 2,550 %	15/06/2024 15/03/2026 15/09/2036 11/03/2024 08/11/2024 01/02/2031 01/08/2040 01/08/2050 15/01/2026 23/01/2024 01/11/2025 15/05/2024 01/06/2023 01/07/2026 15/01/2030 15/01/2030 15/10/2027 15/04/2027 15/04/2031 15/02/2031 15/02/2031 15/02/2031	383.728 287.384 329.569 2.314.117 1.315.533 253.164 125.591 209.590 321.860 508.807 1.935.945 1.154.725 2.059.913 300.534 568.459 1.116.273 602.334 1.762.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,03 0,02 0,03 0,11 0,02 0,01 0,02 0,03 0,04 0,16 0,17 0,02 0,08 0,08 0,08 0,09 0,11 0,04
atal Petroleum Corp.  atal Petroleum Corp.  as, Inc.  R Financial Corp.  Gas and Electric Co.  Gas and Electric Co.  Sas and Electric Co.  Natural Resources Co.  nancial Services Group, Inc.  ncome Corp.  Pass Liquefaction LLC  Pass Liquefaction LLC  Property Group LP  n Co.  ealty LP  ynamics, Inc.  e USA, Inc.  e USA, Inc.  e USA, Inc.  e USA, Inc.  c USA, Inc.  communications, Inc.  communications, Inc.  chass Boots Alliance, Inc.	USD	5,550 % 6,450 % 1,100 % 0,900 % 2,500 % 3,300 % 3,500 % 4,625 % 5,750 % 5,625 % 5,750 % 3,250 % 3,400 % 1,650 % 3,500 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 %	15/03/2026 15/09/2036 11/03/2024 08/11/2024 01/02/2031 01/08/2040 01/08/2050 15/01/2026 23/01/2024 01/11/2025 15/05/2024 01/03/2025 27/03/2024 01/06/2023 01/07/2026 15/01/2030 15/10/2027 15/04/2025 15/04/2027 15/04/2031 15/02/2031 15/02/2031	287.384 329.569 2.314.117 1.315.533 253.164 125.591 209.590 321.860 508.807 1.935.945 1.154.725 2.059.913 300.534 568.459 1.116.273 602.334 1.782.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,02 0,03 0,15 0,01 0,02 0,03 0,02 0,03 0,04 0,16 0,17 0,02 0,05 0,05 0,05 0,04 0,05 0,05 0,05 0,05
atal Petroleum Corp. as, Inc. R Financial Corp. Gas and Electric Co. Gas and Electric Co. Gas and Electric Co. Natural Resources Co.	USD	6,450 % 1,100 % 0,900 % 2,500 % 3,300 % 3,500 % 1,125 % 5,750 % 5,625 % 5,750 % 3,250 % 3,400 % 1,650 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 4,329 % 2,550 %	15/09/2036 11/03/2024 08/11/2024 01/02/2031 01/08/2040 01/08/2050 15/01/2026 23/01/2024 01/11/2025 15/05/2024 01/03/2025 27/03/2024 01/06/2023 01/07/2026 15/01/2030 15/10/2027 15/04/2027 15/04/2027 15/04/2031 15/02/2031 15/02/2031	329.569 2.314.117 1.315.533 253.164 125.591 209.590 321.860 508.807 1.935.945 1.154.725 2.059.913 300.534 568.459 1.116.273 602.334 1.782.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,03 0,11 0,01 0,01 0,02 0,03 0,04 0,16 0,17 0,02 0,05 0,06 0,06 0,06 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02 0,15 0,02
as, Inc. R Financial Corp. Gas and Electric Co. Gas and Electric Co. Gas and Electric Co. Natural Resources Co. Natural Resources Group, Inc. Income Corp. Pass Liquefaction LLC	USD	1,100 % 0,900 % 2,500 % 3,300 % 1,125 % 3,500 % 4,625 % 5,750 % 5,625 % 5,875 % 2,750 % 3,250 % 3,400 % 1,650 % 3,500 % 3,750 % 3,750 % 3,875 % 2,550 % 3,000 % 4,329 % 2,550 %	11/03/2024 08/11/2024 01/02/2031 01/08/2040 01/08/2050 15/01/2026 23/01/2024 01/11/2025 15/05/2024 01/03/2025 27/03/2024 01/06/2023 01/07/2026 15/01/2030 15/10/2027 15/04/2025 15/04/2027 15/04/2031 15/02/2031 15/02/2041 21/09/2028	2.314.117 1.315.533 253.164 125.591 209.590 321.860 508.807 1.935.945 1.154.725 2.059.913 300.534 568.459 1.116.273 602.334 1.782.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,15 0,17 0,02 0,07 0,02 0,03 0,04 0,15 0,17 0,02 0,05 0,05 0,05 0,05 0,04 0,04
R Financial Corp. Gas and Electric Co. Gas and Electric Co. Gas and Electric Co. Natural Resources Co. Natural Resources Co. Nancial Services Group, Inc. Natural Resources Co. Nancial Services Group, Inc. Natural Resources Co. Natural Resourc	USD	0,900 % 2,500 % 3,300 % 3,500 % 1,125 % 3,500 % 4,625 % 5,750 % 5,625 % 5,875 % 2,750 % 3,250 % 3,400 % 3,500 % 3,750 % 3,875 % 2,550 % 3,000 % 4,329 % 2,550 %	08/11/2024 01/02/2031 01/08/2040 01/08/2050 15/01/2026 23/01/2024 01/11/2025 15/05/2024 01/03/2025 27/03/2024 01/06/2023 01/07/2026 15/01/2030 15/10/2027 15/04/2027 15/04/2030 15/02/2031 15/02/2031 15/02/2031	253.164 125.591 209.590 321.860 508.807 1.935.945 1.154.725 2.059.913 300.534 568.459 1.116.273 602.334 1.782.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,11 0,02 0,01 0,02 0,03 0,04 0,16 0,17 0,02 0,05 0,05 0,05 0,04 0,15 0,04
Gas and Electric Co. Gas and Electric Co. Natural Resources Co. nancial Services Group, Inc. ncome Corp. Pass Liquefaction LLC Pass Liquefaction LLC renoring USA LLC Property Group LP n Co. ealty LP ynamics, Inc. e USA, Inc. e USA, Inc. e USA, Inc. e USA, Inc. c USA, Inc. communications, Inc. Communications, Inc. communications, Inc. cns Boots Alliance, Inc.	USD	3,300 % 3,500 % 1,125 % 3,500 % 4,625 % 5,750 % 5,625 % 2,750 % 3,250 % 3,400 % 1,650 % 3,750 % 3,750 % 3,750 % 3,875 % 2,550 % 4,329 % 2,550 %	01/08/2040 01/08/2050 15/01/2026 23/01/2024 01/11/2025 15/05/2024 01/03/2025 27/03/2024 01/06/2023 01/07/2026 15/01/2030 15/10/2027 15/04/2027 15/04/2027 15/04/2031 15/02/2031 15/02/2031	125.591 209.590 321.860 508.807 1.935.945 1.154.725 2.059.913 300.534 568.459 1.116.273 602.334 1.782.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,0° 0,00° 0,00° 0,01° 0,11° 0,11° 0,02° 0,06° 0,06° 0,06° 0,11° 0,02° 0,11° 0,12° 0,12° 0,12° 0,12° 0,20°
Gas and Electric Co.  Natural Resources Co.  nancial Services Group, Inc.  ncome Corp.  Pass Liquefaction LLC  Pass Liquefaction LLC  inancing USA LLC  Property Group LP  n Co.  patty LP  ynamics, Inc.  pu USA, I	USD	3,500 % 1,125 % 3,500 % 4,625 % 5,750 % 5,625 % 2,750 % 3,250 % 3,400 % 1,650 % 3,500 % 3,750 % 3,875 % 2,550 % 3,000 % 4,329 % 2,550 %	01/08/2050 15/01/2026 23/01/2024 01/11/2025 15/05/2024 01/03/2025 27/03/2024 01/06/2023 01/07/2026 15/01/2030 15/10/2027 15/04/2025 15/04/2030 15/02/2031 15/02/2031	209.590 321.860 508.807 1.935.945 1.154.725 2.059.913 300.534 568.459 1.116.273 602.334 1.782.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,02 0,03 0,04 0,16 0,11 0,17 0,02 0,08 0,08 0,04 0,11 0,04
Natural Resources Co. nancial Services Group, Inc. ncome Corp. Pass Liquefaction LLC Pass Liquefaction LLC inancing USA LLC iroperty Group LP n Co. palty LP ynamics, Inc. pu USA, Inc. pu	USD	1,125 % 3,500 % 4,625 % 5,750 % 5,625 % 2,750 % 3,250 % 3,400 % 1,650 % 3,500 % 3,750 % 3,875 % 2,550 % 3,000 % 4,329 % 2,550 %	15/01/2026 23/01/2024 01/11/2025 15/05/2024 01/03/2025 27/03/2024 01/06/2023 01/07/2026 15/01/2030 15/10/2027 15/04/2025 15/04/2030 15/102/2031 15/02/2031 15/02/2041 21/09/2028	321.860 508.807 1.935.945 1.154.725 2.059.913 300.534 568.459 1.116.273 602.334 1.782.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,03 0,04 0,11 0,11 0,02 0,03 0,03 0,03 0,04 0,04 0,04 0,11 0,04
nancial Services Group, Inc. ncome Corp. Pass Liquefaction LLC Pass Liquefaction LLC inancing USA LLC Property Group LP n Co. sealty LP namics, Inc. e USA, Inc. c USA, Inc. c USA, Inc. e	USD	3,500 % 4,625 % 5,750 % 5,625 % 5,875 % 2,750 % 3,250 % 3,400 % 1,650 % 3,500 % 3,750 % 3,875 % 2,550 % 3,000 % 4,329 % 2,550 %	23/01/2024 01/11/2025 15/05/2024 01/03/2025 27/03/2024 01/06/2023 01/07/2026 15/01/2030 15/10/2027 15/04/2025 15/04/2030 15/02/2031 15/02/2031 15/02/2041 21/09/2028	508.807 1.935.945 1.154.725 2.059.913 300.534 568.459 1.116.273 602.334 1.762.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,04 0,16 0,11 0,17 0,02 0,08 0,08 0,08 0,04 0,14 0,04 0,11
ncome Corp. Pass Liquefaction LLC Pass Liquefaction LLC inancing USA LLC Property Group LP In Co. Palty LP In	USD	4,625 % 5,750 % 5,625 % 5,875 % 2,750 % 3,250 % 3,400 % 1,650 % 3,500 % 3,750 % 3,875 % 2,550 % 3,000 % 4,329 % 2,550 %	01/11/2025 15/05/2024 01/03/2025 27/03/2024 01/06/2023 01/07/2026 15/01/2030 15/10/2027 15/04/2025 15/04/2027 15/04/2031 15/02/2031 15/02/2041 21/09/2028	1.935.945 1.154.725 2.059.913 300.534 568.459 1.116.273 602.334 1.782.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,16 0,17 0,07 0,05 0,05 0,05 0,05 0,15 0,04 0,13
Pass Liquefaction LLC Pass Liquefaction LLC Inancing USA LLC Property Group LP In Co. Ealty LP In Co. Ealty LP In Co. E USA, Inc. E USA, Inc. E USA, Inc. E USA, Inc. CUSA, Inc. COMMUNICATION COMMUNICATION INC. Inc. Inc. Inc. Inc. Inc. Inc. Inc. Inc	USD	5,750 % 5,625 % 5,875 % 2,750 % 3,250 % 3,400 % 1,650 % 3,500 % 3,750 % 3,875 % 2,550 % 3,000 % 4,329 % 2,550 %	15/05/2024 01/03/2025 27/03/2024 01/06/2023 01/07/2026 15/01/2030 15/10/2027 15/04/2025 15/04/2030 15/02/2031 15/02/2041 21/09/2028	1.154.725 2.059.913 300.534 568.459 1.116.273 602.334 1.782.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,10 0,17 0,02 0,05 0,05 0,05 0,15 0,04 0,12 0,12
Pass Liquefaction LLC inancing USA LLC Property Group LP n Co. ealty LP ynamics, Inc. e USA, Inc. c USA, Inc. e US	USD	5,625 % 5,875 % 2,750 % 3,250 % 3,400 % 1,650 % 3,500 % 3,750 % 3,875 % 2,550 % 3,000 % 4,329 % 2,550 %	01/03/2025 27/03/2024 01/06/2023 01/07/2026 15/01/2030 15/10/2027 15/04/2025 15/04/2027 15/04/2031 15/02/2031 15/02/2041 21/09/2028	2.059.913 300.534 568.459 1.116.273 602.334 1.782.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,17 0,02 0,05 0,05 0,05 0,15 0,04 0,13 0,12
inancing USALLC Property Group LP n ro. salty LP pramics, Inc. e USA, Inc. c USA, Inc. c USA, Inc. e U	USD	5,875 % 2,750 % 3,250 % 3,400 % 1,650 % 3,500 % 3,750 % 3,875 % 2,550 % 4,329 % 2,550 %	27/03/2024 01/06/2023 01/07/2026 15/01/2030 15/10/2027 15/04/2025 15/04/2027 15/04/2030 15/02/2031 15/02/2041 21/09/2028	300.534 568.459 1.116.273 602.334 1.782.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,02 0,05 0,05 0,05 0,15 0,04 0,13 0,12
Property Group LP n Co. palty LP ynamics, Inc. pa USA, In	USD	2,750 % 3,250 % 3,400 % 1,650 % 3,500 % 3,750 % 3,875 % 2,550 % 3,000 % 4,329 % 2,550 %	01/06/2023 01/07/2026 15/01/2030 15/10/2027 15/04/2025 15/04/2027 15/04/2030 15/02/2031 15/02/2041 21/09/2028	568.459 1.116.273 602.334 1.782.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,05 0,05 0,15 0,04 0,13 0,12
n Co. palty LP pramics, Inc. pa USA, Inc. pa	USD	3,250 % 3,400 % 1,650 % 3,500 % 3,750 % 3,875 % 2,550 % 3,000 % 4,329 % 2,550 %	01/07/2026 15/01/2030 15/10/2027 15/04/2025 15/04/2027 15/04/2030 15/02/2031 15/02/2041 21/09/2028	1.116.273 602.334 1.782.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,09 0,05 0,15 0,04 0,13 0,12
ealty LP ynamics, Inc. e USA, Inc. c USA, Inc. c USA, Inc. c USA, Inc. communications, Inc. communications, Inc. t, Inc. ens Boots Alliance, Inc.	USD	3,400 % 1,650 % 3,500 % 3,750 % 3,875 % 2,550 % 3,000 % 4,329 % 2,550 %	15/01/2030 15/10/2027 15/04/2025 15/04/2037 15/04/2030 15/02/2031 15/02/2041 21/09/2028	602.334 1.782.601 512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,05 0,15 0,04 0,13 0,12 0,20
ynamics, Inc. a USA, Inc. b USA, Inc. b USA, Inc. b USA, Inc. b USA, Inc. c USA, Inc. c USA, Inc. c USA, Inc. c USA, Inc. communications, Inc. communications, Inc. t, Inc. cns Boots Alliance, Inc.	USD USD USD USD USD USD USD USD	1,650 % 3,500 % 3,750 % 3,875 % 2,550 % 3,000 % 4,329 % 2,550 %	15/04/2025 15/04/2027 15/04/2030 15/02/2031 15/02/2041 21/09/2028	512.655 1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,15 0,04 0,13 0,12 0,20
e USA, Inc. communications, Inc. communications, Inc. e, Inc. ens Boots Alliance, Inc.	USD USD USD USD USD USD USD	3,750 % 3,875 % 2,550 % 3,000 % 4,329 % 2,550 %	15/04/2027 15/04/2030 15/02/2031 15/02/2041 21/09/2028	1.564.951 1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,13 0,12 0,20
e USA, Inc. e USA, Inc. e USA, Inc. Communications, Inc. Communications, Inc. e, Inc. ens Boots Alliance, Inc.	USD USD USD USD USD USD	3,875 % 2,550 % 3,000 % 4,329 % 2,550 %	15/04/2030 15/02/2031 15/02/2041 21/09/2028	1.506.883 2.457.055 1.475.376	0,12 0,20
e USA, Inc. e USA, Inc. Communications, Inc. Communications, Inc. t, Inc. ens Boots Alliance, Inc.	USD USD USD USD USD	2,550 % 3,000 % 4,329 % 2,550 %	15/02/2031 15/02/2041 21/09/2028	2.457.055 1.475.376	0,20
e USA, Inc. Communications, Inc. Communications, Inc. e, Inc. ens Boots Alliance, Inc.	USD USD USD USD	3,000 % 4,329 % 2,550 %	15/02/2041 21/09/2028	1.475.376	
Communications, Inc. Communications, Inc. e, Inc. ens Boots Alliance, Inc.	USD USD USD	4,329 % 2,550 %	21/09/2028		
Communications, Inc. e, Inc. ens Boots Alliance, Inc.	USD USD	2,550 %			
e, Inc. ens Boots Alliance, Inc.	USD		21/03/2031	3.166.775 1.911.163	0,26 0,16
ens Boots Alliance, Inc.			15/08/2028	449.755	0,10
		1,800 % 0,950 %	17/11/2023	2.524.496	0,21
	USD	2,188 %	30/04/2026	2.427.519	0,20
s Cos., Inc.	USD	3,900 %	15/01/2025	517.861	0,04
ey, Inc.	USD	4,600 %	01/04/2024	239.743	0,02
ey, Inc.	USD	4,000 %	01/02/2025	188.837	0,02
			1:	25.301.684	10,28
nternacionales del Estado de Uruguay	USD	4,375 %	23/01/2031	413.426	0,03
<i>,</i>		<u> </u>			
NU LA DIOC A DMITIDOC A COTITA CIÓN EN UNA DOLO	A DE VALORES O		9	03.938.426	74,12
SILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACION EN UNA BOLS	A DE VALURES O	FICIAL	9	03.938.426	74,12
ociados en otro mercado regulado					
a & New Zealand Banking Group Ltd 144A(c)(d)	USD	2.950 %	22/07/2030	634 192	0,05
1 1 1 1					0,05
					0,11
					0,05
rie Group Ltd. 144A <sup>(c)(d)</sup>					0,02
·				3.446.094	0,28
Holdings Funding Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,950 %	01/07/2024	323.325	0,03
ribas S.A. 144A <sup>(d)</sup>	HSD	3 375 %	09/01/2025	2 901 166	0,24
					0,22
					0,18
					0,08
					0,13
					0,32
					0,03
gricole S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,907 %	16/06/2026	398.967	0,03
gricole S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD				0,15
Générale S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,488 %	14/12/2026	2.691.780	0,22
					1,51
a rining	ILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLS  ociados en otro mercado regulado  1. & New Zealand Banking Group Ltd. 144A <sup>(c)</sup> (d)  nivealth Bank of Australia 144A <sup>(c)</sup> (d)  rie Bank Ltd. 144A <sup>(c)</sup> (d)  rie Group Ltd. 144A <sup>(c)</sup> (d)  rie Group Ltd. 144A <sup>(c)</sup> (d)  rie Group Ltd. 144A <sup>(c)</sup> (d)  ribas S.A. 144A <sup>(c)</sup> (d)  ricole S.A. 144A <sup>(c)</sup> (d)	ILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VALORES OF   ILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VALORES OF   ILIARIOS   ILIARIOS	ILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VALORES OFICIAL	Section   Sect	Sociados en otro mercado regulado   USD   2,950 %   22/07/2030   634.192     Respective

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en EUR	% del
Bonos - (contin	-					patimoni
Irlanda	200.011)					
1.600.000	AIB Group Plc. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	4,263 %	10/04/2025	1.491.767	0,12
Países Bajos						
	ABN AMRO Bank NV 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,542 %	16/06/2027	2.422.736	0,20
	Deutsche Telekom International Finance BV 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,485 %	19/09/2023	450.921	0,04
	Enel Finance International NV 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,875 %	12/07/2041	1.280.572 273.888	0,1
	Syngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup> Syngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup>	USD USD	4,441 % 4,892 %	24/04/2023 24/04/2025	1.884.307	0,02 0,15
1.973.000	Syngenia i mance NV 144A	03D	4,092 /0	24/04/2023	6.312.424	0,13
Supranacionales					0.012.424	0,02
•	NXP BV Via NXP Funding LLC Via NXP USA, Inc. 144 $A^{(d)}$	USD	3,250 %	30/11/2051	1.202.036	0,10
Suiza	0 110 1 0 1 0 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1	1100	0.000.0/	10/04/0000		
	Credit Suisse Group AG 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,869 %	12/01/2029	3.777.789	0,31
Estados Unidos	ALC Clabal Funding 144A(d)	LICD	2 200 %	04/07/2022	222 245	0.00
	AIG Global Funding 144A <sup>(d)</sup> Aviation Capital Group LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD USD	2,300 % 1,950 %	01/07/2022 30/01/2026	222.215 737.603	0,02
	Broadcom, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,469 %	15/04/2034	976.111	0,0
	Broadcom, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,137 %	15/11/2035	3.354.572	0,00
	Duquesne Light Holdings, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,532 %	01/10/2030	699.593	0,0
	Federal Home Loan Banks	USD	2,625 %	12/09/2025	558.927	0,0
	Glencore Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,125 %	30/05/2023	1.470.871	0,12
	Glencore Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,625 %	29/04/2024	1.133.411	0,09
	Glencore Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,875 %	12/03/2029	2.261.507	0,18
	Hyundai Capital America 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,650 %	17/09/2026	4.520.632	0,37
45.142.000.000	Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(c)(d)</sup>	IDR	7,500 %	17/06/2035	2.936.179	0,24
700.000	International Flavors & Fragrances, Inc. 144A(d)	USD	1,230 %	01/10/2025	606.293	0,0
250.000	International Flavors & Fragrances, Inc. 144A(d)	USD	1,832 %	15/10/2027	217.008	0,02
150.000	State of California	USD	7,625 %	01/03/2040	221.312	0,02
	State of Illinois	USD	6,725 %	01/04/2035	165.093	0,0
150.000	State of Illinois Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD	6,725 % 1,711 %	01/04/2035 29/01/2027	165.093 822.793	
150.000 950.000						0,01 0,07 0,07
150.000 950.000	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,711 %	29/01/2027 15/09/2031	822.793	0,07
150.000 950.000	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,711 %	29/01/2027 15/09/2031	822.793 823.661	0,07 0,07
150.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO (coste EUR 54.73	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD	1,711 %	29/01/2027 15/09/2031	822.793 823.661	0,07 0,07
150.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO (coste EUR 54.73 Obligaciones co	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD	1,711 %	29/01/2027 15/09/2031	822.793 823.661 21.727.781	0,07 0,07 1,78
TOTAL DE BONO: (coste EUR 54.73*  Obligaciones co Estados Unidos	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> In garantía de activos emitidos o garantizados por agencias – 1	USD USD 0,39 %	1,711 % 2,691 %	29/01/2027 15/09/2031	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842	0,07 0,07 1,78 <b>4,6</b> \$
TOTAL DE BONO: (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Stellantis Finance	USD USD 0,39 % USD	1,711 % 2,691 % 5,000 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842	0,07 0,07 1,78 <b>4,65</b>
150.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO: (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Stellantis Finance	USD USD 0,39 % USD USD	1,711 % 2,691 % 5,000 % 6,000 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 4.632 45.955	0,07 0,07 1,78 <b>4,65</b> 0,00 0,00
150.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Stellantis Finance	USD USD 0,39 % USD USD USD	1,711 % 2,691 % 5,000 % 6,000 % 5,000 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 4.632 45.955 109.241	0,07 0,07 1,78 <b>4,65</b> 0,00 0,00 0,01
150.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO (coste EUR 54.73* Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Stellantis Finance	USD USD 0,39 % USD USD	1,711 % 2,691 % 5,000 % 6,000 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 4.632 45.955	0,07 0,07 1,78 4,68 0,00 0,00 0,00 0,00
150.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO (coste EUR 54.73* Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Stellantis Finance	USD USD 0,39 % USD USD USD USD	1,711 % 2,691 % 5,000 % 6,000 % 5,000 % 4,000 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 4.632 45.955 109.241 6.599	0,07 0,07 1,78 4,68 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00
150.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO: (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Stellantis Finance	USD USD 0,39 % USD USD USD USD USD USD	1,711 % 2,691 % 5,000 % 6,000 % 5,000 % 4,000 % 4,000 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 4.632 45.955 109.241 6.599 31.753	0,00 0,07 1,78 4,68 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00
150.000 950.000 950.000 707AL DE BONO (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Stellantis Finance	USD USD 0,39 % USD USD USD USD USD USD USD	1,711 % 2,691 % 5,000 % 6,000 % 5,000 % 4,000 % 4,000 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 4.632 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593	0,07 0,07 1,78 4,68 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0
150.000 950.000 950.000 707AL DE BONO (coste EUR 54.73 Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.497	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Stellantis Finance	USD USD 0,39 % USD USD USD USD USD USD USD USD	5,000 % 6,000 % 5,000 % 4,000 % 4,000 % 5,911 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 01/02/2041 15/05/2041	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 4.632 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593 21.838	0,07 0,07 1,78 4,68 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0
150.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO (coste EUR 54.73* Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.497 326.336	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD USD 0,39 % USD USD USD USD USD USD USD USD	5,000 % 6,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 15/05/2041 01/11/2041	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 4.632 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593 21.838 4.325	0,07 0,07 1,78 4,68 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0
150.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO (coste EUR 54.73* Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.497 326.336 408.864	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 % 6,000 % 5,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 5,911 % 5,961 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 15/05/2041 01/11/2041 15/03/2044 15/05/2046 01/01/2049	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 4.632 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593 21.593 4.325 42.141	0,07 0,07 1,78 4,68 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0
150.000 950.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.497 326.336 408.864 408.878 49.402	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 % 6,000 % 5,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 5,911 % 4,000 % 5,961 % 5,961 % 5,961 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 01/02/2041 01/11/2041 15/05/2046 01/01/2049 01/05/2049	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 4.632 45.955 109.241 6.599 31.753 21.838 4.325 42.141 46.05	0,07 0,07 1,78 4,68 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0
150.000 950.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.497 326.336 408.864 408.878 49.402 463.743	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 % 6,000 % 5,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 5,911 % 4,000 % 5,961 % 5,911 % 4,500 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 15/05/2041 01/11/2041 15/03/2044 15/05/2046 01/01/2049	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 4.632 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593 21.838 4.325 42.141 60.993 385.721	0,07 0,07 1,78 4,69 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0
150.000 950.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO (coste EUR 54.73* Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.497 326.336 408.864 408.878 49.402 463.743 465.925	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 % 6,000 % 5,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 5,911 % 4,500 % 4,500 % 6,008 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 01/02/2041 01/11/2041 15/05/2046 01/01/2049 01/05/2049 01/08/2049	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 4.632 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593 21.838 4.325 42.141 60.993 385.721 46.605 437.479 71.474	0,07 0,07 1,78 4,68 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0
150.000 950.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.497 326.336 408.864 408.878 49.402 463.743 465.925 922.022	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 % 6,000 % 6,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 5,911 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 4,500 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 01/02/2041 15/05/2044 01/11/2041 15/05/2046 01/01/2049 01/05/2049 01/08/2049 25/08/2049 01/05/2050	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 4.632 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593 21.838 4.325 42.141 60.993 385.721 46.605 437.479 71.474 872.453	0,07 0,07 1,78 4,68 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0
150.000 950.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.497 326.336 408.864 408.878 49.402 463.743 465.925 922.022 3.975.602	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> In garantia de activos emitidos o garantizados por agencias – 1  Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 % 6,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 5,911 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 4,500 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 15/05/2041 01/11/2041 15/03/2044 15/05/2046 01/01/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2050	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 4.632 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593 21.838 4.325 42.141 60.993 385.721 46.605 437.479 71.474 872.453 507.881	0,07 0,07 1,78 4,68 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0
150.000 950.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.497 326.336 408.864 408.878 49.402 463.743 465.925 922.022 3.975.602 1.688.931	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 % 6,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 5,911 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 5,901 % 5,910 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 15/05/2041 01/11/2041 15/05/2044 01/01/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2050 25/06/2050 25/06/2050	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593 21.838 4.325 42.141 60.993 385.721 46.605 437.479 71.474 872.453 507.881 217.819	0,07 0,07 1,78 4,69 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0
150.000 950.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO: (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.497 326.336 408.864 408.874 408.878 49.402 463.743 465.925 922.022 3.975.602 1.688.931 1.941.340	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 % 6,000 % 5,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 5,911 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 6,008 % 4,500 % 6,008 % 6,008 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 15/05/2041 01/11/2041 15/05/2046 01/01/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2050 25/06/2050 25/07/2050 25/07/2050	822.793 823.661 21.727.781 21.727.781 56.646.842 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593 21.593 4.325 42.141 60.993 385.721 46.605 437.479 71.474 872.453 507.881 217.819 302.495	0,0° 0,0° 1,73 4,68  0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00
150.000 950.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO: (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.497 326.336 408.864 408.864 408.872 922.022 3.9756.022 1.688.931 1.941.340 4.185.163	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	1,711 % 2,691 %  5,000 % 6,000 % 5,000 % 4,000 % 4,000 % 5,911 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 6,008 % 5,000 % 6,008 % 3,000 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 01/02/2041 15/05/2046 01/11/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2050 25/06/2050 25/07/2050 25/07/2050 25/07/2050	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 4.632 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593 21.838 4.325 42.141 60.993 385.721 46.605 437.479 71.474 872.453 507.881 217.819 302.495 461.182	0,0° 0,0° 1,73 4,69 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0
150.000 950.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO: (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.437 326.336 408.864 408.878 49.402 463.743 465.925 922.022 3.975.602 1.688.931 1.941.340 4.185.163 2.345.945	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> In garantía de activos emitidos o garantizados por agencias – 1  Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 % 6,000 % 6,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 5,911 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 6,008 % 4,500 % 6,008 % 6,008 % 3,000 % 4,000 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 15/05/2041 01/11/2041 15/05/2046 01/01/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2050 25/08/2049 01/05/2050 25/07/2050 25/07/2050 25/08/2050 25/08/2050	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 4.632 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593 21.838 4.325 42.141 60.993 385.721 46.605 437.479 71.474 872.453 507.881 217.819 302.495 461.182 325.893	0,0° 0,0° 1,74 4,64 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,0
150.000 950.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.497 326.336 408.864 408.878 49.402 463.743 465.925 922.022 3.975.602 1.688.931 1.941.340 4.185.163 2.345.945	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Rederal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 % 6,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 5,911 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 6,008 % 4,500 % 6,008 % 6,008 % 4,500 % 6,008 % 4,500 % 6,008 % 6,008 % 6,008 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 15/05/2041 01/11/2041 15/05/2044 01/01/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2050 25/08/2050 25/07/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 45.955 109.241 6.599 31.753 21.838 4.325 42.141 60.993 385.721 46.605 437.479 71.474 872.453 507.881 217.819 302.495 46.1182 325.893 153.309	0,07 0,07 1,78 4,68 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0
150.000 950.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.497 326.336 408.864 408.878 49.402 463.743 465.925 922.022 3.975.602 1.688.931 1.941.340 4.185.163 2.345.945 1.799.671 505.446	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 % 6,000 % 4,000 % 4,000 % 5,961 % 5,961 % 5,911 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 6,008 % 4,500 % 6,008 % 3,000 % 4,000 % 2,000 % 4,000 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 01/02/2041 01/11/2041 15/05/2046 01/01/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2050 25/06/2050 25/06/2050 25/06/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/09/2050	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593 21.838 4.325 42.141 60.993 385.721 46.605 437.479 71.474 872.453 507.881 217.819 302.495 461.182 325.893 153.309 68.230	0,07 0,07 1,78 4,68 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0
150.000 950.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.497 326.336 408.864 408.864 408.878 49.402 463.743 465.925 922.022 3.975.602 1.688.931 1.941.340 4.185.163 2.345.945 1.799.671 505.446 6.515.022	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 % 6,000 % 5,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 6,008 % 4,500 % 6,008 % 4,500 % 6,008 % 4,500 % 6,008 % 3,000 % 4,000 % 3,000 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 01/02/2041 01/11/2041 15/05/2046 01/101/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2050 25/06/2050 25/06/2050 25/07/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/09/2050 25/09/2050 01/12/2050	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 4.632 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593 21.593 21.893 4.325 42.141 60.993 385.721 46.605 437.479 71.474 872.453 507.881 217.819 302.495 461.182 325.893 153.309 68.230 6.031.420	0,0° 0,0° 1,74 4,69 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0
150.000 950.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO: (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.437 326.336 408.864 408.878 49.402 463.743 465.925 922.022 3.975.602 1.688.931 1.941.340 4.185.163 2.345.945 1.799.671 505.446 6.515.022 2.959.366	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> In garantia de activos emitidos o garantizados por agencias – 1  Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	1,711 % 2,691 %  5,000 % 6,000 % 5,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 5,911 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 6,008 % 4,500 % 6,008 % 3,000 % 2,000 % 3,000 % 3,000 % 2,500 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 01/12/2041 01/11/2041 15/05/2046 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2050 25/06/2050 25/07/2050 25/07/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/09/2050 25/09/2050 01/102/2050	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 4.632 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593 21.838 4.325 42.141 60.993 385.721 46.605 437.479 71.474 872.453 507.881 217.819 302.495 461.182 325.893 153.309 68.230 6.031.420 2.689.448	0,0° 0,0° 1,74 4,64 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,0
150.000 950.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO: (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.497 326.336 408.864 408.878 49.402 463.743 465.925 922.022 3.975.602 1.688.931 1.941.340 4.185.163 2.345.945 1.799.671 505.446 6.515.022 2.959.366 2.954.782	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> In garantia de activos emitidos o garantizados por agencias – 1  Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 % 6,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 5,911 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 6,008 % 4,500 % 6,008 % 4,500 % 6,008 % 4,500 % 6,008 % 2,500 % 2,500 % 2,500 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 15/05/2041 01/11/2041 15/05/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2050 25/08/2050 25/07/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 01/12/2050 01/12/2050 01/12/2050	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 4.632 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593 21.838 4.325 42.141 60.993 385.721 46.605 437.479 71.474 872.453 507.881 217.819 302.495 461.182 325.893 153.309 68.230 68.230 6.031.420 2.689.448 2.688.528	0,0° 0,0° 1,73 4,68  0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00
150.000 950.000 950.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.497 326.336 408.864 408.878 49.402 463.743 465.925 922.022 3.975.602 1.688.931 1.941.340 4.185.163 2.345.945 1.799.671 505.446 6.515.022 2.959.366 2.954.782 500.000	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> In garantia de activos emitidos o garantizados por agencias – 1  Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 % 6,000 % 5,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 5,961 % 5,911 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 6,008 % 4,500 % 6,008 % 3,000 % 6,008 % 3,000 % 6,008 % 3,000 % 2,500 % 1,700 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 15/05/2041 01/11/2041 15/05/2044 01/01/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2050 25/08/2050 25/06/2050 25/07/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/09/2050 01/102/2050 01/102/2050 01/102/2051 01/09/2051 01/09/2051	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593 21.838 4.325 42.141 60.993 385.721 46.605 437.479 71.474 872.453 507.881 217.819 302.495 461.182 325.893 153.309 68.230 6.031.420 2.689.448 2.688.528 442.521	0,0 0,0 1,7 4,6 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0
150.000 950.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO: (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.497 326.336 408.864 408.874 465.925 922.025 3.975.602 1.688.931 1.941.340 4.185.163 2.345.945 1.799.671 505.446 6.515.022 2.959.366 2.954.782 500.000 29.516	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> In garantia de activos emitidos o garantizados por agencias – 1  Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 % 6,000 % 6,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 5,961 % 5,961 % 5,911 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 6,008 % 4,500 % 6,008 % 3,000 % 2,000 % 4,000 % 2,000 % 2,500 % 2,349 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 15/05/2041 01/11/2041 15/05/2046 01/01/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2050 25/06/2050 25/06/2050 25/07/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/09/2050 25/09/2050 01/12/2050 01/109/2051 01/109/2051 01/109/2051 01/109/2051	822.793 823.661 21.727.781 56.646.842 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593 21.593 21.838 4.325 42.141 60.993 385.721 46.605 437.479 71.474 872.453 507.881 217.819 302.495 461.182 325.893 153.309 68.230 6.031.420 2.689.448 2.688.528 442.521 26.123	0,0° 0,0° 1,73 4,68  0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00
150.000 950.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO: (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.497 326.336 408.864 408.878 49.402 463.743 465.925 922.022 3.975.803 1.941.340 4.185.163 2.345.945 1.799.671 505.446 6.515.022 2.959.366 2.954.782 500.000 29.516 337.845	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> In garantía de activos emitidos o garantizados por agencias – 1  Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	1,711 % 2,691 %  5,000 % 6,000 % 5,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 5,911 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 6,008 % 4,500 % 6,008 % 3,000 % 4,000 % 2,000 % 2,000 % 2,500 % 2,500 % 2,500 % 2,349 % 4,958 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 01/02/2041 01/11/2041 15/05/2046 01/101/2049 01/05/2050 25/08/2049 01/05/2050 25/07/2050 25/07/2050 25/07/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050	822.793 823.661 21.727.781 21.727.781 56.646.842 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593 21.838 4.325 42.141 60.993 385.721 46.605 437.479 71.474 872.453 507.881 217.819 302.495 461.182 325.893 153.309 68.230 6.031.420 2.689.448 2.688.528 442.521 26.123 37.388	0,0° 0,0° 1,73 4,69 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0
150.000 950.000 950.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO: (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 4.6.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.497 326.336 408.864 408.878 49.402 463.743 465.925 922.022 3.975.602 1.688.931 1.941.340 4.185.163 2.345.945 1.799.671 505.446 6.515.022 2.959.366 2.954.782 500.000 29.516 337.845 306.954	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> In garantia de activos emitidos o garantizados por agencias – 1  Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	1,711 % 2,691 %  5,000 % 6,000 % 5,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 5,911 % 4,500 % 4,500 % 6,008 % 4,500 % 6,008 % 3,000 % 4,000 % 2,500 % 1,700 % 2,349 % 4,958 % 5,000 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 01/02/2041 15/05/2046 01/101/2049 01/05/2049 01/05/2049 01/05/2050 25/06/2050 25/07/2050 25/07/2050 25/07/2050 25/08/2050 25/09/2050 01/05/2050 25/09/2050 01/09/2051 01/09/2051 01/09/2051 01/09/2051 01/09/2051 01/09/2051 01/09/2051 01/09/2051 01/09/2051 01/09/2051 01/09/2051 01/09/2051	822.793 823.661 21.727.781 21.727.781 24.632 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593 21.838 4.325 42.141 60.993 385.721 46.605 437.479 71.474 872.453 507.881 217.819 302.495 461.182 325.893 153.309 68.230 6.031.420 2.689.448 2.688.528 442.521 26.123 37.388 299.783	0,07 0,07 1,78 4,68 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0
150.000 950.000 950.000 950.000 950.000 TOTAL DE BONO (coste EUR 54.73' Obligaciones co Estados Unidos 4.818 46.955 108.975 6.815 32.796 22.303 163.648 4.497 326.336 408.864 408.878 49.402 463.743 465.925 922.022 3.975.602 1.688.931 1.941.340 4.185.163 2.345.945 1.799.671 505.446 6.515.022 2.959.366 2.954.782 500.000 29.516 337.845 306.954	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup> In garantía de activos emitidos o garantizados por agencias – 1  Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	1,711 % 2,691 %  5,000 % 6,000 % 5,000 % 4,000 % 4,000 % 4,000 % 5,911 % 4,500 % 4,500 % 4,500 % 6,008 % 4,500 % 6,008 % 3,000 % 4,000 % 2,000 % 2,000 % 2,500 % 2,500 % 2,500 % 2,349 % 4,958 %	29/01/2027 15/09/2031 01/09/2023 01/08/2028 01/12/2038 01/06/2040 01/02/2041 01/02/2041 01/11/2041 15/05/2046 01/101/2049 01/05/2050 25/08/2049 01/05/2050 25/07/2050 25/07/2050 25/07/2050 25/08/2050 25/08/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050 25/09/2050	822.793 823.661 21.727.781 21.727.781 56.646.842 45.955 109.241 6.599 31.753 21.593 21.838 4.325 42.141 60.993 385.721 46.605 437.479 71.474 872.453 507.881 217.819 302.495 461.182 325.893 153.309 68.230 6.031.420 2.689.448 2.688.528 442.521 26.123 37.388	0,07 0,07 1,78 <b>4,65</b> 0,00 0,00

Deligaciones con garantiz de activos emitidos o garantizados por agencias - (continuación continuación (continuación (continuación) (contin	Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en EUR	% del patrimonio
Septiment   Sept	-		gencias – (continuación)				
56.857   Federal National Mortgage Association (FNMA)			1100	0.570.0/	05/07/0040	70.040	0.04
20.016   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   3,000 %   0.11/12/2042   10.886   11.463   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   3,000 %   0.11/12/2042   10.886   11.463   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   3,000 %   0.11/12/2042   10.8870   2.2872   Federal Relational Mortgage Association (FMMA)   USD   3,000 %   0.11/12/2042   10.870   2.2872   Federal Relational Mortgage Association (FMMA)   USD   3,000 %   0.11/12/2042   10.870   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.0867   2.							0,01
11.605   Federal National Mortgage Association (FNMA)							0,01 0,00
11-453   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   3,000 %   011/22/92   15,870   22.222   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   3,000 %   011/12/93   15,917   22.225   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   3,000 %   011/12/93   15,919   44.4545   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   3,000 %   011/12/93   15,919   44.4545   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   3,000 %   011/12/93   15,919   44.4545   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   3,000 %   011/12/94   24.918   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920   15,920		. ,					0,00
16.923   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD 3.000 %   0111/22042   15.870   16.975   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD 3.000 %   01101/22043   20.867   16.975   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD 3.000 %   01101/22043   42.053   13.370   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD 3.000 %   01101/22043   42.053   13.370   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD 3.000 %   01101/22043   42.053   13.370   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD 3.000 %   0104/22043   16.534   16.506   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD 3.000 %   0104/22043   16.534   16.506   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD 3.000 %   0104/22043   16.534   16.506   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD 3.000 %   0104/22043   16.534   16.506   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD 3.000 %   0104/22043   16.534   16.506   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD 3.000 %   0104/22043   16.534   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16.506   16		. ,					0,00
22,252   Federal National Mortgage Association (FNMA)							0,00
16.975   Federal National Mortgage Association (FNNAA)							0,00
44.843   Federal National Mortgage Association (FNNA)							0,00
13.707   Federal National Mortgage Association (FNNA)   USD   3,000 %   01104/2943   24.401   11.307   Federal National Mortgage Association (FNNA)   USD   3,000 %   01104/2943   24.401   11.307   Federal National Mortgage Association (FNNA)   USD   3,000 %   01104/2943   10.634   15.508   Federal National Mortgage Association (FNNA)   USD   3,000 %   01104/2943   14.566   30.5037   Federal National Mortgage Association (FNNA)   USD   3,000 %   01104/2943   24.77   24.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77   25.77		* ,					0,00
1.929		. ,					0,00
11.320   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3.000 %   01/04/2043   14.566		* ,					0,00
15.506   Federal National Mortgage Association (FNMA)		. ,					0,00
55.537         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/04/2043         52.173           47.286         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         6,008 %         25/05/2047         44.922           350.042         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         6,500 %         01/07/2047         249.254           277.637         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/07/2047         249.254           277.637         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/11/2047         249.254           22.25.875         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/11/2047         249.254           23.36         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/01/2048         49.533           36.1.09         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         5,000 %         01/01/2048         49.533           36.33.27         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         25/06/2048         1815.072           1.89.29.77         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/08/2048         1815.072							0,00
47288 Federal National Morrgage Association (FMMA)** S3213** Federal National Morrgage Association (FMMA)** 300.042 Federal National Morrgage Association (FMMA)** USD 4,500 % 010772047 293.731 280.446 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 4,500 % 011112047 249.224 277.637 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 4,500 % 011112047 269.332 14.68.812 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 4,500 % 011112047 140.674 2.235.875 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 4,500 % 010112048 2.131.133 51.109 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 5,000 % 010112048 2.131.133 51.109 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 5,000 % 010112048 3.131.133 1.199.728 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 5,000 % 010112048 3.151.109 5.1199 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 5,000 % 010112048 3.151.109 5.1199 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 5,000 % 010162048 31.5072 5.180.275 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 4,000 % 010162048 31.5072 5.180.2875 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 4,000 % 010162048 31.5072 5.180.2876 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 4,000 % 010162048 31.5072 5.180.2876 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 4,000 % 010162048 31.5072 5.180.2876 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 4,000 % 010162048 31.5072 5.180.2876 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 4,000 % 010162048 31.5072 5.180.2876 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 4,000 % 010162049 31.385 5.39.396 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 4,000 % 010162049 31.385 5.39.396 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 4,000 % 010162049 31.385 5.39.396 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 4,000 % 010162049 31.385 5.39.396 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 4,000 % 010162049 31.385 5.39.396 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 4,000 % 010162049 31.385 5.39.396 Federal National Morrgage Association (FMMA) USD 4,000 % 010162051 4.4		. ,					0,00
S33.213   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   4.500 %   0107/2047   293.731   280.446   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   4.500 %   0107/2047   249.254   276.837   7.6467   National Mortgage Association (FMMA)   USD   4.500 %   0111/2047   249.254   276.837   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   4.500 %   0111/2047   140.674   223.8787   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   4.500 %   0111/2047   140.674   223.8787   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   5.000 %   0101/2048   213.1133   363.351   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   5.000 %   0101/2048   49.533   43.351   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   5.000 %   2503/2048   63.667   81.372   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   4.500 %   0106/2048   815.072   81.360   81.372   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   4.500 %   0106/2048   815.072   81.360   81.372   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   4.500 %   0106/2048   815.072   81.360   81.372   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   4.500 %   0106/2048   385.299   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360   81.360							0,00
280.442   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   4.500 %   0107/2047   249.254   227.637   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   4.500 %   0111/2047   269.254   227.637   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   4.500 %   0111/2047   140.674   22.258.875   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   4.000 %   0101/2048   2.131.133   31.109   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   4.000 %   0101/2048   2.131.133   31.109   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   6.058 %   250/22048   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.637   47.							0,01
280.446 Federal National Mortgage Association (FNMA)  276.837 Federal National Mortgage Association (FNMA)  180							0,02
277.637   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   0.111/12/047   14.0674   2.235.875   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   0.101/12/048   2.151.133   51.109   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   5,000 %   0.101/12/048   4.95.33   364.351   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   5,000 %   0.101/12/048   4.95.33   364.351   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   6,058 %   2.5002/048   47.637   3.6678   3.199.728   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   0.1067/02/048   39.6678   361.372   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   0.1067/048   39.965   35.36.17   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   0.1067/048   39.988   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   0.1067/048   355.299   103.201   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   0.1067/048   39.988   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   0.1067/048   39.989   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   0.1107/02/048   97.467   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.07   36.							0,02
146.812   Federal National Mortgage Association (FNMA)							0,02
2.235.875 Federal National Mortgage Association (FNMA) 5.1109 Federal National Mortgage Association (FNMA) 3.34.351 Federal National Mortgage Association (FNMA) 3.36.351 Federal National Mortgage Association (FNMA) 3.36.351 Federal National Mortgage Association (FNMA) 3.372 Federal National Mortgage Association (FNMA) 3.39.277 Federal National Mortgage Association (FNMA) 3.39.277 Federal National Mortgage Association (FNMA) 3.39.2877 Federal National Mortgage Association (FNMA) 3.39.288 Federal National Mortgage Association (FNMA) 3.49.39 Federal National Mortgage Association (FNMA) 3.49.39 Federal National Mortgage Association (FNMA) 3.59.39 Federal Nati		. ,					0,01
S1.109   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD							0,18
1.199.728   Federal National Mortgage Association (FNMA)		. ,					0,00
1.99.728 Federal National Mortgage Association (FNMA)		, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,					0,00
861.372 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4.500 % 25/08/2048 815.072 1.368.297 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4.500 % 01/08/2048 505.692 399.988 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4.500 % 01/08/2048 505.692 399.988 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4.500 % 01/10/2048 97.692 103.201 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4.500 % 01/10/2048 97.467 844.979 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5.500 % 01/11/2048 97.467 107.503 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5.000 % 01/11/2048 97.467 107.503 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5.000 % 01/11/2049 10/1.385 593.399 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4.500 % 01/08/2049 10/1.385 107.503 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4.500 % 01/08/2049 10/1.385 107.503 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4.500 % 01/08/2049 799.977 426.258 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4.500 % 01/08/2049 799.977 426.258 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4.500 % 01/08/2049 799.977 426.258 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4.000 % 25/09/2050 65.656 1.927.500 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4.000 % 25/09/2050 76.476 469.410 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4.000 % 25/09/2050 76.476 753.700 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4.500 % 01/10/2059 76.476 10.000.000 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 2.000 % 11/08/2051 711.592 4.936.858 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 2.000 % 13/12/2051 8.781.790 9.000.000 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 2.000 % 13/12/2051 3.779.192 4.936.858 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3.000 % 13/12/2051 3.779.192 4.936.858 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4.500 % 13/12/2051 3.779.192 4.936.858 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4.000 % 13/12/2051 3.779.192 4.936.859 Government National Mortgage Association (FNMA) USD 4.000 % 20/12/2044 4.98.492 4.							0,01
1.389.297 Federal National Mortgage Association (FNMA)							0,07
S35.817   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/09/2048   365.682   389.898   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/10/2048   97.467   384.979   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/11/2048   97.467   384.979   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/11/2048   2668.765   107.503   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   5,000 %   01/11/2049   2668.765   107.503   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/09/2049   101.385   39.399   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/09/2049   101.385   39.399   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/09/2049   799.977   426.286   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/09/2049   799.977   426.286   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/09/2049   799.977   466.286   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   25/09/2050   164.764   469.410   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   25/09/2050   62.588   81.020   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   25/09/2050   62.588   81.020   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/09/2051   74.764   4.936.858   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/09/2051   4.492.001   10.000.000   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   2,500 %   01/09/2051   4.492.001   10.000.000   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   2,000 %   31/12/2051   8.213.570   4.000 w   6.600   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   31/12/2051   8.223.255   4.000 w   6.600   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   4.000 %   2.000 %   3.000 %   3.000 %   3.000 %   3.000 %   3.000 %   3.000 %   3.000 %   3.000 %   3.000 %   3.000 %   3.000 %   3.000 %   3.000 %   3.000 %   3.000 %   3.000 %   3.000 %   3.000 %   3.000 %   3.000 %		. ,					0,02
1999.988   Federal National Mortgage Association (FNMA)			USD				0,04
103.201   Federal National Mortgage Association (FNMA)							0,03
244.979   Federal National Mortgage Association (FNMA)							0,01
2.723.477 Federal National Mortgage Association (FNMA)  107.503 Federal National Mortgage Association (FNMA)  108.							0,07
107.503   Federal National Mortgage Association (FNMA)	2.723.477	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/11/2048	2.668.765	0,22
539,368   Federal National Mortgage Association (FNMA)		. ,					0,01
## 427.757 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD ## 4.000 % 25/07/2050 56.6 66.5 66   ## 1.927.530 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 2,000 % 25/09/2050 56.5 66   ## 1.927.530 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 2,000 % 25/09/2050 164.764   ## 469.410 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 25/09/2050 62.5 68   ## 1.020 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/10/2050 76.4 76   ## 753.700 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/10/2050 77.4 7.5 9.2   ## 4.938.858 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 2,000 % 01/09/2051 711,592   ## 4.938.858 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 2,000 % 01/09/2051 4,492.001   ## 5.000.000 Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(***) USD 2,000 % 01/09/2051 8.811.570   ## 9.000.000 Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(***) USD 3,000 % 01/12/2051 8.223.255   ## 4.000.000 Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(***) USD 3,000 % 01/12/2051 8.223.255   ## 5.000.000 Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(***) USD 4,500 % 01/12/2051 8.223.255   ## 5.000.000 Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(***) USD 2,000 % 01/12/2052 4.397.202   ## 7.000.000 Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(***) USD 4,500 % 01/12/2052 4.397.202   ## 7.000.000 Federal National Mortgage Association (GNMA)** USD 6,159 % 20/02/2040 44.911   ## 1.412.111 Government National Mortgage Association (GNMA)** USD 6,349 % 20/07/2043 223.387   ## 233.207 Government National Mortgage Association (GNMA)** USD 6,009 % 20/10/2043 223.387   ## 233.207 Government National Mortgage Association (GNMA)** USD 6,009 % 20/10/2044 228.805   ## 323.840 Government National Mortgage Association (GNMA)** USD 6,009 % 20/10/2044 277.173   ## 22.491 Government National Mortgage Association (GNMA)** USD 6,009 % 20/10/2044 277.173   ## 22.491 Government National Mortgage Association (GNMA)** USD 6,159 % 20/01/2045 24.1335   ## 32.200 Government National Mortgage Associ		. ,					0,04
426.258 Federal National Mortgage Association (FNMA)  1.927.530 Federal National Mortgage Association (FNMA)  489.410 Federal National Mortgage Association (FNMA)  81.020 Federal National Mortgage Association (FNMA)  81.020 Federal National Mortgage Association (FNMA)  4.930 %  81.020 Federal National Mortgage Association (FNMA)  4.930 %  4.930 %  4.930 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %  6.90 %		. ,					0,07
1.927.530 Federal National Mortgage Association (FNMA) 469.410 Federal National Mortgage Association (FNMA) 81.020 Federal National Mortgage Association (FNMA) 81.020 Federal National Mortgage Association (FNMA) 4.936.858 Federal National Mortgage Association (FNMA) 81.000 Federal National Mortgage Association (FNMA) 82.500							0,01
499,410         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         25/09/2050         62,568           81.02         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/10/2050         76,476           753.70         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/10/9/2051         4,492.001           10.000.00         Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(e)         USD         2,000 %         13/12/2051         8.811.570           9.000.00         Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(e)         USD         3,000 %         13/12/2051         8.223.255           4.000.00         Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(e)         USD         3,000 %         13/12/2051         8.223.255           4.000.00         Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(e)         USD         2,000 %         13/12/2052         3.97.202           7.000.00         Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(e)         USD         4,500 %         14/01/2052         6,617.431           293.05         Government National Mortgage Association (GNMA)(e)         USD         6,159 %         20/01/2043         222.387           233.207         Government National Mortgage Association (GMMA)         USD         4,000 %			USD	2,000 %	25/09/2050	164.764	0,01
### ### ##############################			USD				0,01
753.700         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/06/2051         711.592           4.936.858         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         2,500 %         01/09/2051         4.492.001           10.000.000         Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(e)         USD         3,000 %         13/12/2051         8.811.570           9.000.000         Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(e)         USD         3,000 %         13/12/2051         8.223.255           4.000.000         Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(e)         USD         4,500 %         13/01/2052         4.97 202           7.000.000         Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(e)         USD         4,500 %         14/01/2052         6.617.431           293.085         Government National Mortgage Association (GNMA)(e)         USD         6,159 %         20/02/2040         44.911           1.412.11         Government National Mortgage Association (GNMA)(e)         USD         6,349 %         20/07/2043         22.109           240.639         Government National Mortgage Association (GNMA)(e)         USD         6,009 %         20/11/2044         228.805           323.40         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,0							0,01
4.936.858         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         2,500 %         01/09/2051         4.492.001           10.000.000         Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)</sup> USD         2,000 %         13/12/2051         8.811.570           9.000.000         Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)</sup> USD         3,000 %         13/12/2051         3.779.192           5.000.000         Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)</sup> USD         2,000 %         13/12/2051         3.779.192           5.000.000         Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)</sup> USD         2,000 %         13/11/2052         4.397.202           7.000.000         Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)</sup> USD         4,500 %         14/01/2052         4.397.202           6.157.431         293.085         Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup> USD         6,159 %         20/07/2043         222.387           233.207         Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup> USD         6,009 %         20/11/2043         21.109           240.639         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         5,509 %         20/11/2044         228.805           323.640         Government National Mortgage Associati		. ,					0,06
9.000.000 Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)</sup> USD 3,000 % 13/12/2051 8.223.255 4.000.000 Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)</sup> USD 4,500 % 13/12/2051 3.779.192 5.000.000 Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)</sup> USD 2,000 % 13/01/2052 4.397.202 7.000.000 Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)</sup> USD 4,500 % 14/01/2052 6.6177.431 293.085 Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup> USD 6,159 % 20/02/2040 44.911 1.412.111 Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup> USD 6,349 % 20/07/2043 221.387 233.207 Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup> USD 6,009 % 20/10/2043 21.109 240.639 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,000 % 20/11/2044 228.805 323.640 Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup> USD 5,509 % 20/11/2044 44.185 291.510 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,000 % 20/12/2044 277.173 22.491 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,000 % 20/05/2045 21.385 200.214 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,000 % 20/05/2045 21.385 200.214 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,000 % 20/08/2045 21.385 209.214 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,000 % 20/08/2045 21.385 209.214 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,000 % 20/08/2045 21.385 209.214 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,000 % 20/08/2045 21.385 209.014 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,000 % 20/08/2045 21.385 209.014 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,000 % 20/08/2045 21.385 209.014 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,000 % 20/08/2045 21.385 20.000 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,000 % 20/08/2045 20.008/2045 20.008/2045 20.008/2045 20.008/2045 20.008/2045 20.008/2045 20.008/2045 20.008/2045 20.008/2045 20.008/2045 20.008/2045 20.008/2045 20.008/2045 20.008/2045 20.008/2045 20.008/2045 20.008/2045 20.008/2045 20.008/2045 20.008/2045 20.008/2045 20.008/2045 2			USD	2,500 %	01/09/2051	4.492.001	0,37
4.000.000         Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(e)         USD         4,500 %         13/12/2051         3.779.192           5.000.000         Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(e)         USD         2,000 %         13/01/2052         4.397.202           7.000.000         Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(e)         USD         4,500 %         14/01/2052         6.617.431           293.085         Government National Mortgage Association (GNMA)(e)         USD         6,159 %         20/02/2040         44.911           1.412.111         Government National Mortgage Association (GNMA)(e)         USD         6,349 %         20/07/2043         222.387           233.207         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         6,009 %         20/11/2044         228.805           240.639         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         5,509 %         20/11/2044         228.805           291.510         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/12/2044         277.173           22.491         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/05/2045         21.385           200.214         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         6,159 % <td>10.000.000</td> <td>Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(e)</td> <td>USD</td> <td>2,000 %</td> <td>13/12/2051</td> <td>8.811.570</td> <td>0,72</td>	10.000.000	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(e)	USD	2,000 %	13/12/2051	8.811.570	0,72
4.000.000       Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(e)       USD       4,500 %       13/12/2051       3.779.192         5.000.000       Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(e)       USD       2,000 %       13/01/2052       4.397.202         7.000.000       Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(e)       USD       4,500 %       14/01/2052       6.617.431         293.085       Government National Mortgage Association (GNMA)(e)       USD       6,159 %       20/02/2040       44.911         1.412.111       Government National Mortgage Association (GNMA)(e)       USD       6,349 %       20/07/2043       222.387         233.207       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       6,009 %       20/11/2044       222.387         233.640       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,000 %       20/11/2044       228.805         291.510       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,000 %       20/12/2044       277.173         22.491       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,000 %       20/05/2045       21.385         200.214       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       6,159 %       20/08/2045       21.323         169.277       Gove			USD	3,000 %	13/12/2051	8.223.255	0,67
5.000.000         Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(e)         USD         2,000 %         13/01/2052         4.397.202           7.000.000         Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(e)         USD         4,500 %         14/10/12052         6.617.431           293.085         Government National Mortgage Association (GNMA)(e)         USD         6,349 %         20/07/2043         222.387           233.207         Government National Mortgage Association (GNMA)(e)         USD         6,009 %         20/10/2043         21.109           240.639         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/11/2044         228.805           323.640         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         5,509 %         20/11/2044         24.185           291.510         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/05/2045         21.385           200.214         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/08/2045         21.385           52.080         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         6,159 %         20/08/2045         21.35           157.176         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         6,159 % <td< td=""><td></td><td></td><td>USD</td><td>4,500 %</td><td>13/12/2051</td><td>3.779.192</td><td>0,31</td></td<>			USD	4,500 %	13/12/2051	3.779.192	0,31
293.085         Government National Mortgage Association (GNMA)(c)         USD         6,159 %         20/02/2040         44.911           1.412.111         Government National Mortgage Association (GNMA)(c)         USD         6,349 %         20/07/2043         222.387           233.207         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         6,009 %         20/10/2043         21.109           240.639         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/11/2044         228.805           323.640         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         5,509 %         20/11/2044         248.185           291.510         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/12/2044         277.173           22.491         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/05/2045         21.385           200.214         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         6,159 %         20/08/2045         21.333           169.272         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         6,159 %         20/10/2045         24.125           52.080         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         6,159 %         20/11/2045 <td></td> <td></td> <td>USD</td> <td>2,000 %</td> <td>13/01/2052</td> <td>4.397.202</td> <td>0,36</td>			USD	2,000 %	13/01/2052	4.397.202	0,36
1.412.111       Government National Mortgage Association (GNMA)(c)       USD       6,349 %       20/07/2043       222.387         233.207       Government National Mortgage Association (GNMA)(c)       USD       6,009 %       20/10/2043       21.109         240.639       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,000 %       20/11/2044       228.805         323.640       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,509 %       20/11/2044       44.185         291.510       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,000 %       20/12/2044       277.173         22.491       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,000 %       20/05/2045       21.385         200.214       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,000 %       20/08/2045       21.333         169.272       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       6,159 %       20/10/2045       26.125         52.080       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       6,159 %       20/11/2045       19.520         157.176       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,000 %       20/01/2046       148.929         3.209.007       Government National Mortgage A	7.000.000	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(e)	USD	4,500 %	14/01/2052	6.617.431	0,54
233.207 Government National Mortgage Association (GNMA)(c) 240.639 Government National Mortgage Association (GNMA) 323.640 Government National Mortgage Association (GNMA) 323.640 Government National Mortgage Association (GNMA)(c) 323.640 Government National Mortgage Association (GNMA) 323.640 Government National Mortgage Association (GNMA) 323.640 Government National Mortgage Association (GNMA) 324.91 Government National Mortgage Association (GNMA) 325.491 Government National Mortgage Association (GNMA) 326.491 Government National Mortgage Association (GNMA) 327.491 Government National Mortgage Association (GNMA) 328.492 Government National Mortgage Association (GNMA) 329.493 Government National Mortgage Association (GNMA) 329.494 Government National Mortgage Association (GNMA) 329.495 Government National Mortgage Association (GNMA) 329.495 Government National Mortgage Association (GNMA) 329.496 Government National Mortgage Association (GNMA) 329.497 Government National Mortgage Association (GNMA) 329.497 Government National Mortgage Association (GNMA) 329.4987 Government National Mortgage Association (GNMA) 329.4987 Government National Mortgage Association (GNMA) 329.4997 Government National Mortgage Association (GNMA) 329.490 Government	293.085	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,159 %	20/02/2040	44.911	0,00
240.639       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,000 %       20/11/2044       228.805         323.640       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,509 %       20/11/2044       44.185         291.510       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,000 %       20/12/2044       277.173         22.491       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,000 %       20/05/2045       21.385         200.214       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,000 %       20/08/2045       26.125         52.080       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,000 %       20/10/2045       26.125         52.080       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,000 %       20/10/2045       49.419         129.951       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       6,159 %       20/11/2045       19.520         157.176       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,000 %       20/01/2046       148.929         3.209.007       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,569 %       20/07/2047       398.031         198.456       Government National Mortgage Associatio	1.412.111	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,349 %	20/07/2043	222.387	0,02
323.640 Government National Mortgage Association (GNMA)(c) 291.510 Government National Mortgage Association (GNMA) 224.91 Government National Mortgage Association (GNMA) 224.91 Government National Mortgage Association (GNMA) 224.91 Government National Mortgage Association (GNMA) 225.02.14 Government National Mortgage Association (GNMA) 226.02.15 Government National Mortgage Association (GNMA) 227.17 Government National Mortgage Association (GNMA) 228.02.16 Government National Mortgage Association (GNMA) 229.02 Government National Mortgage Association (GNMA) 229.03 Government National Mortgage Association (GNMA) 229.04 Government National Mortgage Association (GNMA) 229.05 Government National Mortgage Association (GNMA) 229.05 Government National Mortgage Association (GNMA) 230.09.007 Government National Mortgage Association (GNMA) 230.007 Government Nati	233.207	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,009 %	20/10/2043	21.109	0,00
291.510         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/12/2044         277.173           22.491         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/05/2045         21.385           200.214         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/08/2045         21.333           169.272         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         6,159 %         20/10/2045         49.419           52.080         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/11/2045         49.419           129.951         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         6,159 %         20/11/2045         19.520           157.176         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/01/2046         148.929           3.209.007         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         5,569 %         20/07/2047         398.031           198.456         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,500 %         20/07/2048         843.880           436.572         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         5,000 %         20/08/2048	240.639	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/11/2044	228.805	0,02
291.510         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/12/2044         277.173           22.491         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/05/2045         21.385           200.214         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/08/2045         21.333           169.272         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         6,159 %         20/10/2045         49.419           52.080         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/11/2045         49.419           129.951         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         6,159 %         20/11/2045         19.520           157.176         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/01/2046         148.929           3.209.007         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         5,569 %         20/07/2047         398.031           198.456         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,500 %         20/07/2048         843.880           436.572         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         5,000 %         20/08/2048	323.640	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,509 %	20/11/2044	44.185	0,00
200.214       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,000 %       20/08/2045       21.333         169.272       Government National Mortgage Association (GNMA)(c)       USD       6,159 %       20/08/2045       26.125         52.080       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,000 %       20/10/2045       49.419         129.951       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       6,159 %       20/11/2045       19.520         157.176       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,000 %       20/01/2046       148.929         3.209.007       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,569 %       20/07/2047       398.031         198.456       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,500 %       20/05/2048       186.050         892.687       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/06/2048       438.80         436.572       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/08/2048       408.830         444.962       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/08/2048       420.389         161.729       Government National Mortgage Asso							0,02
169.272         Government National Mortgage Association (GNMA)(c)         USD         6,159 %         20/08/2045         26.125           52.080         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/10/2045         49.419           129.951         Government National Mortgage Association (GNMA)(c)         USD         6,159 %         20/11/2045         19.520           157.176         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/01/2046         148.929           3.209.007         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         5,569 %         20/07/2047         398.031           198.456         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,500 %         20/08/2048         186.050           892.687         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         5,000 %         20/07/2048         843.880           436.572         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,500 %         20/08/2048         408.830           444.962         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         5,000 %         20/08/2048         408.830           161.729         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         6,109 %         20/08/2048<	22.491	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/05/2045	21.385	0,00
52.080 Government National Mortgage Association (GNMA)         USD 4,000 %         20/10/2045         49.419           129.951 Government National Mortgage Association (GNMA)(c)         USD 6,159 %         20/11/2045         19.520           157.176 Government National Mortgage Association (GNMA)         USD 4,000 %         20/01/2046         148.929           3.209.007 Government National Mortgage Association (GNMA)         USD 5,569 %         20/07/2047         398.031           198.456 Government National Mortgage Association (GNMA)         USD 4,500 %         20/05/2048         186.050           892.687 Government National Mortgage Association (GNMA)         USD 5,000 %         20/07/2048         843.880           436.572 Government National Mortgage Association (GNMA)         USD 4,500 %         20/08/2048         408.830           444.962 Government National Mortgage Association (GNMA)         USD 5,000 %         20/08/2048         408.830           161.729 Government National Mortgage Association (GNMA)         USD 6,109 %         20/08/2048         20.640           1.012.115 Government National Mortgage Association (GNMA)         USD 6,109 %         20/09/2048         478.294           1.096.864 Government National Mortgage Association (GNMA)         USD 5,000 %         20/09/2048         178.294           1.096.864 Government National Mortgage Association (GNMA)         USD 6,109 %	200.214	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/08/2045	21.333	0,00
129.951         Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup> USD         6,159 %         20/11/2045         19.520           157.176         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,000 %         20/01/2046         148.929           3.209.007         Government National Mortgage Association (GNMA)(c)         USD         5,569 %         20/07/2047         398.031           198.456         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,500 %         20/05/2048         186.050           892.687         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         5,000 %         20/07/2048         843.880           436.572         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         4,500 %         20/08/2048         408.830           444.962         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         5,000 %         20/08/2048         420.389           161.729         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         6,109 %         20/08/2048         20.640           1.012.115         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         5,000 %         20/09/2048         475.21           188.771         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         5,000 %         20/09/	169.272	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,159 %	20/08/2045	26.125	0,00
129.951       Government National Mortgage Association (GNMA)(c)       USD       6,159 %       20/11/2045       19.520         157.176       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,000 %       20/01/2046       148.929         3.209.007       Government National Mortgage Association (GNMA)(c)       USD       5,569 %       20/07/2047       398.031         198.456       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,500 %       20/05/2048       186.050         892.687       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/08/2048       483.880         436.572       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,500 %       20/08/2048       408.830         444.962       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/08/2048       420.389         161.729       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       6,109 %       20/08/2048       20.640         1.012.115       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/09/2048       47.521         188.771       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/09/2048       178.294         1.096.864       Government National Mor	52.080	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/10/2045	49.419	0,00
3.209.007       Government National Mortgage Association (GNMA)(c)       USD       5,569 %       20/07/2047       398.031         198.456       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,500 %       20/05/2048       186.050         892.687       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/07/2048       843.880         436.572       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,500 %       20/08/2048       408.830         444.962       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/08/2048       420.389         161.729       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       6,109 %       20/08/2048       947.521         188.771       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/09/2048       947.521         1.096.864       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/09/2048       178.294         1.096.864       Government National Mortgage Association (GNMA)(c)       USD       6,109 %       20/09/2048       148.518			USD	6,159 %	20/11/2045	19.520	0,00
3.209.007       Government National Mortgage Association (GNMA)(c)       USD       5,569 %       20/07/2047       398.031         198.456       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,500 %       20/05/2048       186.050         892.687       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/07/2048       843.880         436.572       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,500 %       20/08/2048       408.830         444.962       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/08/2048       420.389         161.729       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       6,109 %       20/08/2048       947.521         188.771       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/09/2048       947.521         1.096.864       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/09/2048       178.294         1.096.864       Government National Mortgage Association (GNMA)(c)       USD       6,109 %       20/09/2048       148.518	157.176	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/01/2046	148.929	0,01
198.456       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,500 %       20/05/2048       186.050         892.687       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/07/2048       843.880         436.572       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,500 %       20/08/2048       408.830         444.962       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/08/2048       420.389         161.729       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       6,109 %       20/08/2048       20.640         1.012.115       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,500 %       20/09/2048       947.521         188.771       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/09/2048       178.294         1.096.864       Government National Mortgage Association (GNMA)(c)       USD       6,109 %       20/09/2048       148.518							0,03
892.687       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/07/2048       843.880         436.572       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,500 %       20/08/2048       408.830         444.962       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/08/2048       420.389         161.729       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       6,109 %       20/08/2048       20.640         1.012.115       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,500 %       20/09/2048       497.521         188.771       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/09/2048       178.294         1.096.864       Government National Mortgage Association (GNMA)(c)       USD       6,109 %       20/09/2048       148.518							0,02
436.572       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,500 %       20/08/2048       408.830         444.962       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/08/2048       420.389         161.729       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       6,109 %       20/08/2048       20.640         1.012.115       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,500 %       20/09/2048       947.521         188.771       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/09/2048       178.294         1.096.864       Government National Mortgage Association (GNMA)(c)       USD       6,109 %       20/09/2048       148.518		. ,					0,07
444.962       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/08/2048       420.389         161.729       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       6,109 %       20/08/2048       20.640         1.012.115       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,500 %       20/09/2048       947.521         1.88.771       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/09/2048       178.294         1.096.864       Government National Mortgage Association (GNMA)(c)       USD       6,109 %       20/09/2048       148.518		. ,					0,03
161.729       Government National Mortgage Association (GNMA)(c)       USD       6,109 %       20/08/2048       20.640         1.012.115       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,500 %       20/09/2048       947.521         188.771       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/09/2048       178.294         1.096.864       Government National Mortgage Association (GNMA)(c)       USD       6,109 %       20/09/2048       148.518							0,03
1.012.115       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       4,500 %       20/09/2048       947.521         188.771       Government National Mortgage Association (GNMA)       USD       5,000 %       20/09/2048       178.294         1.096.864       Government National Mortgage Association (GNMA)(c)       USD       6,109 %       20/09/2048       148.518		, , , , , , , , , , , , , , , , , , ,					0,00
188.771         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         5,000 %         20/09/2048         178.294           1.096.864         Government National Mortgage Association (GNMA)(c)         USD         6,109 %         20/09/2048         148.518							0,08
1.096.864 Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup> USD 6,109 % 20/09/2048 148.518							0,02
							0,01
100.011 GOVERNMENT MALIONAL INIOTRAGE ASSOCIATION (UNIVIA) USD 3.000 % ZU/10/2048 bbb.022		Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/10/2048	666.022	0,06
1.605.202 Government National Mortgage Association (GNMA)(c) USD 6,059 % 20/10/2048 209.615							0,01
1.636.109 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/11/2048 1.544.970		. ,					0,13
4.271.290 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 4,500 % 20/12/2048 3.996.053							0,33
808.237 Government National Mortgage Association (GNMA) USD 5,000 % 20/12/2048 765.374		. ,					0,06

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en EUR	% de
	<u> </u>					patimon
Estados Unidos –	n garantía de activos emitidos o garantizados por agenci	as – (continuaci	on)			
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/01/2049	5.051.916	0,4
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/01/2049	772.504	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5.959 %	20/01/2049	49.724	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	3,699 %	20/02/2049	36.722	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/02/2049	474.334	0,0
540.455	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/02/2049	505.369	0,0
723.862	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/03/2049	673.154	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/03/2049	239.945	0,0
526.945	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/03/2049	498.859	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/05/2049	426.083	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	3,179 %	20/06/2049	61.061	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,009 %	20/06/2049	18.328	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/08/2049	913.162	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/08/2049	2.509.316	0,2
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup>	USD	5,959 %	20/08/2049	116.001	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD USD	6,009 %	20/08/2049	37.157	0,0 0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,959 % 6,000 %	20/09/2049	379.898 72.899	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup>	USD	6,009 % 6,009 %	20/09/2049 20/09/2049	62.131	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/10/2049	57.024	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/10/2049	669.131	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/12/2049	189.679	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/12/2049	405.779	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/01/2050	4.566.711	0,3
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,959 %	20/02/2050	505.637	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/04/2050	78.519	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,959 %	20/04/2050	356.890	0,0
1.449.829	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/06/2050	146.044	0,0
560.812	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,059 %	20/06/2050	73.677	0,0
3.679.371	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	2,500 %	20/10/2050	316.525	0,0
710.745	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	2,500 %	20/10/2050	68.438	0,0
741.884	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	2,500 %	20/11/2050	32.579	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/02/2051	7.306.833	0,6
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/04/2051	4.930.689	0,4
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/07/2051	548.395	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)</sup>	USD	2,500 %	20/12/2051	9.054.318	0,7
	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)</sup>	USD	3,000 %	20/12/2051	4.555.304	0,3
4.000.000	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)</sup>	USD -	3,000 %	20/01/2052	3.638.614 26.740.037	10,3
	ACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARAN	TIZADOS POR AG	ENCIAS			
Coste EUR 124.3	29.510) In garantía de activos no emitidos ni garantizados por ag	noise 10 67 %		1	26.740.037	10,3
slas Caimán	in garantia de activos no emitidos ni garantizados por agr	encias – 10,67 /6				
	AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,424 %	15/01/2033	1.759.210	0,1
	Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(c)(d)	USD	1,182 %	18/04/2034	1.162.548	0,1
	Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(c)(d)	USD	3,032 %		1.222.572	0,1
	ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(c)(d)	USD	1,492 %	16/01/2033		0,2
	ICG US CLO Ltd. 2017-1A "ARR" 144A(c)(d)	USD	1,306 %	28/07/2034		1,0
	ICG US CLO Ltd. 2017-1A "DRR" 144A(c)(d)	USD	3,686 %	28/07/2034		0,2
	Invesco CLO Ltd. 2021-2A "A" 144A(c)(d)	USD	1,244 %	15/07/2034		1,2
	Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	0,874 %	15/04/2029		0,3
	Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(d)	USD	1,412 %	20/01/2032		0,2
	Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(c)(d)	USD	1,432 %	20/04/2033		0,2
	Marble Point CLO XXII Ltd. 2021-2A "A" 144A(c)(d)	USD	1,324 %	25/07/2034		1,2
	MP CLO VIII Ltd. 2015-2A "ARR" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,336 %	28/04/2034		0,8
	Ocean Trails Clo XI "D" 144A(c)(d)	USD	3,852 %	20/07/2034		0,2
	Trinitas CLO XVI Ltd. 2021-16A "A1" 144A(c)(d)	USD	1,312 %	20/07/2034		1,2
2.450.000	Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD .	1,462 %	20/01/2034		0,7
rlanda					92.795.261	7,6
rlanda 3 000 162	Haus European Loan Conduit No 39 DAC 39X "A1"(C)	EUR	0,650 %	28/07/2051	3.105.070	0,2
	Primrose Residential 2021-1 DAC "A"(c)	EUR	0,650 %	28/07/2051 24/03/2061	2.859.095	0,2
	Viridis European Loan Conduit No 38 DAC "A"(c)	GBP	1,251 %	22/07/2029		
2.200.000	vindis European Edan Conduit NO 36 DAC A 17	GBP .	1,201 70	22/07/2029	2.606.639 8.570.804	0,2
Reino Unido					3.37 0.004	0,7
	Eurohome UK Mortgages Plc. 2007-2 "A2"(c)	GBP	0,260 %	15/09/2044	74.066	0,0

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en EUR	% de
Obligaciones co	on garantía de activos no emitidos ni garantizados por agenc	ias – (continu	ıación)			
•	Finsbury Square 2021-1GRX "AGRN" <sup>(c)</sup>	GBP	0,700 %	16/12/2067	4.490.463	0,3
	Finsbury Square Plc. 2018-2 "A"(c)	GBP	1.017 %	12/09/2068	570.990	0,0
	Harben Finance 2017-1X Plc. "A"(c)	GBP	0,914 %	20/08/2056	584.212	0,0
	London Wall Mortgage Capital Plc. 2021-FL2 "A"(c)	GBP	0,000 %	15/05/2052	1.879.204	0,1
	Mortgage Funding Plc. 2008-1 "A1"(c)	GBP	1,167 %	13/03/2046	164.502	0,0
	Stratton Mortgage Funding 2019-1 Plc. "A"(c)	GBP	1,250 %	25/05/2051	2.296.261	0,19
		-			10.059.698	0,8
Estados Unidos						
	American Home Mortgage Assets Trust 2006-2 "1A1"(c)	USD	1,043 %	25/09/2046	568.192	0,0
	Bank 2017-BNK4 "C"(c)	USD	4,372 %	15/05/2050	983.863	0,0
	Bank 2017-BNK6 "A4"	USD	3,254 %	15/07/2060	1.629.018	0,1
	Bank 2018-BNK14 "D" 144A(d)	USD	3,000 %	15/09/2060	527.711	0,0
	Bank 2018-BNK15 "D" 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,000 %	15/11/2061	388.792	0,0
	Benchmark Mortgage Trust 2018-B1 "D" 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,750 %	15/01/2051	347.859	0,0
	Benchmark Mortgage Trust 2018-B6 "D" 144A(c)(d)	USD	3,261 %	10/10/2051	1.341.208	0,1
	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C6 "D" 144A(c)(d)	USD	4,338 %	10/11/2049	401.302	0,0
	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P7 "D" 144A(d)	USD	3,250 %	14/04/2050	213.540	0,0
	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(d)	USD	3,000 %	15/09/2050	559.889	0,0
	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01 "1M2" 144A(c)(d)	USD	1,600 %	25/10/2041	594.590	0,0
	Ford Credit Auto Owner Trust 2018-1 "A" 144A(d)	USD	3,190 %	15/07/2031	3.362.026	0,2
	Higher Education Funding I 2014-1 "A" 144A(c)(d)	USD	1,230 %	25/05/2034	839.616	0,0
	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2017-C7 "D" 144A(d)	USD	3,000 %	15/10/2050	310.088	0,0
	KnowledgeWorks Foundation 2010-1 "A"(c)	USD	1,130 %	25/02/2042	40.709	0,0
94.849	Lehman XS Trust Series 2005-5N "1A1"(c)	USD	0,392 %	25/11/2035	83.734	0,0
451.117	Lehman XS Trust Series 2006-14N "1A1A"(c)	USD	0,472 %	25/09/2046	388.325	0,0
300.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C9 "A4"	USD	3,102 %	15/05/2046	269.692	0,0
2.418.133	Navient Student Loan Trust 2017-2A "A" 144A(c)(d)	USD	1,142 %	27/12/2066	2.147.087	0,1
1.218.989	PHEAA Student Loan Trust 2016-1A "A" 144A(c)(d)	USD	1,242 %	25/09/2065	1.093.697	0,0
187.233	RASC 2006-KS7 Trust "A4"(c)	USD	0,332 %	25/09/2036	164.215	0,0
805.690	SLM Student Loan Trust 2005-5 "A4"(c)	USD	0,264 %	25/10/2028	707.615	0,0
491.829	SLM Student Loan Trust 2008-4 "A4"(c)	USD	1,774 %	25/07/2022	438.297	0,0
134.057	Soundview Home Loan Trust 2007-NS1 "A3"(c)	USD	0,292 %	25/01/2037	117.754	0,0
550.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C37 "D" 144A(c)(d)	USD	3,342 %	15/12/2049	450.911	0,0
	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C38 "D" 144A(d)	USD	3,000 %	15/07/2050	715.255	0,0
					18.684.985	1,5
TOTAL DE OBLIG GARANTIZADOS	ACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS NO EMITIDOS NI POR AGENCIAS					
(coste EUR 123.7	86.963)				130.110.748	10,6
TOTAL DE VALOR REGULADO	RES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO					
(coste EUR 302.8	47.642)				313.497.627	25,7
	ADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS					
(coste EUR 1.180	.232.519)			•		99,8
	" I " II I I I I I I I I I I I I I I I				1.217.436.053	
-	antía de activos hipotecarios a plazo cubiertos – (0,83 %)	IISD	5,000.9/	12/12/2051		<u> </u>
(2.000.000)	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)(f)</sup>	USD	5,000 %		(1.924.953)	(0,10
(2.000.000) (8.000.000)	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)(f)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup>	USD	3,000 %	20/12/2051	(1.924.953) (7.288.487)	(0,10)
(2.000.000) (8.000.000)	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)(f)</sup>				(1.924.953)	(0,10)
(2.000.000) (8.000.000)	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)(f)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup>	USD	3,000 %	20/12/2051 20/12/2051	(1.924.953) (7.288.487)	(0,16 (0,60 (0,07
(2.000.000) (8.000.000) (1.000.000) TOTAL DE VALOR	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)(f)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> RES HIPOTECARIOS A PLAZO CUBIERTOS	USD	3,000 %	20/12/2051 20/12/2051	(1.924.953) (7.288.487) (927.393) (10.140.833)	(0,10 (0,60 (0,0) (0,83
(2.000.000) (8.000.000) (1.000.000)	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)(f)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> RES HIPOTECARIOS A PLAZO CUBIERTOS	USD	3,000 %	20/12/2051 20/12/2051	(1.924.953) (7.288.487) (927.393)	(0,10 (0,60 (0,0) (0,83
(2.000.000) (8.000.000) (1.000.000) TOTAL DE VALOR (coste EUR (9.983)	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)(f)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> RES HIPOTECARIOS A PLAZO CUBIERTOS 8.095))	USD	3,000 %	20/12/2051 20/12/2051	(1.924.953) (7.288.487) (927.393) (10.140.833)	(0,10 (0,60 (0,0) (0,83
(2.000.000) (8.000.000) (1.000.000) TOTAL DE VALOF (coste EUR (9.983)	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)(f)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> RES HIPOTECARIOS A PLAZO CUBIERTOS  8.095))  uros – 0,40 %	USD	3,000 %	20/12/2051 20/12/2051 Valor de mercado de la asignación	(1.924.953) (7.288.487) (927.393) (10.140.833) (10.140.833)	(0,11 (0,6) (0,0) (0,8) (0,8)
(2.000.000) (8.000.000) (1.000.000)  TOTAL DE VALOF (coste EUR (9.983)	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)(f)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> RES HIPOTECARIOS A PLAZO CUBIERTOS  1.095))  1.005 – 0,40 %  Descripción del valor	USD	3,000 %	20/12/2051 20/12/2051 	(1.924.953) (7.288.487) (927.393) (10.140.833) (10.140.833)	(0,16 (0,66 (0,07 (0,83 (0,83
(2.000.000) (8.000.000) (1.000.000) TOTAL DE VALOF (coste EUR (9.983)	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)(f)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> RES HIPOTECARIOS A PLAZO CUBIERTOS  1.095))  1.005 – 0,40 %  Descripción del valor  AUD Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021	USD	3,000 %	20/12/2051 20/12/2051 Valor de mercado de la asignación	(1.924.953) (7.288.487) (927.393) (10.140.833) (10.140.833)	(0,11 (0,6) (0,0) (0,8) (0,8)
(2.000.000) (8.000.000) (1.000.000)  TOTAL DE VALOF (coste EUR (9.983)  Contratos de fute Número de contratos	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)(f)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> RES HIPOTECARIOS A PLAZO CUBIERTOS  6.095))  LIFOS - 0,40 %  Descripción del valor  AUD	USD	3,000 % 4,000 %	20/12/2051 20/12/2051 Valor de mercado de la asignación EUR	(1.924.953) (7.288.487) (927.393) (10.140.833) (10.140.833) Plusvalía latente en EUR	(0,11 (0,6) (0,0) (0,8) (0,8)
(2.000.000) (8.000.000) (1.000.000)  TOTAL DE VALOF (coste EUR (9.983)  Contratos de futul  Número de contratos	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)(f)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> RES HIPOTECARIOS A PLAZO CUBIERTOS  1.095))  1.005 – 0,40 %  Descripción del valor  AUD Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  CAD Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022  EUR	USD	3,000 % 4,000 % Larga	20/12/2051 20/12/2051 Valor de mercado de la asignación EUR 14.646.173	(1.924.953) (7.288.487) (927.393) (10.140.833) (10.140.833) Plusvalia latente en EUR 154.257	(0,11 (0,6) (0,0) (0,8) (0,8) % depatrimoni
(2.000.000) (8.000.000) (1.000.000)  TOTAL DE VALOF (coste EUR (9.983)  Contratos de fute Número de contratos	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)(f)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> RES HIPOTECARIOS A PLAZO CUBIERTOS 3.095))  Uros – 0,40 %  Descripción del valor  AUD Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  CAD Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022	USD	3,000 % 4,000 % Larga	20/12/2051 20/12/2051 Valor de mercado de la asignación EUR	(1.924.953) (7.288.487) (927.393) (10.140.833) (10.140.833) Plusvalia latente en EUR	(0,1) (0,6) (0,0) (0,8) (0,8) % d patrimon
(2.000.000) (8.000.000) (1.000.000)  TOTAL DE VALOF (coste EUR (9.983)  Contratos de futul  Número de contratos	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)(f)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> RES HIPOTECARIOS A PLAZO CUBIERTOS  1.095))  1.005 – 0,40 %  Descripción del valor  AUD Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  CAD Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022  EUR	USD	3,000 % 4,000 % Larga	20/12/2051 20/12/2051 Valor de mercado de la asignación EUR 14.646.173	(1.924.953) (7.288.487) (927.393) (10.140.833) (10.140.833) Plusvalia latente en EUR 154.257	(0,1) (0,6) (0,0) (0,8) (0,8) (0,8) patrimoni
(2.000.000) (8.000.000) (1.000.000)  TOTAL DE VALOF (coste EUR (9.983)  Contratos de futul  Número de contratos  167  178	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(e)(f)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(e)(g)</sup> RES HIPOTECARIOS A PLAZO CUBIERTOS 8.095))  Descripción del valor  AUD Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  CAD Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022  EUR Futuros sobre OAT en euros 08/12/2021	USD	3,000 % 4,000 % Larga Larga	20/12/2051 20/12/2051 Valor de mercado de la asignación EUR 14.646.173 17.353.115	(1.924.953) (7.288.487) (927.393) (10.140.833) (10.140.833) Plusvalia latente en EUR 154.257 327.644	(0,11 (0,6) (0,0) (0,8) (0,8) % dipatrimoni

Contratos	de	futuros	-	(continuación)	
-----------	----	---------	---	----------------	--

Número de contratos	Descripción del valor		Valor de mercado de la asignación EUR	Plusvalía latente en EUR	% de patrimonio
	GBP				
178	Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022	Larga	26.487.360	353.146	0,0
	JPY				
30	Futuros sobre bonos del Estado de Japón a 10 años 13/12/2021	Larga	35.593.425	39.806	0,00
	USD				
343	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022	Larga	48.824.759	1.153.307	0,09
816	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022	Larga	93.990.371	1.436.466	0,12
85	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022	Larga	16.361.543	48.272	0,00
306	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022	Larga	53.718.388	1.915.291	0,16
			212.895.061	4.553.336	0,37
PLUSVALÍA LATE	NTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS			6.055.189	0,49
PLUSVALÍA LATE Número de contratos	NTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS  Descripción del valor		Valor de mercado de la asignación EUR	6.055.189  Minusvalía latente en EUR	% de
Número de			asignación	Minusvalía latente en	% de
Número de	Descripción del valor	Larga	asignación	Minusvalía latente en	% de patrimonio
Número de contratos	Descripción del valor EUR	Larga Corta	asignación EUR	Minusvalía latente en EUR	% de patrimonio
Número de contratos	Descripción del valor  EUR  Futuros sobre Euro BTP Bonos del Estado de Italia 08/12/2021	•	asignación EUR 4.104.000	Minusvalía latente en EUR	% de patrimonio (0,00 (0,01
Número de contratos 27 (205)	Descripción del valor  EUR  Futuros sobre Euro BTP Bonos del Estado de Italia 08/12/2021  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años 08/12/2021	Corta	4.104.000 (35.372.750)	Minusvalía latente en EUR (18.330) (186.500)	% de patrimonio (0,00 (0,01 (0,01
Número de contratos 27 (205) (122)	Descripción del valor  EUR  Futuros sobre Euro BTP Bonos del Estado de Italia 08/12/2021  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años 08/12/2021  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/12/2021	Corta Corta	4.104.000 (35.372.750) (16.548.080)	Minusvalia latente en EUR (18.330) (186.500) (65.880)	% de patrimonio (0,00 (0,01 (0,01 (0,01 (0,00 (0,01 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,0) (0,00 (0,00 (0,0) (0,00 (0,0) (0,00 (0,0) (0,00 (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0
Número de contratos 27 (205) (122)	Descripción del valor  EUR  Futuros sobre Euro BTP Bonos del Estado de Italia 08/12/2021  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años 08/12/2021  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/12/2021	Corta Corta	4.104.000 (35.372.750) (16.548.080) 6.830.400	Minusvalía latente en EUR (18.330) (186.500) (65.880) (2.400)	% de patrimonio (0,00 (0,01 (0,01 (0,01 (0,00 (0,01 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,0) (0,00 (0,00 (0,0) (0,00 (0,0) (0,00 (0,0) (0,00 (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0
Número de contratos 27 (205) (122)	Descripción del valor  EUR  Futuros sobre Euro BTP Bonos del Estado de Italia 08/12/2021  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años 08/12/2021  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/12/2021  Futuros sobre bonos del Estado de Italia en euros a corto plazo 08/12/2021	Corta Corta	4.104.000 (35.372.750) (16.548.080) 6.830.400	Minusvalía latente en EUR (18.330) (186.500) (65.880) (2.400)	% de patrimonio (0,00 (0,01 (0,01 (0,00 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,02 (0,0))(0,02 (0,02 (0,0))(0,02 (0,0)(0,0)(0,0)(0,0)(0,0)(0,0)(0,0)(0,0
Número de contratos 27 (205) (122) 60	Descripción del valor  EUR  Futuros sobre Euro BTP Bonos del Estado de Italia 08/12/2021  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años 08/12/2021  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/12/2021  Futuros sobre bonos del Estado de Italia en euros a corto plazo 08/12/2021  USD	Corta Corta Larga	4.104.000 (35.372.750) (16.548.080) 6.830.400 (40.986.430)	Minusvalia latente en EUR (18.330) (186.500) (65.880) (2.400) (273.110)	% de patrimonio (0,00 (0,01 (0,01 (0,00 (0,02
Número de contratos 27 (205) (122) 60 (12)	Descripción del valor  EUR  Futuros sobre Euro BTP Bonos del Estado de Italia 08/12/2021  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años 08/12/2021  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/12/2021  Futuros sobre bonos del Estado de Italia en euros a corto plazo 08/12/2021  USD  Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022	Corta Corta Larga Corta	4.104.000 (35.372.750) (16.548.080) 6.830.400 (40.986.430)	Minusvalia latente en EUR  (18.330) (186.500) (65.880) (2.400) (273.110)	0,48 % de patrimonic (0,00) (0,01) (0,01) (0,00) (0,02) (0,00) (0,07) (0,07)

#### Contratos de divisas a plazo – 0,15 %

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	latente en EUR	% del patrimonio
USD	16.428.721	KRW	19.380.141.026	13/12/2021	73.632	0,01
USD	2.369.079	EUR	1.996.191	15/12/2021	84.947	0,01
USD	1.517.491	JPY	167.078.023	15/12/2021	29.302	0,00
USD	9.546.511	THB	312.695.960	15/12/2021	234.541	0,02
USD	4.616.585	IDR	66.146.102.350	17/12/2021	3.727	0,00
EUR	970.369	SEK	9.685.520	20/01/2022	26.302	0,00
EUR	56.747.296	GBP	47.976.748	21/01/2022	472.488	0,04
EUR	3.791.212	AUD	5.968.141	31/01/2022	40.147	0,00
EUR	12.569.940	CAD	18.128.907	31/01/2022	113.228	0,01
EUR	480.473.577	USD	541.162.868	10/02/2022	5.953.002	0,49
JPY	3.159.980.308	EUR	24.519.522	11/04/2022	98.515	0,01
PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO						0,59

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente en EUR	% del patrimonio
EUR	19.976.829	USD	23.705.224	15/12/2021	(847.230)	(0,07)
NZD	1.055.990	USD	749.535	15/12/2021	(24.141)	(0,00)
SEK	7.664.401	USD	891.670	15/12/2021	(36.192)	(0,00)
THB	25.384.393	USD	760.035	15/12/2021	(5.913)	(0,00)
GBP	1.262.000	EUR	1.497.688	21/01/2022	(17.412)	(0,00)
EUR	94.480.354	CNH	703.840.846	28/01/2022	(2.032.850)	(0,17)
USD	13.780.858	EUR	12.246.369	10/02/2022	(162.575)	(0,01)
EUR	124.546.061	JPY	16.031.469.373	16/02/2022	(422.775)	(0,04)
EUR	59.243.787	JPY	7.677.442.000	25/02/2022	(597.066)	(0,05)
EUR	115.496.571	JPY	14.975.752.000	11/04/2022	(1.173.018)	(0,10)
MINUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO						(0,44)

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en EUR	% del patrimonio
EUR	38.427.372	GBP	32.379.025	21/01/2022	448.070	0,04
CHF	19.171.620	EUR	18.001.406	25/01/2022	396.221	0,03
PLUSVALÍA LATENT	TE SOBRE CONTRATOS DE	DIVISAS A PLAZ	O CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA		844.291	0,07
Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente en EUR	% del patrimonio
GBP	126.970.209	EUR	150.238.520	21/01/2022	(1.307.535)	(0,11)
EUR	2.114.535	CHF	2.235.916	25/01/2022	(31.113)	(0,00)
NOK	928.545.360	EUR	95.028.925	25/01/2022	(5.045.299)	(0,42)
USD	684.673.278	EUR	607.298.160	10/02/2022	(6.939.975)	(0,57)

#### Opciones - (0,23 %)

ncias	Descripción del valor			Plusvalía/ (minusvalía) latente EUR	Valor de mercado en EUR	% d
						patimon
	Opciones adquiridas GBP					
37.120.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,28	(49.303)	10.499	0,
48.520.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,30	(65.062)	14.572	0,
45.040.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,42	(62.236)	20.941	0,
41.140.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,46	(55.176)	21.640	0,
47.600.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 11/10/2022	Precio de ejercicio 0,92	(12.280)	99.938	0
37.540.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 13/10/2022	Precio de ejercicio 0,93	(10.676)	80.857	0
44.950.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 15/11/2022	Precio de ejercicio 0,52	(59.227)	30.119	0
40.920.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,54	(51.910)	29.960	0
				(365.870)	308.526	0
	JPY	,				
804.940.000	Put Swaption del LIBOR a 6 meses	Vence 26/05/2022	Precio de ejercicio 0,43	(67.346)	47.443	0,
	USD					
39.900.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 0,63	(85.586)	7.613	0
39.890.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 07/01/2022	Precio de ejercicio 0,61	(87.052)	10.871	0
40.980.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/02/2022	Precio de ejercicio 0,47	(37.668)	7.016	0
39.900.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/03/2022	Precio de ejercicio 0,86	(79.914)	74.894	C
23.790.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 21/06/2022	Precio de ejercicio 1,05	(75.865)	102.346	C
21.500.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 14/11/2022	Precio de ejercicio 0,70	(140.427)	43.716	(
				(506.512)	246.456	C
	NES ADQUIRIDAS					
AL DE OPCIO te EUR 1.542.	153)				602.425	0
	153) Opciones suscritas				602.425	0
te EUR 1.542.	153) Opciones suscritas EUR	Venne 12/42/2024	Provio de ciercicio 0 20	(22 550)		
(6.980.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 0,20	(22.550)	(68.548)	(0
(6.980.000) (6.980.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 0,19	(25.864)	(68.548) (69.873)	(0,
(6.980.000) (6.980.000) (6.980.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23	(25.864) (50.143)	(68.548) (69.873) (96.909)	(0, (0,
(6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021 Vence 06/01/2022	Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,18	(25.864) (50.143) (19.785)	(68.548) (69.873) (96.909) (72.571)	(0 (0 (0 (0
(6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (5.090.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021 Vence 06/01/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13	(25.864) (50.143) (19.785) (14.491)	(68.548) (69.873) (96.909) (72.571) (81.849)	(0 (0 (0 (0
(6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (5.090.000) (5.090.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021 Vence 06/01/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13	(25.864) (50.143) (19.785) (14.491) (20.701)	(68.548) (69.873) (96.909) (72.571) (81.849) (81.849)	(0 (0 (0 (0 (0
(6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (5.090.000) (5.090.000) (6.290.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021 Vence 06/01/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13	(25.864) (50.143) (19.785) (14.491) (20.701) (14.300)	(68.548) (69.873) (96.909) (72.571) (81.849) (81.849) (101.145)	(0 (0 (0 (0 (0 (0
(6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (5.090.000) (5.090.000) (6.290.000) (4.720.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021 Vence 06/01/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13	(25.864) (50.143) (19.785) (14.491) (20.701) (14.300) (6.672)	(68.548) (69.873) (96.909) (72.571) (81.849) (81.849) (101.145) (75.899)	(0 (0 (0 (0 (0 (0
(6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (5.090.000) (5.090.000) (6.290.000) (4.720.000) (4.730.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021 Vence 06/01/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13	(25.864) (50.143) (19.785) (14.491) (20.701) (14.300) (6.672) 93	(68.548) (69.873) (96.909) (72.571) (81.849) (81.849) (101.145) (75.899) (76.060)	(0 (0 (0 (0 (0 (0 (0
(6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (5.090.000) (5.090.000) (6.290.000) (4.720.000) (4.730.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021 Vence 06/01/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,13	(25.864) (50.143) (19.785) (14.491) (20.701) (14.300) (6.672) 93 (6.686)	(68.548) (69.873) (96.909) (72.571) (81.849) (81.849) (101.145) (75.899) (76.060) (76.060)	(0 (0 (0 (0 (0 (0 (0
(6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (5.090.000) (5.090.000) (4.720.000) (4.730.000) (4.730.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021 Vence 06/01/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13	(25.864) (50.143) (19.785) (14.491) (20.701) (14.300) (6.672) 93 (6.686) (6.686)	(68.548) (69.873) (96.909) (72.571) (81.849) (81.849) (101.145) (75.899) (76.060) (76.060)	(0 (0 (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0)
(6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (5.090.000) (5.090.000) (4.720.000) (4.730.000) (4.730.000) (5.090.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021 Vence 06/01/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13	(25.864) (50.143) (19.785) (14.491) (20.701) (14.300) (6.672) 93 (6.686) (6.686) (26.867)	(68.548) (69.873) (96.909) (72.571) (81.849) (81.849) (101.145) (75.899) (76.060) (76.060) (99.620)	(0 (0 (0 (0 (0 (0 (0 (0 (0 (0
(6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (5.090.000) (5.090.000) (4.720.000) (4.730.000) (4.730.000) (4.730.000) (5.090.000) (4.200.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021 Vence 06/01/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,12 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22	(25.864) (50.143) (19.785) (14.491) (20.701) (14.300) (6.672) 93 (6.686) (6.686) (26.867) (21.525)	(68.548) (69.873) (96.909) (72.571) (81.849) (81.849) (101.145) (75.899) (76.060) (76.060) (76.060) (99.620) (82.201)	(0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0)
(6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (5.090.000) (5.090.000) (4.720.000) (4.730.000) (4.730.000) (5.090.000) (4.200.000) (6.980.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021 Vence 06/01/2022 Vence 01/11/2022 Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22	(25.864) (50.143) (19.785) (14.491) (20.701) (14.300) (6.672) 93 (6.686) (6.686) (6.686) (26.867) (21.525) 31.203	(68.548) (69.873) (96.909) (72.571) (81.849) (81.849) (101.145) (75.899) (76.060) (76.060) (99.620) (82.201) (14.795)	(0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0)
(6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (5.090.000) (5.090.000) (4.720.000) (4.730.000) (4.730.000) (4.730.000) (4.200.000) (6.980.000) (6.980.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021 Vence 06/01/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,18	(25.864) (50.143) (19.785) (14.491) (20.701) (14.300) (6.672) 93 (6.686) (6.686) (26.867) (21.525) 31.203 9.458	(68.548) (69.873) (96.909) (72.571) (81.849) (81.849) (101.145) (75.899) (76.060) (76.060) (76.060) (99.620) (82.201) (14.795) (43.328)	(0 (0 (0 (0 (0 (0 (0 (0 (0 (0 (0 (0 (0 (
(6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (5.090.000) (6.290.000) (4.720.000) (4.730.000) (4.730.000) (4.200.000) (4.200.000) (6.980.000) (6.980.000) (14.180.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021 Vence 06/01/2022 Vence 01/11/2022 Vence 13/12/2021 Vence 06/01/2022 Vence 26/05/2022	Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,118 Precio de ejercicio 0,111	(25.864) (50.143) (19.785) (14.491) (20.701) (14.300) (6.672) 93 (6.686) (6.686) (26.867) (21.525) 31.203 9.458 (4.730)	(68.548) (69.873) (96.909) (72.571) (81.849) (81.849) (101.145) (75.899) (76.060) (76.060) (99.620) (82.201) (14.795) (43.328) (123.275)	(0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0)
(6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (5.090.000) (5.090.000) (4.720.000) (4.730.000) (4.730.000) (5.090.000) (4.200.000) (6.980.000) (6.980.000) (14.180.000) (5.090.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021 Vence 06/01/2022 Vence 01/11/2022 Vence 06/01/2022 Vence 13/12/2021 Vence 06/05/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11	(25.864) (50.143) (19.785) (14.491) (20.701) (14.300) (6.672) 93 (6.686) (6.686) (26.867) (21.525) 31.203 9.458 (4.730) 14.094	(68.548) (69.873) (96.909) (72.571) (81.849) (81.849) (101.145) (75.899) (76.060) (76.060) (99.620) (82.201) (14.795) (43.328) (123.275) (43.525)	(0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0)
(6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (5.090.000) (5.090.000) (4.720.000) (4.730.000) (4.730.000) (4.200.000) (6.980.000) (6.980.000) (14.180.000) (5.090.000) (5.090.000) (5.090.000) (5.090.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021 Vence 06/01/2022 Vence 01/11/2022 Vence 13/12/2021 Vence 6/01/2022 Vence 6/05/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13	(25.864) (50.143) (19.785) (14.491) (20.701) (14.300) (6.672) 93 (6.686) (6.686) (26.867) (21.525) 31.203 9.458 (4.730) 14.094	(68.548) (69.873) (96.909) (72.571) (81.849) (81.849) (101.145) (75.899) (76.060) (76.060) (76.060) (99.620) (82.201) (14.795) (43.328) (123.275) (43.525) (43.525)	(0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0)
(6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (5.090.000) (5.090.000) (4.730.000) (4.730.000) (4.730.000) (4.730.000) (4.200.000) (6.980.000) (6.980.000) (5.090.000) (5.090.000) (5.090.000) (5.090.000) (5.090.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021 Vence 06/01/2022 Vence 01/11/2022 Vence 06/01/2022 Vence 26/05/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,13	(25.864) (50.143) (19.785) (14.491) (20.701) (14.300) (6.672) 93 (6.686) (6.686) (26.867) (21.525) 31.203 9.458 (4.730) 14.094 17.487 11.805	(68.548) (69.873) (96.909) (72.571) (81.849) (81.849) (101.145) (75.899) (76.060) (76.060) (76.060) (99.620) (82.201) (14.795) (43.328) (123.275) (43.525) (43.525) (53.786)	(0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0)
(6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (5.090.000) (5.090.000) (4.720.000) (4.730.000) (4.730.000) (4.730.000) (4.200.000) (6.980.000) (14.180.000) (5.090.000) (5.090.000) (5.090.000) (6.290.000) (6.290.000) (4.720.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021 Vence 06/01/2022 Vence 01/11/2022 Vence 06/01/2022 Vence 26/05/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,13	(25.864) (50.143) (19.785) (14.491) (20.701) (14.300) (6.672) 93 (6.686) (6.686) (26.867) (21.525) 31.203 9.458 (4.730) 14.094 17.487 11.805 (2.287)	(68.548) (69.873) (96.909) (72.571) (81.849) (81.849) (701.145) (75.899) (76.060) (76.060) (99.620) (82.201) (14.795) (43.328) (123.275) (43.525) (43.525) (43.525) (53.786) (40.361)	(0 (0 (0 (0 (0 (0 (0 (0 (0 (0 (0 (0 (0 (
(6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (5.090.000) (5.090.000) (4.720.000) (4.730.000) (4.730.000) (4.200.000) (5.090.000) (4.200.000) (6.980.000) (14.180.000) (5.090.000) (5.090.000) (5.090.000) (6.290.000) (6.290.000) (4.730.000) (4.730.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021 Vence 06/01/2022 Vence 01/11/2022 Vence 06/01/2022 Vence 26/05/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,13	(25.864) (50.143) (19.785) (14.491) (20.701) (14.300) (6.672) 93 (6.686) (6.686) (26.867) (21.525) 31.203 9.458 (4.730) 14.094 17.487 11.805 (2.287) (2.134)	(68.548) (69.873) (96.909) (72.571) (81.849) (81.849) (101.145) (75.899) (76.060) (76.060) (99.620) (82.201) (14.795) (43.328) (123.275) (43.525) (43.525) (53.786) (40.361) (40.447)	(0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0)
(6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (6.980.000) (5.090.000) (5.090.000) (4.720.000) (4.730.000) (4.730.000) (4.730.000) (4.200.000) (6.980.000) (14.180.000) (5.090.000) (5.090.000) (5.090.000) (6.290.000) (6.290.000) (4.720.000)	Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021 Vence 29/12/2021 Vence 06/01/2022 Vence 01/11/2022 Vence 06/01/2022 Vence 26/05/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,13	(25.864) (50.143) (19.785) (14.491) (20.701) (14.300) (6.672) 93 (6.686) (6.686) (26.867) (21.525) 31.203 9.458 (4.730) 14.094 17.487 11.805 (2.287)	(68.548) (69.873) (96.909) (72.571) (81.849) (81.849) (701.145) (75.899) (76.060) (76.060) (99.620) (82.201) (14.795) (43.328) (123.275) (43.525) (43.525) (43.525) (53.786) (40.361)	(0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0) (0)

Opciones - (co	ntinuación)
----------------	-------------

117.200.000

2.540.000

16.425.172

17.220.000

14.240.000 2.780.000 Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)

Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)

Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)

Fijo 0,000 % Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)

Fijo 0,000 %

Tenencias	Descripción del valor			(minusvalia) latente EUR	mercado en EUR	% dei patrimonio
	Opciones suscritas – (continuación)					
	EUR – (continuación)					
(5.090.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	32.071	(37.289)	(0,00)
(4.200.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	29.907	(30.769)	(0,00)
(6.980.000)	Put Swaption del LIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 0,19	16.387	(27.622)	(0,00)
(6.980.000)	Put Swaption del LIBOR a 6 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 0,23	21.297	(25.468)	(0,00)
				(66.833)	(1.663.728)	(0,14)
(0.000.000)	GBP	V 00/00/0000	Di- dii-i- 0.00	44.000	(45.400)	(0.00
(3.830.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,36	14.329	(45.460)	(0,00)
(5.010.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,40 Precio de ejercicio 0,38	14.312	(65.370)	(0,01)
(4.640.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022 Vence 10/10/2022	•	19.682	(63.448)	(0,00
(4.210.000) (5.010.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 11/10/2022	Precio de ejercicio 0,42 Precio de ejercicio 1,04	12.857 (134.996)	(63.984)	(0,01 (0,02
	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 13/10/2022	Precio de ejercicio 1,04 Precio de ejercicio 0,99		(247.322)	
(3.940.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 15/11/2022	Precio de ejercicio 0,55	(88.114) (12.432)	(179.462)	(0,01) (0,01)
` ,	•	Vence 16/11/2022			(101.706)	
(4.230.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Verice 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,60	(20.031)	(101.947)	(0,01
				(194.393)	(868.699)	(0,07)
(8.170.000)	USD Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 06/12/2021	Precio de ejercicio 1,58	(12.649)	(66.174)	(0,01)
(8.170.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,64	(45.585)	(107.276)	(0,01
(8.170.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 1,67	(71.969)	(134.031)	(0,01)
(12.960.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 1,30	70.467	(22.740)	(0,00
(8.170.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 1,60	(32.647)	(100.116)	(0,00)
(12.940.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 07/01/2022	Precio de ejercicio 1,12	86.351	(11.447)	(0,00)
(12.940.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/02/2022	Precio de ejercicio 0,85	35.706	(8.976)	(0,00
(12.960.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/03/2022	Precio de ejercicio 1,41	26.589	(128.234)	(0,01
(12.540.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 21/06/2022	Precio de ejercicio 1,38	25.390	(152.895)	(0,01)
(4.200.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 14/11/2022	Precio de ejercicio 1,06	98.575	(86.030)	(0,01)
(8.170.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 06/12/2021	Precio de ejercicio 1,58	42.304	(11.221)	(0,00)
(8.170.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,64	46.006	(15.685)	(0,00)
(8.170.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 1,67	38.931	(23.131)	(0,00)
(8.170.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 1,60	24.107	(43.363)	(0,00)
				331.576	(911.319)	(0,07)
TOTAL DE OPCIO (coste EUR (3.514					(3.443.746)	(0,28)
TOTAL DE OPCIO					(2.844.224)	(0.22)
(coste EUR (1.971					(2.841.321)	(0,23)
Contratos de per Importe	rmutas financieras – (0,08 %)				Plusvalía	
teórico					latente en	% de
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	EUR	patrimonic
	Permutas de tipos de interés					
750.000	Fijo 0,920 %	Variable (BBSW a 6 meses en	AUD) AUD	04/09/2028	21.247	0,00
19.340.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 2,000 %	AUD	17/03/2032	80.794	0,0
32.490.000	Fijo 5,800 %	Variable (BRCDI a 1 mes en Bl	RL) BRL	02/01/2023	219.515	0,02
12.440.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,400 %	BRL	02/01/2023	16.261	0,00
27.130.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,300 %	BRL	02/01/2024	41.887	0,00
28.638.240	Fijo 6,320 %	Variable (BRCDI a 1 mes en Bl	,	02/01/2025	429.258	0,04
26.460.000	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 11,230 %	BRL	04/01/2027	26.482	0,00
32.340.000	Fijo 1,750 %	Variable (CDOR a 3 meses en		15/12/2026	39.106	0,00
21.750.000	Fijo 1,680 %	Variable (CDOR a 3 meses en	•	22/08/2028	259.576	0,02
16.960.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,500 %	CAD	14/10/2031	114.044	0,0
22.810.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,250 %	CAD	15/12/2051	309.601	0,0
2.300.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,180 %	CAD	22/08/2052	1.215	0,0
3.480.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF) Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,000 %	CHF	16/03/2027	13.294	0,0
25.910.000	,	Fijo 0,000 %	CHF	16/03/2032	239.297	0,02
8.920.000 59.750.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF) Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 0,500 % Fijo 2,500 %	CHF	17/03/2032 15/09/2023	53.676	0,0
	,		CNY	15/12/2026	14.769	0,00
13.130.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,500 %	CNY	15/12/2026	14.156	0,00

03/11/2023

15/12/2024

15/12/2026

03/11/2027

15/12/2028

15/12/2030

130.925

61.890

47.565

125.040

37.734

0,01

0,00

0,01

0,00

0,01

0,00

EUR

EUR

EUR

EUR

EUR

EUR

(minusvalía) latente

mercado en

% del

Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)

Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)

Fijo 0,000 %

Fijo 0,000 %

Fijo 0,200 %

Fijo 0,000 %

4.700.000 10.270.000	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	latente en EUR	% de patrimonio
	Doministra de Mario de Interés - Constitució					Padimoni
	Permutas de tipos de interés – (continua	ación)				
10.270.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,500 %	EUR	26/11/2031	33.523	0,0
	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2031	34.279	0,0
11.400.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,500 %	EUR	17/03/2032	52.379	0,0
980.000	Fijo 0,250 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2036	6.655	0,0
750.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,500 %	EUR	15/12/2041	25.661	0,0
1.450.000	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	Fijo 0,750 %	GBP	15/12/2051	39.744	0,0
26.110.170.000	Fijo 1,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en KRW)	KRW	16/03/2024	63.122	0,0
157.520.000	Fijo 6,200 %	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	13/12/2023	104.093	0,0
6.670.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,565 %	MYR	14/03/2024	33.873	0,0
1.300.000	Fijo 1,700 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2026	15.230	0,0 0,0
296.230.000 154.600.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,500 % Fijo 0,750 %	SEK SEK	16/03/2024 15/12/2031	64.732 60.686	0,0
45.420.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 1,000 %	SEK	17/03/2032	3.050	0,0
30.600.000	Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD	25/07/2024	878	0,0
16.510.000	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	Fijo 1,530 %	USD	22/09/2031	14.328	0,0
34.550.000	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	Fijo 1,750 %	USD	15/12/2031	160.215	0,0
28.375.000	Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	Fijo 7,400 %	ZAR	15/12/2031	28.889	0,0
DI LISVALÍA I ATEN	NTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INT	<u>-</u> .			3.049.072	0,2
EUOVALIA LATEN					3.043.072	
320.000	Permutas de incumplimiento crediticio ( Variable (Bonos internacionales del Estado de Indonesia)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2024	3.581	0,00
740.000	Variable (Bonos internacionales del Estado saudí)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2024	9.848	0,0
150.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Indonesia)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	1.834	0,00
18.775.000	Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 34 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2025	162.444	0,02
3.930.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Indonesia)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	2.692	0,0
3.920.000	Variable (Bonos internacionales del Estado saudí)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	35.947	0,00
125.950.000 460.000	Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 36 Version 1 Index) Variable (iTraxx Asia ex-Japan IG	Fijo 1,000 %  Fijo 1,000 %	USD	20/06/2026 20/12/2026	162.265 22	0,0
2.480.000	Series 36 Version 1) Variable (Bonos internacionales del	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	2.069	0,00
2.950.000	Estado saudí) Variable (The Markit CMBX North	Fijo 3,000 %	USD	18/11/2054	393.140	0,03
550.000	America BBB- 11 Index) Variable (The Markit CMBX North	Fijo 3,000 %	USD	18/11/2054	42.742	0,0
1.400.000	America BBB- 11 Index) Variable (The Markit CMBX North	Fijo 3,000 %	USD	18/11/2054	63.166	0,0
1.550.000	America BBB- 11 Index) Variable (The Markit CMBX North	Fijo 3,000 %	USD	17/10/2057	157.934	0,0
650.000	America BBB- 8 Index) Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/10/2057	22.174	0,0
1.000.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/10/2057	8.569	0,0
1.000.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/10/2057	4.857	0,00
1.500.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 10 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/11/2059	153.166	0,0
2.800.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 10 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/11/2059	124.414	0,0
LUSVALÍA LATEN	NTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMIE	NTO CREDITICIO (CDS)			1.350.864	0,1
	Permutas de inflación	V . I . (I DOD . 45	E1:-			
4.350.000 5.930.000	Fijo 2,250 % Fijo 3,250 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (LIBOR a 12 meses en USD)	EUR USD	15/10/2023 07/10/2022	2.048 60.420	0,0 0,0
PLUSVALÍA LATEN	NTE SOBRE PERMUTAS DE INFLACIÓN				62.468	0,0
TOTAL DE PLUSVA	ALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE P	ERMUTAS FINANCIERAS			4.462.404	0,3
Importe teórico	A	Aussibia	Dist	Parke de la	Minusvalía latente	% de
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	en EUR	patrimonio
161.510.000	Permutas de tipos de interés Variable (BBSW a 3 meses en AUD)	Fijo 0,190 %	AUD	22/02/2023	(234.511)	(0,02)

rte co neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente en EUR	% patrime
	Permutas de tipos de interés – (continuación)					
111.960.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 1,250 %	AUD	15/12/2026	(1.084.278)	(0
25.170.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 2,000 %	AUD	15/12/2020	(281.057)	(0
14.000.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 10,565 %	BRL	02/01/2023	(18.012)	(0
40.240.000	•	· ·	BRL	02/01/2023	. ,	((
2.675.000	Variable (LIBOR a 1 mes en BRL) Fijo 11,814 %	Fijo 7,200 % Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(239.394) (1.762)	(1
2.675.000	•	,	BRL	02/01/2024	(1.981)	(
	Fijo 11,905 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL		, ,	
9.925.000 24.676.946	Variable (SETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 4,930 %	BRL	02/01/2024 02/01/2024	(138.750) (49.296)	(
30.650.000	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 9,200 %	CAD	22/08/2025	, ,	(
	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 1,560 %			(233.488)	
25.200.000	Fijo 2,000 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2031	(263.845)	(
10.493.884	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2023	(16.976)	(
27.280.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	03/11/2027	(152.396)	(
2.400.000	Fijo 0,750 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	26/11/2041	(33.210)	
4.760.000	Fijo 0,250 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2051	(85.729)	(
38.420.000	Fijo 0,500 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2026	(101.332)	(
1.980.000	Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)	Fijo 4,060 %	GBP	15/12/2028	(177.328)	
28.200.000	Fijo 0,750 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2031	(143.777)	
26.860.000	Fijo 1,000 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	17/03/2032	(207.926)	
393.090.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)	JPY	15/12/2031	(30.356)	
661.830.000	Fijo 1,750 %	Variable (KWCDC a 3 meses en KRW)	KRW	15/09/2031	(68.005)	
40.880.000	Fijo 7,150 %	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	03/12/2031	(34.937)	
18.800.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,000 %	MYR	16/06/2026	(118.782)	
131.450.000	Fijo 2,000 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	16/03/2027	(142.622)	
135.630.000	Fijo 2,130 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	11/05/2031	(148.320)	
16.670.000	Fijo 2,000 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	16/03/2032	(30.200)	
19.750.000	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 1,250 %	NZD	15/12/2022	(22.161)	
6.360.000	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 3,000 %	NZD	16/09/2031	(895)	
13.640.000	Fijo 2,000 %	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	NZD	15/12/2031	(29.996)	
49.300.000	Fijo 0,250 %	Variable (WIBOR a 3 meses en PLN)	PLN	16/12/2021	(19.888)	
697.849	Fijo 1,750 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2023	(506)	Ċ
10.475.000	Fijo 2,000 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2031	(8.597)	
119.950.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,250 %	SEK	15/12/2026	(21.759)	
37.470.000	Variable (LIBOR a 6 meses en THB)	Fijo 1,000 %	THB	16/03/2027	(3.445)	
20.780.000	Fijo 0,250 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2024	(77.865)	
30.300.000	Fijo 1,000 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2027	(96.358)	
9.090.000	Fijo 2,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD	17/09/2031	(28.971)	
19.800.000	•	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	22/09/2036	. ,	
	Fijo 1,630 %				(24.065)	
10.390.000	Fijo 1,750 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2052	(162.232)	
249.934.260	Fijo 5,500 % ENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INT	Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	ZAR	15/12/2023	(41.033) (4.576.041)	
SVALIA LATE	Permutas de incumplimiento crediticio (C				(4.576.041)	(
800.000	Variable (Unibail-Rodamco-Westfield S.E.)	•	EUR	20/06/2024	(4.027)	
	,	Fijo 1,000 %		20/06/2024	(4.027)	(
32.325.000	Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 28 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2022	(13.448)	(
1.000.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Chile)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	(2.342)	
3.240.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Chile)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	(31.032)	(
1.170.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Colombia)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	(42.742)	(
4.620.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de México)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	(17.898)	(
840.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Perú)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	(5.345)	,
4.590.000	Variable (Bonos extranjeros rusos – Eurobono)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	(34.473)	•
2.780.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Indonesia)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(15.081)	(
2.620.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de México)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(25.535)	•
840.000	Variable (Bonos extranjeros rusos – Eurobono)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(10.480)	

#### Contratos de permutas financieras - (continuación)

Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente en EUR	% del patrimonio
	Permutas de inflación					
5.230.000	Fijo 1,920 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/11/2031	(35.407)	(0,00)
9.350.000	Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)	Fijo 4,170 %	GBP	15/11/2028	(631.169)	(0,05)
MINUSVALÍA LAT	ENTE SOBRE PERMUTAS DE INFLACIÓN				(666.576)	(0,05)
TOTAL DE MINUS	VALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE	PERMUTAS FINANCIERAS			(5.445.020)	(0,45)
VALOR DE MERC. (coste EUR 1.168.	ADO DE LAS INVERSIONES 277.481)			1.	197.726.570	98,21
OTROS ACTIVOS	Y PASIVOS				21.830.363	1,79
PATRIMONIO 1.219.556.933					100,00	
TOTAL DE INVER	SIONES		-		Valor de mercado en EUR	
	SIONES xcluyendo derivados (coste EUR 1.180.232.	519)		1.	mercado en	% del patrimonio
Total inversiones ex		•			mercado en EUR	patrimonio
Total inversiones e	xcluyendo derivados (coste EUR 1.180.232.	•			mercado en EUR 217.436.053	patrimonio 99,83
Total inversiones e. Valor de mercado o Plusvalía latente so	ccluyendo derivados (coste EUR 1.180.232.4 le títulos con garantía hipotecaria a plazo cu	•			mercado en EUR 217.436.053 (10.140.833)	99,83 (0,83)
Total inversiones e. Valor de mercado o Plusvalía latente so Minusvalía latente	xcluyendo derivados (coste EUR 1.180.232.0 le títulos con garantía hipotecaria a plazo cu obre contratos de futuros	•			mercado en EUR 217.436.053 (10.140.833) 6.055.189	99,83 (0,83) 0,49
Total inversiones e: Valor de mercado o Plusvalía latente so Minusvalía latente Plusvalía latente so Minusvalía latente	xcluyendo derivados (coste EUR 1.180.232.: le títulos con garantía hipotecaria a plazo cu obre contratos de futuros sobre contratos de futuros obre contratos de divisas a plazo sobre contratos de divisas a plazo	biertos (coste EUR (9.983.095))			mercado en EUR 217.436.053 (10.140.833) 6.055.189 (1.130.930)	99,83 (0,83) 0,49 (0,09)
Total inversiones e: Valor de mercado o Plusvalía latente so Minusvalía latente Plusvalía latente so Minusvalía latente Plusvalía latente so	ccluyendo derivados (coste EUR 1.180.232.3 de títulos con garantía hipotecaria a plazo cu obre contratos de futuros sobre contratos de futuros obre contratos de divisas a plazo sobre contratos de divisas a plazo obre contratos de divisas a plazo obre contratos de divisas a plazo obre contratos de divisas a plazo celebrados	biertos (coste EUR (9.983.095)) con fines de cobertura			217.436.053 (10.140.833) 6.055.189 (1.130.930) 7.129.831	99,83 (0,83) 0,49 (0,09) 0,59
Total inversiones e: Valor de mercado o Plusvalía latente so Minusvalía latente Plusvalía latente so Minusvalía latente Plusvalía latente so	xcluyendo derivados (coste EUR 1.180.232.: le títulos con garantía hipotecaria a plazo cu obre contratos de futuros sobre contratos de futuros obre contratos de divisas a plazo sobre contratos de divisas a plazo	biertos (coste EUR (9.983.095)) con fines de cobertura			217.436.053 (10.140.833) 6.055.189 (1.130.930) 7.129.831 (5.319.172)	99,83 (0,83) 0,49 (0,09) 0,59 (0,44)
Total inversiones e: Valor de mercado o Plusvalía latente so Minusvalía latente Plusvalía latente Plusvalía latente Plusvalía latente So Minusvalía latente Valor de mercado o	xcluyendo derivados (coste EUR 1.180.232.3 le títulos con garantía hipotecaria a plazo cu obre contratos de futuros sobre contratos de futuros obre contratos de divisas a plazo sobre contratos de divisas a plazo obre contratos de divisas a plazo obre contratos de divisas a plazo celebrados sobre contratos de divisas a plazo celebrados le opciones compradas (coste EUR 1.542.18 le opciones coste EUR 1.542.18 le opciones compradas (coste EUR 1.542.1	biertos (coste EUR (9.983.095))  con fines de cobertura s con fines de cobertura 53)			mercado en EUR 217.436.053 (10.140.833) 6.055.189 (1.130.930) 7.129.831 (5.319.172) 844.291 (13.323.922) 602.425	99,83 (0,83) 0,49 (0,09) 0,59 (0,44) 0,07 (1,10)
Total inversiones e: Valor de mercado o Plusvalía latente so Minusvalía latente Plusvalía latente so Minusvalía latente Plusvalía latente Valor de mercado o Valor de mercado o	xcluyendo derivados (coste EUR 1.180.232.3 le títulos con garantía hipotecaria a plazo cubre contratos de futuros sobre contratos de futuros obre contratos de divisas a plazo sobre contratos de divisas a plazo sobre contratos de divisas a plazo sobre contratos de divisas a plazo celebrados sobre contratos de divisas a plazo celebrados le opciones compradas (coste EUR 1.542.18 le opciones suscritas (coste EUR (3.514.096)	biertos (coste EUR (9.983.095))  con fines de cobertura s con fines de cobertura 53)			mercado en EUR 217.436.053 (10.140.833) (10.140.833) (1.130.930) 7.129.831 (5.319.172) 844.291 (13.323.922) 602.425 (3.443.746)	99,83 (0,83) 0,49 (0,09) 0,59 (0,44) 0,07 (1,10) 0,05 (0,28)
Total inversiones e: Valor de mercado o Plusvalía latente so Minusvalía latente Plusvalía latente so Minusvalía latente Plusvalía latente Valor de mercado o Valor de mercado o	xcluyendo derivados (coste EUR 1.180.232.3 le títulos con garantía hipotecaria a plazo cu obre contratos de futuros sobre contratos de futuros obre contratos de divisas a plazo sobre contratos de divisas a plazo obre contratos de divisas a plazo obre contratos de divisas a plazo celebrados sobre contratos de divisas a plazo celebrados le opciones compradas (coste EUR 1.542.18 le opciones coste EUR 1.542.18 le opciones compradas (coste EUR 1.542.1	biertos (coste EUR (9.983.095))  con fines de cobertura s con fines de cobertura 53)			mercado en EUR 217.436.053 (10.140.833) 6.055.189 (1.130.930) 7.129.831 (5.319.172) 844.291 (13.323.922) 602.425	99,83 (0,83) 0,49 (0,09) 0,59 (0,44) 0,07 (1,10) 0,05 (0,28)
Total inversiones e: Valor de mercado o Plusvalía latente so Minusvalía latente Plusvalía latente so Minusvalía latente Plusvalía latente so Valor de mercado o Plusvalía latente so Plusvalía latente so	xcluyendo derivados (coste EUR 1.180.232.3 le títulos con garantía hipotecaria a plazo cubre contratos de futuros sobre contratos de futuros obre contratos de divisas a plazo sobre contratos de divisas a plazo sobre contratos de divisas a plazo sobre contratos de divisas a plazo celebrados sobre contratos de divisas a plazo celebrados le opciones compradas (coste EUR 1.542.18 le opciones suscritas (coste EUR (3.514.096)	biertos (coste EUR (9.983.095))  con fines de cobertura s con fines de cobertura 53)			mercado en EUR 217.436.053 (10.140.833) (10.140.833) (1.130.930) 7.129.831 (5.319.172) 844.291 (13.323.922) 602.425 (3.443.746)	99,83 (0,83) 0,49 (0,09) 0,59 (0,44) 0,07 (1,10) 0,05 (0,28)

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

Patrimonio

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Deutsche Bank AG, JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Natwest Markets Plc., Standard Chartered Bank y State Street Bank & Trust.

Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc. y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de permutas fueron Credit Suisse, JP Morgan Chase Bank N.A., Merrill Lynch International y Morgan Stanley & Co. International Plc.

 $La\ exposición\ m\'{a}xima\ a\ cada\ contraparte\ a\ 30\ de\ noviembre\ de\ 2021,\ medida\ como\ porcentaje\ del\ VL,\ es\ del\ 0,50\ \%.$ 

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- <sup>(c)</sup> Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (d) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (e) Los valores TBA (por confirmar) se compran sobre una vez suscrito un compromiso a plazo con un importe de principal aproximado (por lo general +/–2,5 %) y sin fecha definitiva de vencimiento. El importe real del principal y la fecha de vencimiento se determinarán tras la liquidación cuando se asignen los "pools" de hipotecas específicos.
- (f) Estos valores representan ventas por confirmar (TBA) cubiertas con posiciones FNMA largas. Estos importes se declaran por separado en el Balance de situación como Valores hipotecarios a plazo cubiertos.
- (g) Estos valores representan ventas por confirmar (TBA) cubiertas con posiciones GNMA largas. Estos importes se declaran por separado en el Balance de situación como Valores hipotecarios a plazo cubiertos.

1.219.556.933

100,00

Tenencias	Posociosión del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de
	Descripción del valor	Divisa	Interes	recha de vencimiento	en OSD	patrimonic
valores mo Bonos – 32 Argentina	obiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial 2,80 %					
-	94 Bonos internacionales del Estado de Argentina	USD	1,000 %	09/07/2029	241.447	0,0
Bermudas						
3.884.00	00 IHS Markit Ltd.	USD	4,250 %	01/05/2029	4.417.234	0,14
488.00	00 Valaris Ltd. – Serie 1145	USD	8,250 %	30/04/2028	506.474	0,02
					4.923.708	0,16
Islas Caimár						
	00 Melco Resorts Finance Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,375 %	04/12/2029	1.875.554	0,06
	00 MGM China Holdings Ltd.	USD	5,250 %	18/06/2025	1.760.589	0,06
	00 MGM China Holdings Ltd. 144A <sup>(c)</sup> 51 Noble Finance Co.	USD USD	5,250 % 11,000 %	18/06/2025 15/02/2028	3.251.089 1.539.946	0,1 <sup>2</sup> 0,05
1.555.5	or Noble Finance Co.	03D		13/02/2020		
					8.427.178	0,28
Francia 8 432 00	00 Altice France S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,125 %	15/07/2029	8.073.640	0,27
	00 Altice France S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/10/2029	4.564.820	0,27
	00 Banijay Group SAS	EUR	6,500 %	01/03/2026	1.892.455	0,06
	00 Faurecia S.E.	EUR	2,375 %	15/06/2029	2.099.298	0,07
875.00	00 Laboratoire Eimer Selas	EUR	5,000 %	01/02/2029	1.000.488	0,03
					17.630.701	0,58
Alemania						
+ 2,800,00	00 ADLER Real Estate AG	EUR	1,875 %	27/04/2023	2.937.985	0,10
2.458.00	00 Cheplapharm Arzneimittel GmbH 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/01/2028	2.497.943	0,08
	00 Commerzbank AG <sup>(d)</sup>	USD	7,000 %	Perp.	3.420.000	0,1
	00 Deutsche Bank AG <sup>(d)</sup>	USD	3,729 %	14/01/2032	3.242.010	0,1
	00 Deutsche Bank AG <sup>(d)</sup>	USD	4,875 %	01/12/2032	6.519.149	0,2
	00 Deutsche Bank AG <sup>(d)</sup>	USD	6,000 %	Perp.	2.460.000	0,08
	00 IHO Verwaltungs GmbH 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	6,000 %	15/05/2027	1.249.500	0,04
	00 IHO Verwaltungs GmbH 144A <sup>(c)</sup> 00 Schaeffler AG	EUR	6,375 % 3,375 %	15/05/2029 12/10/2028	2.977.061 2.535.336	0,10 0,08
	00 TK Elevator Holdco GmbH 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,625 %	15/07/2028	2.671.020	0,00
	00 TUI Cruises GmbH	EUR	6,500 %	15/05/2026	1.020.784	0,03
					31.530.788	1,03
 Irlanda				-		
3.045.00	00 Motion Bondco DAC 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,625 %	15/11/2027	3.098.288	0,10
4.470.00	00 Perrigo Finance Unlimited Co.	USD	3,150 %	15/06/2030	4.397.362	0,14
2.250.00	00 Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC	GBP	4,875 %	15/07/2028	3.007.105	0,10
2.750.00	0 Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	15/07/2028	2.715.625	0,09
					13.218.380	0,43
Italia						
	00 Brunello Bidco SpA	EUR	3,500 %	15/02/2028	1.775.842	0,06
	00 Mooney Group SpA <sup>(d)</sup> 00 Telecom Italia SpA	EUR EUR	3,875 % 1,625 %	17/12/2026 18/01/2029	1.108.112 705.373	0,04 0,02
073,00	o Telecon Italia SpA	LOK	1,025 /0	10/01/2029	3.589.327	0,02
					3.369.327	U, 12
Jersey 1.250.00	00 CPUK Finance Ltd.	GBP	4,500 %	28/08/2027	1.675.482	0,05
Liberia						
1.230.00	00 Royal Caribbean Cruises Ltd.	USD	5,250 %	15/11/2022	1.259.212	0,04
Luxemburgo						
	00 Altice Financing S.A.	EUR	4,250 %	15/08/2029	6.750.820	0,22
	00 Altice Finco S.A.	EUR	4,750 %	15/01/2028	2.854.071	0,09
	00 Dana Financing Luxembourg SARL 00 Herens Holdco SARL 144A <sup>(c)</sup>	EUR	3,000 %	15/07/2029	2.102.287	0,07
	00 Intelsat Luxembourg S.A.	USD USD	4,750 % 8,125 %	15/05/2028 01/06/2023	5.620.387 191.800	0,18 0,0
	00 Intelsat S.A.	USD	4,500 %	15/06/2025	1.666.170	0,0
	00 Kleopatra Finco SARL	EUR	4,250 %	01/03/2026	4.501.810	0,0
	00 Kleopatra Holdings 2 S.C.A.	EUR	6,500 %	01/09/2026	3.732.397	0,12
	00 Lincoln Financing SARL	EUR	3,625 %	01/04/2024	4.896.335	0,16
	00 Lincoln Financing SARL <sup>(d)</sup>	EUR	3,875 %	01/04/2024	2.325.853	0,08

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
-	(continuación)					
	Telecom Italia Capital S.A. Telecom Italia Capital S.A.	USD USD	6,000 % 7,200 %	30/09/2034 18/07/2036	2.957.288 11.358.877	0,10 0,37
10.336.000	Telecom Italia Capital S.A.	USD	7,200 %	16/07/2030	48.958.095	1,60
México						
	Banco Mercantil del Norte S.A. <sup>(d)</sup>	USD	5,875 %	Perp.	2.288.922	0,07
Países Bajos	Ashland Services BV	EUR	2.000 %	30/01/2028	4.425.246	0,14
	Sigma Holdco BV 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,875 %	15/05/2026	4.514.250	0,14
	United Group BV	EUR	4,625 %	15/08/2028	2.603.971	0,08
5.836.000	Ziggo Bond Co. BV	EUR	3,375 %	28/02/2030	6.471.097	0,21
	Ziggo Bond Co. BV 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,125 %	28/02/2030	2.317.250	0,08
3.031.000	Ziggo BV 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	15/01/2030	3.061.310	0,10
					23.393.124	0,76
Noruega 1.300.000	Adevinta ASA	EUR	3,000 %	15/11/2027	1.521.984	0,05
Panamá						
	Carnival Corp.	EUR	10,125 %	01/02/2026	1.781.856	0,06
1.810.000	Grifols Escrow Issuer S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/10/2028	1.800.950	0,06
	Lorca Telecom Bondco S.A.	EUR	4,000 %	18/09/2027	4.136.919	0,13
					5.937.869	0,19
Supranacional	es					
10.574.000	Ardagh Packaging Finance Plc. Via Ardagh Holdings USA, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,250 %	15/08/2027	10.415.390	0,34
Suecia	Marinum Halding AD	EUD	0.050.0/	45/00/0007	4 400 040	0.04
	Verisure Holding AB Verisure Midholding AB	EUR EUR	3,250 % 5,250 %	15/02/2027 15/02/2029	1.189.612 986.202	0,04 0,03
000.000	Vendare Midnedality / LD	LOIK		10/02/2020	2.175.814	0,07
Suiza					2	
	Credit Suisse Group AG <sup>(d)</sup>	USD	6,250 %	Perp.	1.658.900	0,05
2.850.000	Credit Suisse Group AG 144A(c)(d)	USD	5,250 %	Perp.	2.921.250	0,10
					4.580.150	0,15
Reino Unido	- (d)			_		
	Barclays Plc. <sup>(d)</sup> BCP V Modular Services Finance II Plc.	USD EUR	8,000 % 4,750 %	Perp. 30/11/2028	8.999.500 2.848.865	0,29 0,09
	Matalan Finance Plc.	GBP	6,750 %	31/01/2023	3.482.816	0,09
745.000	Mclaren Finance Plc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,500 %	01/08/2026	760.831	0,03
	Pinewood Finance Co., Ltd.	GBP	3,250 %	30/09/2025	4.101.133	0,14
	Standard Chartered Plc. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	4,750 %	Perp.	3.617.006	0,12
	Stonegate Pub Co. Financing 2019 Plc. Virgin Media Secured Finance Plc. 144A <sup>(c)</sup>	GBP USD	8,250 % 5,500 %	31/07/2025 15/05/2029	3.466.136 3.150.675	0,11 0,10
3.013.000	Virgin Media decared Finance Fig. 14474	000		13/03/2023	30.426.962	0,99
Estados Unido	s				00.420.002	
	Ally Financial, Inc. – Serie B <sup>(d)</sup>	USD	4,700 %	Perp.	5.026.125	0,16
	American Axle & Manufacturing, Inc.	USD	6,875 %	01/07/2028	3.665.813	0,12
	American Axle & Manufacturing, Inc.	USD	5,000 %	01/10/2029	4.452.375	0,15
	AmeriGas Partners LP Via AmeriGas Finance Corp.	USD	5,750 %	20/05/2027	11.121.581	0,36
	Antero Resources Corp.	USD	5,000 %	01/03/2025	4.840.656	0,16
	Apache Corp. Asbury Automotive Group, Inc.	USD USD	4,250 % 4,500 %	15/01/2030 01/03/2028	3.550.075 3.331.803	0,12 0,11
	B&G Foods, Inc.	USD	5,250 %	01/04/2025	5.117.243	0,17
	Buckeye Partners LP	USD	3,950 %	01/12/2026	9.179.000	0,30
1.593.000	Burlington Stores, Inc.	USD	2,250 %	15/04/2025	2.350.945	0,08
	Capital One Financial Corp. – Serie M <sup>(d)</sup>	USD	3,950 %	Perp.	3.126.375	0,10
	Centene Corp.	USD	2,450 %	15/07/2028	3.105.624	0,10
	Centene Corp.	USD USD	4,625 %	15/12/2029	4.206.161	0,14
	040		3,375 %	15/02/2030	9.001.808	0,29
8.927.000	Centene Corp.					
8.927.000 5.486.000	Centene Corp.	USD	2,500 %	01/03/2031	5.260.251	0,17
8.927.000 5.486.000 1.548.000	Centene Corp. Centene Corp.	USD USD	2,500 % 2,625 %	01/03/2031 01/08/2031	5.260.251 1.494.873	0,17 0,05
8.927.000 5.486.000 1.548.000 3.401.000	Centene Corp.	USD	2,500 %	01/03/2031	5.260.251	0,17

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
•	s – (continuación)					
3.550.000	Cheniere Energy Partners LP	USD	4,500 %	01/10/2029	3.731.938	0,12
	Cheniere Energy, Inc.	USD	4,625 %	15/10/2028	4.887.350	0,16
	Citigroup, Inc. – Serie M <sup>(d)</sup>	USD	6,300 %	Perp.	8.856.506	0,29
	Citigroup, Inc. – Serie P <sup>(d)</sup>	USD	5,950 %	Perp.	2.688.192	0,09
4.025.000	Citigroup, Inc. – Serie W <sup>(d)</sup>	USD EUR	4,000 % 4,000 %	Perp. 15/04/2023	1.337.000 4.581.864	0,04 0,15
	Crowdstrike Holdings, Inc.	USD	3,000 %	15/02/2029	3.608.400	0,13
6.270.000		USD	5,375 %	15/11/2027	6.567.825	0,21
110.000	Dana, Inc.	USD	5,625 %	15/06/2028	116.463	0,00
1.925.000		USD	4,250 %	01/09/2030	1.933.422	0,06
	DCP Midstream Operating LP	USD	5,375 %	15/07/2025	6.553.750	0,21
	DCP Midstream Operating LP	USD USD	5,625 %	15/07/2027	2.044.000	0,07
	Delta Air Lines, Inc. DISH DBS Corp.	USD	7,375 % 5,000 %	15/01/2026 15/03/2023	10.615.432 8.917.187	0,35 0,29
	DISH DBS Corp.	USD	5,875 %	15/11/2024	3.043.863	0,10
	DISH DBS Corp.	USD	7,750 %	01/07/2026	2.952.008	0,10
	DISH DBS Corp.	USD	5,125 %	01/06/2029	1.988.000	0,06
3.070.000	Edison International – Serie A <sup>(d)</sup>	USD	5,375 %	Perp.	3.192.800	0,10
	EnLink Midstream LLC	USD	5,375 %	01/06/2029	3.411.188	0,11
	EnLink Midstream Partners LP	USD	4,400 %	01/04/2024	3.108.105	0,10
	EQT Corp.	USD	3,000 %	01/10/2022	2.916.506	0,10
	EQT Corp.	USD USD	6,625 % 5,000 %	01/02/2025 15/01/2029	3.893.750 4.382.437	0,13 0,14
	FirstEnergy Corp.	USD	2,650 %	01/03/2030	2.019.003	0,14
	FirstEnergy Corp. – Serie C	USD	7,375 %	15/11/2031	1.114.348	0,04
	FirstEnergy Corp. – Serie C	USD	5,350 %	15/07/2047	4.644.587	0,15
	Ford Motor Co.	USD	3,250 %	12/02/2032	3.619.719	0,12
9.258.000	Ford Motor Co.	USD	4,750 %	15/01/2043	10.037.996	0,33
	Ford Motor Credit Co., LLC	USD	4,140 %	15/02/2023	3.995.978	0,13
	Ford Motor Credit Co., LLC	USD	4,375 %	06/08/2023	4.368.291	0,14
	Ford Motor Credit Co., LLC	USD	3,810 %	09/01/2024	1.230.918	0,04
	Ford Motor Credit Co., LLC	USD USD	4,687 %	09/06/2025 13/11/2025	1.909.125 5.394.740	0,06 0,18
	Ford Motor Credit Co., LLC Ford Motor Credit Co., LLC	USD	3,375 % 2,700 %	10/08/2026	6.044.633	0,18
	Ford Motor Credit Co., LLC	USD	3,815 %	02/11/2027	8.517.939	0,28
	Ford Motor Credit Co., LLC	USD	2,900 %	16/02/2028	2.859.523	0,09
	Ford Motor Credit Co., LLC	USD	5,113 %	03/05/2029	3.232.689	0,11
4.205.000	Ford Motor Credit Co., LLC	USD	4,000 %	13/11/2030	4.389.848	0,14
	Ford Motor Credit Co., LLC	USD	3,625 %	17/06/2031	4.422.473	0,14
	Freeport-McMoRan, Inc.	USD	4,375 %	01/08/2028	4.380.480	0,14
	Freeport-McMoRan, Inc.	USD	4,625 %	01/08/2030	3.833.438	0,13
	Genesis Energy LP Via Genesis Energy Finance Corp. Genesis Energy LP Via Genesis Energy Finance Corp.	USD USD	5,625 % 8,000 %	15/06/2024 15/01/2027	5.071.515 6.857.100	0,17 0,22
	Global Partners LP Via GLP Finance Corp.	USD	7,000 %	01/08/2027	3.979.575	0,13
	Global Partners LP Via GLP Finance Corp.	USD	6,875 %	15/01/2029	5.488.875	0,18
5.540.000	Goodyear Tire & Rubber Co.	USD	9,500 %	31/05/2025	5.976.275	0,19
3.791.000	HCA, Inc.	USD	5,375 %	01/02/2025	4.136.929	0,14
9.850.000		USD	3,500 %	01/09/2030	10.244.000	0,33
	Hillenbrand, Inc.	USD	3,750 %	01/03/2031	6.325.925	0,21
	Howmet Aerospace, Inc.	USD	6,875 %	01/05/2025	65.408	0,00
	Howmet Aerospace, Inc. Icahn Enterprises LP Via Icahn Enterprises Finance Corp.	USD USD	3,000 % 4,750 %	15/01/2029 15/09/2024	4.355.312 8.856.660	0,14 0,29
	iHeartCommunications, Inc.	USD	8,375 %	01/05/2027	3.157.500	0,29
	Kennedy-Wilson, Inc.	USD	4,750 %	01/02/2030	4.927.744	0,16
	Kennedy-Wilson, Inc.	USD	5,000 %	01/03/2031	2.243.644	0,07
8.324.000	Kraft Heinz Foods Co.	USD	3,000 %	01/06/2026	8.692.362	0,28
2.607.000	Kraft Heinz Foods Co.	USD	3,875 %	15/05/2027	2.822.221	0,09
	Kraft Heinz Foods Co.	USD	4,625 %	30/01/2029	2.902.252	0,09
	Kraft Heinz Foods Co.	USD	4,250 %	01/03/2031	1.893.701	0,06
	Kraft Heinz Foods Co.	USD	4,625 %	01/10/2039	8.045.625	0,26
	Kraft Heinz Foods Co. Kraft Heinz Foods Co.	USD USD	4,375 % 4,875 %	01/06/2046 01/10/2049	5.211.040 13.338.003	0,17 0,44
	Lamar Media Corp.	USD	3,625 %	15/01/2031	2.412.500	0,44
	Laredo Petroleum, Inc.	USD	9,500 %	15/01/2025	5.970.110	0,08
	Lumen Technologies, Inc. – Serie G	USD	6,875 %	15/01/2028	3.599.663	0,12
	Lumen Technologies, Inc. – Serie W	USD	6,750 %	01/12/2023	2.612.938	0,09
	Mercer International, Inc.	USD	5,500 %	15/01/2026	3.181.922	0,10
	Mercer International, Inc.	USD	5,125 %	01/02/2029	3.420.812	0,11
	Meredith Corp.  MCM Crouth Proportion Connection Restaurable LB Via MCB Finance	USD	6,500 %	01/07/2025	2.123	0,00
4.000.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP Via MGP Finance Co-Issuer, Inc.	USD	5,625 %	01/05/2024	4.295.000	0,14

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
•	s – (continuación)					
2.937.000	MGM Resorts International	USD	7,750 %	15/03/2022	2.975.548	0,10
	MGM Resorts International	USD	6,000 %	15/03/2023	6.343.612	0,21
	MGM Resorts International	USD	5,500 %	15/04/2027	6.932.355	0,23
	MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.  MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.	GBP USD	3,692 % 4,625 %	05/06/2028 01/08/2029	1.519.644 4.648.237	0,05 0,15
	MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.	GBP	3,375 %	24/04/2030	2.755.611	0,13
	MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.	USD	3,500 %	15/03/2031	8.659.747	0,28
3.565.000	Navient Corp.	USD	5,500 %	25/01/2023	3.698.688	0,12
	Navient Corp.	USD	5,875 %	25/10/2024	5.573.727	0,18
	Navient Corp.	USD	6,750 %	15/06/2026	2.926.800	0,10
	Navient Corp. Navient Corp.	USD USD	5,000 % 4,875 %	15/03/2027 15/03/2028	5.797.155 8.988.112	0,19 0,29
	Navient Corp.	USD	5,500 %	15/03/2029	5.708.100	0,29
	Netflix, Inc.	USD	4,875 %	15/04/2028	2.911.046	0,10
	New Albertsons LP	USD	7,450 %	01/08/2029	4.457.290	0,15
1.629.000	Newell Brands, Inc.	USD	4,875 %	01/06/2025	1.761.356	0,06
2.448.000	Newell Brands, Inc.	USD	6,000 %	01/04/2046	3.047.760	0,10
	Nokia of America Corp.	USD	6,450 %	15/03/2029	8.432.792	0,28
	Nordstrom, Inc.	USD	4,375 %	01/04/2030	4.459.950	0,15
	NRG Energy, Inc.	USD USD	5,750 % 5,750 %	15/01/2028 01/10/2025	4.751.720 4.240.575	0,16 0,14
	NuStar Logistics LP NuStar Logistics LP	USD	5,625 %	28/04/2027	7.584.920	0,14
	Occidental Petroleum Corp.	USD	8,000 %	15/07/2025	13.986.175	0,25
	Occidental Petroleum Corp.	USD	5,875 %	01/09/2025	1.964.156	0,06
	Occidental Petroleum Corp.	USD	6,450 %	15/09/2036	12.096.250	0,39
21.764.000	Occidental Petroleum Corp.	USD	4,400 %	15/04/2046	21.600.770	0,70
	Occidental Petroleum Corp.	USD	4,200 %	15/03/2048	5.747.475	0,19
	Occidental Petroleum Corp.	USD	4,400 %	15/08/2049	4.723.265	0,15
	Olympus Water US Holding Corp.	EUR	3,875 %	01/10/2028	1.107.663	0,04
	OneMain Finance Corp. OneMain Finance Corp.	USD USD	5,625 % 8,875 %	15/03/2023 01/06/2025	6.391.903 6.919.211	0,21 0,23
	OneMain Finance Corp.  OneMain Finance Corp.	USD	7,125 %	15/03/2026	2.448.468	0,23
	OneMain Finance Corp.	USD	3,500 %	15/01/2027	2.112.270	0,07
	OneMain Finance Corp.	USD	6,625 %	15/01/2028	2.546.340	0,08
4.675.000	OneMain Finance Corp.	USD	4,000 %	15/09/2030	4.499.687	0,15
	Ovintiv Exploration, Inc.	USD	5,625 %	01/07/2024	4.755.164	0,16
	Pactiv LLC	USD	8,375 %	15/04/2027	3.049.800	0,10
	Penske Automotive Group, Inc.	USD	3,500 %	01/09/2025	4.649.369	0,15
	Penske Automotive Group, Inc. Range Resources Corp.	USD USD	3,750 % 5,000 %	15/06/2029 15/03/2023	2.490.855 5.843.137	0,08 0,19
	Range Resources Corp.	USD	4,875 %	15/05/2025	3.313.688	0,13
	SCIL IV LLC Via SCIL USA Holdings LLC 144A(c)	USD	5,375 %	01/11/2026	2.493.359	0,08
	Service Properties Trust	USD	4,500 %	15/03/2025	9.263.016	0,30
1.325.000	SM Energy Co.	USD	6,500 %	15/07/2028	1.353.156	0,04
	Southwestern Energy Co.	USD	7,750 %	01/10/2027	3.885.667	0,13
	Southwestern Energy Co.	USD	5,375 %	01/02/2029	8.285.725	0,27
	Southwestern Energy Co.	USD USD	5,375 %	15/03/2030	2.116.275 2.990.850	0,07
	Spirit AeroSystems, Inc. Sprint Communications, Inc.	USD	4,600 % 6,000 %	15/06/2028 15/11/2022	5.706.050	0,10 0,19
	Sprint Corp.	USD	7,875 %	15/09/2023	8.243.909	0,17
	Sprint Corp.	USD	7,625 %	15/02/2025	8.696.599	0,28
4.764.000	Sprint Corp.	USD	7,625 %	01/03/2026	5.645.340	0,18
1.455.000	Starwood Property Trust, Inc.	USD	4,750 %	15/03/2025	1.513.200	0,05
	Suburban Propane Partners LP Via Suburban Energy Finance Corp.	USD	5,875 %	01/03/2027	2.873.772	0,09
	Summit Midstream Holdings LLC Via Summit Midstream Finance Corp.	USD	5,750 %	15/04/2025	9.885.330	0,32
	Sunoco LP Via Sunoco Finance Corp. – Serie WI	USD	4,500 %	15/05/2029	2.772.291	0,09
	Targa Resources Partners LP Via Targa Resources Partners Finance Corp. Targa Resources Partners LP Via Targa Resources Partners Finance Corp.	USD USD	5,875 %	15/04/2026	7.496.889 2.801.918	0,24 0,09
	TEGNA, Inc.	USD	6,500 % 4,625 %	15/07/2027 15/03/2028	3.681.000	0,09
	TK Elevator US Newco, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,250 %	15/07/2027	3.111.263	0,10
	T-Mobile USA, Inc.	USD	2,625 %	15/04/2026	1.782.312	0,06
	T-Mobile USA, Inc.	USD	3,375 %	15/04/2029	6.077.938	0,20
	TransDigm, Inc.	USD	6,375 %	15/06/2026	5.000.881	0,16
	TransDigm, Inc.	USD	7,500 %	15/03/2027	1.520.475	0,05
	TransDigm, Inc.	USD	5,500 %	15/11/2027	14.669.200	0,48
	TransDigm, Inc.	USD	4,625 %	15/01/2029	5.002.937	0,16
	TransDigm, Inc. TRI Pointe Group, Inc. Via TRI Pointe Homes, Inc.	USD USD	4,875 % 5,875 %	01/05/2029 15/06/2024	7.771.625 2.656.271	0,25 0,09
	Triumph Group, Inc.	USD	7,750 %	15/08/2025	3.776.000	0,09
		200				
	Twilio, Inc.	USD	3,875 %	15/03/2031	1.984.530	0,06

			Tipo de		Valor de mercado	% del
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en USD	patrimonio
Bonos - (con	tinuación) s – (continuación)					
	United Wholesale Mortgage LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/04/2029	8.222.400	0,27
	USA Compression Partners LP Via USA Compression Finance Corp.	USD	6,875 %	01/04/2026	10.555.267	0,34
	Western Midstream Operating LP	USD	5,300 %	01/02/2030	3.150.075	0,10
5.842.000	Yum! Brands, Inc.	USD	3,625 %	15/03/2031	5.666.740	0,18
TOTAL DE BOI	NOS				791.641.097	25,82
(coste USD 96					1.005.617.486	32,80
Tenencias	Descripción del valor				Valor de mercado en USD	% del
	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·				030	patrillionio
Estados Unido	inarias – 0,34 % os					
	Lear Corp.				137.535	0,01
30.773	Nabors Industries Ltd.				2.559.698	0,08
	Noble Corp.				5.486.308 2.144.028	0,18
70.423	Valaris Ltd.			-		0,07
TOTAL DE ACC	CIONES ORDINARIAS				10.327.569	0,34
(coste USD 16					10.327.569	0,34
			Tine de		Valor de	0/ -1-1
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés		mercado en USD	% del patrimonio
Acciones pre	ferentes - 0,07 %					
Estados Unido						
	Bank of America Corp. – Serie NN—Preferente	USD	4,375 %		2.217.880	0,07
(coste USD 2.2	CIONES PREFERENTES (25.000)				2.217.880	0,07
					Valor de	
Tenencias	Descripción del valor				mercado en USD	% del patrimonio
Warrants - 0,	00 %					
Bermudas						
	Nabors Industries Ltd., exp. 06/26—Warrants				32.824	0,00
Islas Caimán	Noble Corporati eva 02/28 Warrante				33.449	0.00
TOTAL DE WA	Noble Corporati, exp.02/28 —Warrants  RRANTS				33.449	0,00
(coste USD 58					66.273	0,00
Fondos de in	versión – 1,84 %					
	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de	e distribución			50 070 000	4.04
TOTAL DE FO	X)(e)(f) NDOS DE INVERSIÓN				56.378.028	1,84
(coste USD 56					56.378.028	1,84
TOTAL DE VAL OFICIAL	ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE V	ALORES				
(coste USD 1.0	40.653.798)				1.074.607.236	35,05
			<u>.</u>		Valor de	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	mercado en USD	% del patrimonio
Valores mobi	liarios negociados en otro mercado regulado					
Bonos - 58,4						
Australia	FMC Decourses August 2006 Dt. Ltd. 444A(c)	HOD	4 075 01	04/04/0004	4 000 050	0.11
	FMG Resources August 2006 Pty, Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	01/04/2031	4.368.250	0,14
Bermudas 1 530 000	Nabors Industries Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	Hen	7 250 0/	15/01/2026	1 350 160	0.04
	NCL Corp., Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	7,250 % 3,625 %	15/01/2026 15/12/2024	1.358.168 3.113.550	0,04 0,10
	NCL Corp., Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD	10,250 %	01/02/2026	3.076.140	0,10

Brons - (Continuation)   Browness - (Continuation)   Bro	Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del
Bermutar - Continuación   USD   5.875 %   15/03/2025   5.977.406   0		<u> </u>	Divisa	interes	r echa de vencimiento	en oob	patrinonic
6.015.000 NCL Corp. List. 144APA <sup>10</sup> 617.000 Valarist Li. 144APA <sup>10</sup> 617.000 Valarist Li. 144APA <sup>10</sup> 617.000 Valarist Li. 144APA <sup>10</sup> 7.438.000 1011778 BC ULC Via New Red Finance, Inc. 144APA <sup>10</sup> USD 3.076.000 % 151002300 7.178.6535 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0	•	·					
Canada		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	USD	5.875 %	15/03/2026	5.977.406	0,20
Cameda							0,02
Cameda						14.166.944	0,46
5,680,000 Ar Clanded 14AA <sup>(2)</sup>	Canadá						
9.332.000 Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(5)</sup> 4.000 Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(5)</sup> 4.000 Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(5)</sup> 4.000 Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(6)</sup> 4.000 Bausch Health Bausch Cos., Inc. 144A <sup>(6)</sup> 4.000	7.439.000	1011778 BC ULC Via New Red Finance, Inc. 144A(c)	USD	4,000 %	15/10/2030	7.178.635	0,23
4.000 Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(5)</sup> 4.33000 Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(5)</sup> 4.3000 Brooffield Residential Properties, Inc. Via Brooffield Residential US LLC 144A <sup>(6)</sup> 4.83000 Brooffield Residential Properties, Inc. Via Brooffield Residential US LLC 144A <sup>(6)</sup> 4.83000 Brooffield Residential Properties, Inc. Via Brooffield Residential US LLC 144A <sup>(6)</sup> 4.83000 GFL Environmental, Inc. 144A <sup>(6)</sup> 4.93000 Masonite International Corp. 144A <sup>(6)</sup> 4.93000 Masonite Internation	5.660.000	Air Canada 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	15/08/2026	5.681.225	0,19
7.718.000 Bausch Health Cos., Inc. 144AP0 USD 6,250 % 3001/2303 37.04 358 0 3.000.000 Bombardice, Inc. 144AP0 USD 5,250 % 3001/2303 37.04 358 0 3.000.000 Bombardice, Inc. 144AP0 USD 5,000 % 1076/2204 37.752.50 0 0172/2204 37.752.50 0 0172/2204 37.752.50 0 0172/2204 37.752.50 0 0172/2204 37.752.50 0 0172/2204 37.752.50 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.883.613 0 0170/2202 2.770.000 0 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 0170/2202 2.770.000 01	9.332.000	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,125 %	15/04/2025	9.495.310	0,31
4.35.000 Blusch Health Cos., Inc. 144A <sup>(n)</sup> 2.860.000 Brondriedt Inc. 144A <sup>(n)</sup> 2.860.000 GFL Environmental, Inc. 144A <sup>(n)</sup> 2.860.000		· ·	USD	5,000 %	30/01/2028	35.700	0,00
3.00.000 Bembarderic n. 144A <sup>(6)</sup> USD 5.000 % 10092022 8.3728.250 13 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0							0,23
2.889.000 Brookhelf Residential Properties, Inc. Via Brookheld Residential US LIC 144A <sup>(c)</sup> USD 5.000 % 10092029 5.731.200 0 0 4.880.000 GFL Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 5.125 % 15122020 5.044.000 0 4.880.000 GFL Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 4.000 % 01092028 4.451.300 0 4.880.000 GFL Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 4.000 % 01092028 4.641.300 0 10.970.000 GFL Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 4.770.00 GFL Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 4.750 % 15092028 2.770.000 GFL Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 4.750 % 15092028 2.770.000 GFL Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 4.750 % 15092028 2.770.200 GFL Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 4.750 % 15092028 2.770.200 GFL Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 13.000 % 15002028 3.925.801 % 15002023 3.925.801 % 15002020 3.925.801 % 15002020 3.925.801 % 15002020 3.925.801 % 15002020 3.925.801 % 15002020 3.925.801 % 15002020 3.925.801 % 15002020 3.925.801 % 15002020 3.925.801 % 15002020 3.925.801 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 % 15002020 3.927.700 %				.,			0,12
5 970.000   Garda World Security Corp. 144A(4)   USD   5,125 %   1512226   5,741.200   0.00		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					0,12
4.880.000 GPI. Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,125 % 161/20226 5,044.000 0 0 4.898.000 fPL Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,000 % 010/86/2028 4,445.330 0 0 4.776.000 GPI. Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,000 % 010/86/2028 4,446.00 0 0 2,770.000 GPI. Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 13,000 % 150/20225 3,258.892 0 0 2,335.4000 Husky III Holding Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD 13,000 % 150/202205 3,358.892 0 0 2,303.000 Mosorite International Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,300 % 150/20200 3,371.764 0 0 2,625.000 Med GE Energy Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,300 % 150/20200 3,371.764 0 0 2,625.000 Med GE Energy Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,300 % 150/20200 3,371.764 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0							0,09
4.58.00.0 GPL Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 4.000 % 01/08/2028 4.451.330 0 0 277.000 GPL Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 4.750 % 15/08/2029 2.776.925 0 0 277.000 GPL Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 1.3000 % 15/08/2029 2.776.925 0 0 3.384.000 Hussyl Holding Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD 5.575 % 01/02/2025 3.265.892 0 2.930.000 Masonite International Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 5.575 % 01/02/2025 3.265.892 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0							0,19
4.776.000 GPt Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup>							0,16
2.770.000 GR Environmental, Inc. 144A <sup>(A)</sup> USD 4,750 % 1506/2029 2.776,925 0 2.330,000 Masonite international Crop. 144A <sup>(A)</sup> USD 5,375 % 010/202208 3.069,175 0 2.330,000 Masonite international Crop. 144A <sup>(A)</sup> USD 5,375 % 010/202208 3.069,175 0 2.625,000 MIG Energy Crop. 144A <sup>(A)</sup> USD 7,125 % 010/202208 3.069,175 0 2.625,000 MIG Energy Crop. 144A <sup>(A)</sup> USD 7,125 % 010/202207 2.723,438 0 0.1510,000 Open Text Crop. 144A <sup>(A)</sup> USD 3,875 % 1510,202208 1.012,245 0 0 0.012,2007 2.723,438 0 0.012,2007 2.723,438 0 0.012,2007 2.723,438 0 0.012,2007 2.723,438 0 0.012,2007 2.023,435,000 Open Text Crop. 144A 0 USD 3,875 % 0110,202208 4.610,202 0 4.630,000 Open Text Crop. 144A 0 USD 3,875 % 0110,202208 4.610,202 0 0.012,2007 2.023,425,000 0 0.000 Superior Plus IP Via Superior General Partner, Inc. 144A <sup>(A)</sup> USD 4,500 % 1503,2029 3.124,999 0 0.012,2007 2.024,426,000 0 0.000 Superior Plus IP Via Superior General Partner, Inc. 144A <sup>(A)</sup> USD 5,570 % 2001,2026 7.450,625 0 0.012,200 0 0.000 Superior Plus IP Via Superior General Partner, Inc. 144A <sup>(A)</sup> USD 5,570 % 2001,2026 7.450,625 0 0.012,000 Superior Plus IP Via Superior General Partner, Inc. 144A <sup>(A)</sup> USD 5,570 % 2001,2026 7.450,625 0 0.012,000 Superior Plus IP Via Superior General Partner, Inc. 144A <sup>(A)</sup> USD 3,375 % 1507,20208 7.450,625 0 0.012,000 Superior Plus IP Via Superior General Partner, Inc. 144A <sup>(A)</sup> USD 3,375 % 1507,20208 7.450,625 0 0.012,000 Superior Plus IP Via Superior General Partner, Inc. 144A <sup>(A)</sup> USD 3,375 % 1507,20208 7.450,625 0 0.012,000 Superior Plus IP Via Superior General Partner, Inc. 144A <sup>(A)</sup> USD 3,375 % 1507,20208 7.450,625 0 0.012,000 Superior Plus IP Via Superior General Partner, Inc. 144A <sup>(A)</sup> USD 3,375 % 1507,20208 7.450,620 0 0.012,000 Superior General Partner, Inc. 144A <sup>(A)</sup> USD 3,375 % 1509,2020 3,235,200 0 0.012,000 Superior General Partner, Inc. 144A <sup>(A)</sup> USD 3,375 % 1509,2020 3,245,200 0 0.012,2027 1.195,700 0 0.012,2027 1.195,700 0 0.012,2027 1.195,700 0 0.012,2027 1.195,700 0 0.012,2027 1.195,700 0 0.012,2027 1.195,700 0 0.012,2027 1.195		•					0,15
3.354.000 Husky III Holding Ltd. 144A <sup>(6)</sup> USD 1.0,000 % 15020205 3.325.802 N		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					0,15
2 930,000 Masonite International Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,375 % 01/02/2028 3,086,175 0 4,007,000 Masonite International Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 7,125 % 01/02/2027 2,723,438 0 6,151,000 Open Text Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,875 % 01/12/2029 4,601,062 0 6,151,000 Open Text Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,875 % 01/12/2029 4,601,062 0 3,075,000 Superior Plus LP Via Superior General Partner, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,875 % 01/12/2029 4,601,062 0 3,075,000 Superior Plus LP Via Superior General Partner, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,875 % 01/12/2029 4,601,062 0 8,503,719 2 1818s Calman 10,153,458 Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD 6,500 % 15/09/2024 9,388,183 0 7,190,000 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd. Via HawaiianMiles Loyally Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,760 % 20/01/2026 7,456,625 0 7,190,000 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd. Via HawaiianMiles Loyally Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,760 % 20/01/2026 7,456,625 0 7,190,000 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd. Via HawaiianMiles Loyally Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD 1,000 % 15/002/203 4,571,11 0 4,804,000 Seagate HDD Cayman 144A <sup>(c)</sup> USD 3,375 % 15/007/2031 4,578,810 0 2,107,077 Spirit Loyally Cayman Ltd. Via Spirit IP Cayman Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD 8,000 % 15/002/203 4,222,000 0 2,107,077 Spirit Loyally Cayman Ltd. Via Spirit IP Cayman Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD 6,875 % 01/02/2027 4,222,000 0 12,587,000 Transocean, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 1,500 % 30/01/2027 11,957,650 0 12,587,000 Transocean, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,875 % 15/002/203 8,222,000 0 12,587,000 Transocean, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,875 % 15/002/203 1,394,212 0 1,377,000 Constellum SE, 144A <sup>(c)</sup> USD 5,875 % 15/002/203 1,394,212 0 1,375,000 Info Constellum SE, 144A <sup>(c)</sup> USD 5,875 % 15/002/203 1,394,212 0 1,375,000 Info Constellum SE, 144A <sup>(c)</sup> USD 5,005 % 15/04/203 5,586,550 0 1,2580,000 Jazz Securities DAC 144A <sup>(c)</sup> USD 5,005 % 15/04/203 5,586,550 0 1,2680,000 Jazz Securities DAC 144A <sup>(c)</sup> USD 5,005 % 15/04/203 5,586,550 0 1,2680,000 Jazz Securities DAC 144A <sup>(c)</sup> USD 5,005 % 15/04/203 5,586,550 0 1,2690,000 Jazz Securities DAC 144A <sup>(c)</sup> USD 5,005 % 15/04/203 5,397,		·					0,09
4.007.000   Masonite International Corp. 144A  <sup>(c)</sup>   USD   3.50.0 %   15022030   3.371.764   0.22620   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.22650   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.2262000   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.226200   0.22							0,12
2.625.000 MEG Energy Corp. 144Al <sup>(c)</sup>		•					0,10
6 151.000 Open Text Corp. 144A(°) 4.630.000 Open Text Corp. 144A(°) 3.075.000 Superior Plus LP Via Superior General Partner, Inc. 144A(°) 3.075.000 Superior Plus LP Via Superior General Partner, Inc. 144A(°) 3.075.000 Superior Plus LP Via Superior General Partner, Inc. 144A(°) 3.075.000 Superior Plus LP Via Superior General Partner, Inc. 144A(°) 3.075.000 Superior Plus LP Via Superior General Partner, Inc. 144A(°) 3.075.000 Superior Plus LP Via Superior General Partner, Inc. 144A(°) 3.085.000 Superior Plus LP Via Superior General Partner, Inc. 144A(°) 3.085.000 Superior Plus LP Via Superior General Partner, Inc. 144A(°) 3.085.000 Superior Plus LP Via Superior General Partner, Inc. 144A(°) 3.085.000 Superior Plus LP Via Superior General Partner, Inc. 144A(°) 3.085.000 Superior Plus LP Via Superior General Partner, Inc. 144A(°) 3.085.000 Superior Plus LP Via							0,13
4.630.000   Open Text Corp. 144A   Open Tex		• • • • • • • • • • • • • • • • • • • •					0,09
Superior Plus LP Via Superior General Partner, Inc. 144A(c)   USD   4,500 %   15/03/2029   3,124,869   0   89,503,719   2		·					0,20
Selsas Calmán		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		•			0,15
Sias Calmán	3.075.000	Superior Plus LP Via Superior General Partner, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	15/03/2029	3.124.969	0,10
10153.458 Global Aircraft Leasing Co. Ltd. 144A © USD 6,500 % 15002/024 9,836,163 0 7,7190.000 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd. Via HawaiianMiles Loyally Ltd. 144A © USD 5,750 % 2001/12026 7,459,625 0 51,928 Noble Finance Co. 144A © USD 11,000 % 15002/0208 57,121 0 USD 3,375 % 15007/0231 4,575,8110 0 USD 3,375 % 15007/0231 4,575,8110 0 USD 10,000 % 2009/0205 2,323,052 0 USD 11,900 % 15002/0207 4,253,000 USD 11,840,000 USD 7,500 % 15001/0206 8,524,800 0 12,587,000 Transocean, Inc. 144A © USD 7,500 % 15001/0206 8,524,800 0 12,587,000 Transocean, Inc. 144A © USD 7,500 % 15001/0206 8,524,800 0 12,587,000 Transocean, Inc. 144A © USD 8,125 % 01/02/2027 11,957,650 0 1377,000 Constellium St. 144A © USD 8,125 % 01/02/2027 8,722,069 0 1377,000 Constellium St. 144A © USD 8,755 % 15002/0207 8,722,069 0 1377,000 Constellium St. 144A © USD 5,875 % 15002/0207 8,722,069 0 1377,000 Constellium St. 144A © USD 5,825 % 15006/2028 1,410,750 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0						89.503.719	2,92
7.190.000 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd. Via HawaiianMiles Loyalty Ltd. 144A(c) USD 5.750 % 20(1/2026 7.459.625 0.51.928 Noble Finance Co. 144A(c) USD 11,000 % 15/002/2028 57.121 0.000 Seagate HDD Cayman 144A(c) USD 11,000 % 15/002/2028 57.121 0.000 Seagate HDD Cayman 144A(c) USD 8.000 % 20(097/2025 2.323.052 0.000 % 20.097/2025 2.323.052 0.000 % 20.097/2025 2.323.052 0.000 % 20.097/2025 2.323.052 0.000 % 20.097/2025 2.323.052 0.000 % 20.097/2025 2.323.052 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.424.000 0.000 % 20.097/2027 4.423.200 0.000 % 20.097/2027 4.424.000 0.000 % 20.097/2027 4.424.000 0.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.000 % 20.0000 % 20.000 % 20.000 % 20.0000 % 20.000 % 20.0		(2)					
S1 19.28   Noble Finance Co. 144A(c)							0,32
A 804.000   Seagate HDD Cayman 144A <sup>(c)</sup>   USD   3.375 %   15/07/2031   4.575.810   0.21.07.077   Spirit Loyalty Cayman Ltd. Via Spirit IP Cayman Ltd. 144A <sup>(c)</sup>   USD   8.000 %   20/09/2025   2.323.052   0.45.600.000   Transocean Poseidon Ltd. 144A <sup>(c)</sup>   USD   0.6875 %   01/02/2027   4.423.200   0.01.840.000   11.840.000   Transocean, Inc. 144A <sup>(c)</sup>   USD   7.500 %   15/01/2026   8.524.800   0.01.2587.000   Transocean, Inc. 144A <sup>(c)</sup>   USD   7.500 %   15/01/2026   8.524.800   0.01.2587.000   Transocean, Inc. 144A <sup>(c)</sup>   USD   8.125 %   01/02/2027   11.957.655   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.01.2587.000   0.0		· · ·					0,24
2107.077 Spirit Loyalty Cayman Ltd. Via Spirit IP Cayman Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD 8,000 % 20/09/2025 2,323.052 0 4,560.000 Transocean Poseidon Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD 6,875 % 01/02/2027 4,223.200 0 11.840.000 Transocean, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 7,500 % 15/01/2026 8,524.800 0 12.587.000 Transocean, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 11,500 % 30/01/2027 19.57.650 0 12.587.000 Transocean, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 11,500 % 30/01/2027 19.57.650 0 12.587.000 Transocean, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 8,125 % 01/02/2027 8,722.069 0 0 13.77.000 Constellium SE. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,875 % 15/02/2026 13.934.212 0 13.550.000 Constellium SE. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,875 % 15/02/2026 13.934.212 0 0 13.550.000 Constellium SE. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,625 % 15/06/2028 14.10.750 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0							0,00
4.560.000   Transocean   Descidon Ltd. 144A(°)   USD   7.500 %   1501/2026   8.524.800   0.0     11.840.000   Transocean, Inc. 144A(°)   USD   7.500 %   1501/2026   8.524.800   0.0     12.587.000   Transocean, Inc. 144A(°)   USD   11.500 %   30/01/2027   11.957.650   0.0     12.587.000   Transocean, Inc. 144A(°)   USD   11.500 %   30/01/2027   11.957.650   0.0     12.587.000   Transocean, Inc. 144A(°)   USD   3.125 %   0.10/2/2027   8.722.069   0.0     1.377.000   Constellium S.E. 144A(°)   USD   5.875 %   15/02/2026   1.394.212   0.0     1.377.000   Constellium S.E. 144A(°)   USD   5.875 %   15/02/2026   1.394.212   0.0     1.350.000   Constellium S.E. 144A(°)   USD   5.625 %   15/06/2028   1.410.750   0.0     2.280.000   Constellium S.E. 144A(°)   USD   3.750 %   15/03/2037   197.000   0.0     3.735.000   SPCM S.A. 144A(°)   USD   3.375 %   15/03/2037   197.000   0.0     3.735.000   SPCM S.A. 144A(°)   USD   3.375 %   15/03/2037   3.566.925   0.0     2.280.000   SPCM S.A. 144A(°)   USD   4.750 %   15/09/2026   3.434.063   0.0     Constellium S.E. 144A(°)   USD   4.750 %   15/09/2026   3.434.063   0.0     Constellium S.E. 144A(°)   USD   4.750 %   15/09/2026   3.434.063   0.0     Constellium S.E. 144A(°)   USD   5.000 %   15/04/2027   2.400.750   0.0     Constellium S.E. 144A(°)   USD   5.017 %   2.60/60/2024   3.213.786   0.0     Constellium S.E. 144A(°)   USD   5.710 %   15/01/2026   6.795.77   0.0     Constellium S.E. 144A(°)   USD   5.459 %   30/06/2035   3.597.352   0.0     Constellium S.E. 144A(°)   USD   5.459 %   30/06/2035   3.597.352   0.0     Constellium S.E. 144A(°)   USD   5.459 %   30/06/2035   3.597.352   0.0     Constellium S.E. 144A(°)   USD   5.500 %   31/08/2026   4.903.000   0.0     Constellium S.E. 144A(°)   USD   5.500 %   31/08/2026   4.903.000   0.0     Constellium S.E. 144A(°)   USD   5.500 %   31/08/2026   4.903.000   0.0     Constellium S.E. 144A(°)   USD   5.500 %   31/08/2026   4.903.000   0.0     Constellium S.E. 144A(°)   USD   5.500 %   31/08/2026   4.903.000   0.0     Constel							0,15
11.840,000 Transocean, Inc. 144A(c) 12.587,000 Transocean, Inc. 144A(c) 12.587,000 Transocean, Inc. 144A(c) 12.587,000 Transocean, Inc. 144A(c) 13.000 Altice France S.A. 144A(c) 14.157,000 Altice France S.A. 144A(c) 15.157,000 Constellium S.E. 14							0,08
12.587.000   Transocean, Inc. 144A c c c c c c c c c c c c c c c c c c							0,14
Francia  8. 161 .000 Altice France S.A. 144A(°) 8. 161 .000 Altice France S.A. 144A(°) 1.377.000 Constellium S.E. 144A(°) 1.377.000 Constellium S.E. 144A(°) 1.370.000 Constellium S.E. 144A(°) 1.350.000 SPCM S.A. 144A(°) 1.350.000 SPCM S.A. 144A(°) 1.350.000 SPCM S.A. 144A(°) 1.350.000 SPCM S.A. 144A(°) 1.375.000 SPC							0,28
Rand	12.587.000	Transocean, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	11,500 %	30/01/2027	11.957.650	0,39
8.161.000 Altice France S.A. 144A(°) USD 8,125 % 01/02/2027 8.722.069 0 1.377.000 Constellium S.E. 144A(°) USD 5,875 % 15/02/2026 1.394.212 0 1.350.000 Constellium S.E. 144A(°) USD 5,625 % 15/06/2028 1.410.750 0 6.280.000 Constellium S.E. 144A(°) USD 3,750 % 15/04/2029 5.989.550 0 200.000 SPCM S.A. 144A(°) USD 3,750 % 15/03/2027 197.000 0 3.735.000 SPCM S.A. 144A(°) USD 3,755 % 15/03/2027 197.000 0 21.280.506 0  Alemania 3.375.000 IHO Verwaltungs GmbH 144A(°) USD 4,750 % 15/03/2030 3.566.925 0  Irlanda 2.425.000 Castlelake Aviation Finance DAC 144A(°) USD 5,000 % 15/04/2027 2.400.750 0 6.685.000 Jazz Securities DAC 144A(°) USD 5,000 % 15/04/2027 2.400.750 0 6.685.000 Intesa Sanpaolo SpA 144A(°) USD 5,017 % 26/06/2024 3.213.786 0 5.465.000 Intesa Sanpaolo SpA 144A(°) USD 5,710 % 15/01/2029 6.843.769 0  Italia  3.375.000 Intesa Sanpaolo SpA 144A(°) USD 5,017 % 26/06/2024 3.213.786 0 5.465.000 Intesa Sanpaolo SpA 144A(°) USD 5,710 % 15/01/2026 6.079.577 0 3.275.000 UniCredit SpA 144A(°) USD 5,459 % 30/06/2035 3.597.352 0  Italia Securities DAC 144A(°) USD 5,459 % 30/06/2035 3.597.352 0  Italia Securities DAC Noval Caribbean Cruises Ltd. 144A(°) USD 5,459 % 30/06/2035 3.597.352 0  Italia Securities DAC Noval Caribbean Cruises Ltd. 144A(°) USD 5,459 % 30/06/2035 3.597.352 0  Italia Securities DAC Noval Caribbean Cruises Ltd. 144A(°) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0  1.564.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A(°) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0  2.341.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A(°) USD 4,250 % 01/07/2026 6.351.496 0  3.493.5000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A(°) USD 4,250 % 01/07/2026 6.351.496 0  4.935.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A(°) USD 5,500 % 31/08/2026 4.935.000 0						49.157.421	1,60
1.377.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 5,875 % 15/02/2026 1.394.212 0.1350.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 5,625 % 15/06/2028 1.410.750 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 3,750 % 15/04/2029 5.989.550 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 3,750 % 15/04/2029 5.989.550 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 3,750 % 15/03/2027 197.000 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 3,125 % 15/03/2027 197.000 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 3,750 % 15/03/2027 197.000 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 3,375 % 15/03/2027 197.000 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 4,750 % 15/03/2030 3.566.925 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 4,750 % 15/03/2030 3.566.925 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 4,750 % 15/09/2026 3.434.063 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 5,000 % 15/04/2027 2.400.750 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 5,000 % 15/04/2027 2.400.750 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 5,017 % 26/06/2024 3.213.786 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 5,710 % 15/01/2029 6.843.769 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 5,710 % 15/01/2026 6.079.577 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 5,710 % 15/01/2026 6.079.577 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 5,710 % 15/01/2026 6.079.577 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 1,875 % 01/06/2033 3.597.352 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 1,875 % 01/06/2033 3.597.352 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 1,875 % 01/06/2033 1.796.657 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0.000 Constellium S.E. 144A(c) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.2	Francia	AU: 5 0 A 4444(a)	1100	0.405.0/	0.1.100.100.07	0.700.000	0.00
1.350.000   Constellium S.E. 144A(c)   USD   5,625 %   15/06/2028   1.410.750   0 6.280.000   Constellium S.E. 144A(c)   USD   3,750 %   15/04/2029   5,989.550   0 0 0.000   SPCM S.A. 144A(c)   USD   3,125 %   15/03/2027   197.000   0 0.000   SPCM S.A. 144A(c)   USD   3,375 %   15/03/2027   197.000   0 0.000   SPCM S.A. 144A(c)   USD   3,375 %   15/03/2030   3,566.925   0 0 0.000   SPCM S.A. 144A(c)   USD   4,750 %   15/03/2030   3,566.925   0 0 0.000   SPCM S.A. 144A(c)   USD   4,750 %   15/09/2026   3,434.063   0 0.000   SPCM S.A. 144A(c)   USD   4,750 %   15/09/2026   3,434.063   0 0.000   SPCM S.A. 144A(c)   USD   4,750 %   15/09/2026   3,434.063   0 0.000   SPCM S.A. 144A(c)   USD   4,375 %   15/01/2029   6,843.769   0 0.0000   SPCM S.A. 144A(c)   USD   5,000 %   15/01/2029   6,843.769   0 0.0000   SPCM S.A. 144A(c)   USD   5,459 %   30/06/2035   3,597.352   0 0.0000   SPCM S.A. 144A(c)   USD   5,459 %   30/06/2035   3,597.352   0 0.0000   SPCM S.A. 144A(c)   USD   5,459 %   30/06/2035   3,597.352   0 0.0000   SPCM S.A. 144A(c)   USD   5,459 %   30/06/2035   3,597.352   0 0.0000   SPCM S.A. 144A(c)   USD   5,459 %   30/06/2035   3,597.352   0 0.0000   SPCM S.A. 144A(c)   USD   5,459 %   3,0000   SPCM S.A. 144A(c)   USD   5,500 %   3,00000   SPCM S.A. 144A(c)   USD   5,500 %   3,0000   SPCM S.A. 144							0,28
6.280.000 Constellium S.E. 144A <sup>(c)</sup> 20.000 SPCM S.A. 144A <sup>(c)</sup> 21.280.506 O  21							0,05
200.000 SPCM S.A. 144A <sup>(c)</sup> 3.735.000 SPCM S.A. 144A <sup>(c)</sup> 400 SPCM S.A. 144A <sup>(c)</sup> 415/03/2030 3.566.925 0  21.280.506 0  21.280.506 0  21.280.506 0  Alemania 3.375.000 IHO Verwaltungs GmbH 144A <sup>(c)</sup> 415/03/2026 3.434.063 0  Irlanda 2.425.000 Castlelake Aviation Finance DAC 144A <sup>(c)</sup> 415/03/2026 3.434.063 0  Irlanda 2.425.000 Jazz Securities DAC 144A <sup>(c)</sup> 415/03/2026 3.434.063 0  415/03/2026 3.434.063 0  Irlanda 2.425.000 Jazz Securities DAC 144A <sup>(c)</sup> 415/03/2027 2.400.750 0  6.685.000 Jazz Securities DAC 144A <sup>(c)</sup> 415/03/2027 2.400.750 0  4.375 % 15/01/2029 6.843.769 0  9.244.519 0  18alia 3.000.000 Intesa Sanpaolo SpA 144A <sup>(c)</sup> 415/03/2021 3.213.786 0  5.465.000 Intesa Sanpaolo SpA 144A <sup>(c)</sup> 415/03/2021 3.213.786 0  5.465.000 Intesa Sanpaolo SpA 144A <sup>(c)</sup> 415/03/2035 3.597.352 0  12.890.715 0  Liberia 1.654.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> 4100 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup></sup>							0,05
3.735.000 SPCM S.A. 144A(c) USD 3,375 % 15/03/2030 3.566.925 0 0 21.280.506 0  Alemania 3.375.000 IHO Verwaltungs GmbH 144A(c) USD 4,750 % 15/09/2026 3.434.063 0  Irlanda 2.425.000 Castlelake Aviation Finance DAC 144A(c) USD 5,000 % 15/04/2027 2.400.750 0 6.685.000 Jazz Securities DAC 144A(c) USD 4,375 % 15/01/2029 6.843.769 0  Italia 3.000.000 Intesa Sanpaolo SpA 144A(c) USD 5,017 % 26/06/2024 3.213.786 0 5.465.000 Intesa Sanpaolo SpA 144A(c) USD 5,710 % 15/01/2026 6.079.577 0 3.275.000 UniCredit SpA 144A(c) USD 5,459 % 30/06/2035 3.597.352 0  ILiberia 1.654.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A(c) USD 9,125 % 15/06/2023 1.796.657 0 2.341.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A(c) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0 6.677.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A(c) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0 6.677.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A(c) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0 6.677.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A(c) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0 6.677.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A(c) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0 6.677.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A(c) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0 6.677.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A(c) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0 6.677.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A(c) USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0 6.677.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A(c) USD 5,500 % 31/08/2026 4.935.000 0							0,19
Alemania   3.375.000   IHO Verwaltungs GmbH 144A <sup>(c)</sup>   USD   4,750 %   15/09/2026   3.434.063   Companies   Com							0,01 0,12
Alemania   3.375.000   HO Verwaltungs GmbH 144A(c)   USD   4,750 %   15/09/2026   3.434.063   Control of the	3.733.000	GI GW G.A. 177A	OOD		13/03/2030		0,70
Sample   S	Alamania					21.200.300	0,70
Irlanda		IHO Verwaltungs GmbH 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/09/2026	3.434.063	0,11
2.425.000 Castlelake Aviation Finance DAC 144A <sup>(c)</sup> USD 5,000 % 15/04/2027 2.400.750 0 0 6.685.000 Jazz Securities DAC 144A <sup>(c)</sup> 15/01/2029 6.843.769 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0		<u>`</u>					
Color		Castlelake Aviation Finance DAC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	15/04/2027	2.400.750	0,08
Section   Continue	6.685.000	Jazz Securities DAC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	15/01/2029	6.843.769	0,22
3.000.000 Intesa Sanpaolo SpA 144A <sup>(c)</sup> 5.465.000 Intesa Sanpaolo SpA 144A <sup>(c)</sup> 3.275.000 UniCredit SpA 144A <sup>(c)</sup> USD 5.710 % 15/01/2026 6.079.577 0 3.275.000 UniCredit SpA 144A <sup>(c)</sup> USD 5.459 % 30/06/2035 3.597.352 0  12.890.715 0  Liberia  1.654.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD 10.875 % 01/06/2023 1.796.657 0 2.341.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0 6.677.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD 4.250 % 01/07/2026 6.351.496 0 4.935.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,500 % 31/08/2026 4.935.000 0						9.244.519	0,30
5.465.000 Intesa Sanpaolo SpA 144A <sup>(c)</sup> USD 5,710 % 15/01/2026 6.079.577 0       3.275.000 UniCredit SpA 144A <sup>(c)</sup> (d)     USD 5,459 % 30/06/2035 3.597.352 0       Liberia       1.654.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD 10,875 % 01/06/2023 1.796.657 0       2.341.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0       6.677.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD 4,250 % 01/07/2026 6.351.496 0       4.935.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,500 % 31/08/2026 4.935.000 0	Italia					-	
3.275.000 UniCredit SpA 144A <sup>(c)(d)</sup> USD  5,459 %  30/06/2035  3.597.352  0  12.890.715  0  Liberia  1.654.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD  10,875 %  01/06/2023  1.796.657  0  2.341.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD  9,125 %  15/06/2023  2.490.239  0  6.677.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD  4.250 %  01/07/2026  6.351.496  0  4.935.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD  5,500 %  31/08/2026  4.935.000 0	3.000.000	Intesa Sanpaolo SpA 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,017 %	26/06/2024	3.213.786	0,10
Liberia  1.654.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> 2.341.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> 4.935.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD 10,875 % 01/06/2023 1.796.657 0 USD 9,125 % 15/06/2023 2.490.239 0 USD 4,250 % 01/07/2026 6.351.496 0 USD 4,250 % 01/07/2026 6.351.496 0 USD 5,500 % 31/08/2026 4.935.000 0 USD 5,500 % 31/08/2028 4.935.000 0 USD 5,500 % 31/08/2026 4.935.000 0 USD 5,500 % 31/08/2028 4.935.00				5,710 %	15/01/2026	6.079.577	0,20
Liberia       USD       10,875 %       01/06/2023       1.796.657       0         2.341.000       Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A(c)       USD       9,125 %       15/06/2023       2.490.239       0         6.677.000       Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A(c)       USD       4,250 %       01/07/2026       6.351.496       0         4.935.000       Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A(c)       USD       5,500 %       31/08/2026       4.935.000       0	3.275.000	UniCredit SpA 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	5,459 %	30/06/2035	3.597.352	0,12
1.654.000     Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD     10,875 %     01/06/2023     1.796.657     0       2.341.000     Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD     9,125 %     15/06/2023     2.490.239     0       6.677.000     Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD     4,250 %     01/07/2026     6.351.496     0       4.935.000     Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD     5,500 %     31/08/2026     4.935.000     0						12.890.715	0,42
2.341.000     Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD     9,125 %     15/06/2023     2.490.239     0       6.677.000     Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD     4,250 %     01/07/2026     6.351.496     0       4.935.000     Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD     5,500 %     31/08/2026     4.935.000     0	Liberia						
6.677.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A(c) USD 4,250 % 01/07/2026 6.351.496 0 4.935.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A(c) USD 5,500 % 31/08/2026 4.935.000 0		•					0,06
4.935.000 Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,500 % 31/08/2026 4.935.000 0		·					0,08
·		·					0,21
	4.935.000	Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	31/08/2026	4.935.000	0,16
15.573.392 0						15.573.392	0,51

					Valor de	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
Luxemburgo	Altico Financina C A 144A(C)	USD	5,000 %	15/01/2028	2.842.500	0,09
	Altice Financing S.A. 144A <sup>(c)</sup> Altice France Holding S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	10,500 %	15/05/2027	7.328.880	0,09
	Camelot Finance S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	01/11/2026	5.036.720	0,17
	Dana Financing Luxembourg SARL 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,750 %	15/04/2025	3.147.372	0,10
6.560.000	Endo Luxembourg Finance Co. I SARL Via Endo US, Inc. 144A(c)	USD	6,125 %	01/04/2029	6.428.800	0,21
4.475.000	Trinseo Materials Operating S.C.A.Via Trinseo Materials Finance, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,125 %	01/04/2029	4.461.016	0,15
					29.245.288	0,96
Países Bajos	Aloca Nadarland Halding DV 4444(C)	HCD	E E00 0/	45/40/2027	4.000.050	0.16
	Alcoa Nederland Holding BV 144A <sup>(c)</sup> Diamond BC BV 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	5,500 % 4,625 %	15/12/2027 01/10/2029	4.966.650 2.218.356	0,16 0,07
	Elastic NV 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,025 %	15/07/2029	2.216.330	0,07
	Sensata Technologies BV 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	15/04/2029	2.706.800	0,07
2.000.000	ochsala recimologica de 144A	OOD	4,000 /0	13/04/2023	11.896.106	0,39
Panamá					11.000.100	0,55
	Carnival Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,625 %	01/03/2026	1.476.475	0,05
	Carnival Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,750 %	01/03/2027	8.077.388	0,26
2.025.000	Carnival Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	9,875 %	01/08/2027	2.300.906	0,08
4.565.000	Carnival Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,000 %	01/05/2029	4.433.756	0,14
			,		16.288.525	0,53
Supranacional						
	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp. Via Atlas Luxco 4 SARL 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	01/06/2028	5.723.162	0,19
1.380.000	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp. Via Atlas Luxco 4 SARL 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	01/06/2028	1.333.425	0,04
2.917.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC Via Ardagh Metal Packaging					
6.554.000	Finance Plc. 144A <sup>(c)</sup> Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC Via Ardagh Metal Packaging	USD	3,250 %	01/09/2028	2.813.082	0,09
	Finance Plc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	01/09/2029	6.353.284	0,21
	Ardagh Packaging Finance Plc. Via Ardagh Holdings USA, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,250 %	15/08/2027	7.168.437	0,23
	Clarios Global LP Via Clarios US Finance Co. 144A(c)	USD	8,500 %	15/05/2027	9.932.200	0,33
	Herbalife Nutrition Ltd. Via HLF Financing, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,875 %	01/09/2025	2.144.786	0,07
	JBS USA LUX S.A. Via JBS USA Food Co. Via JBS USA Finance, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/01/2030	4.384.348	0,14
	Paysafe Finance Plc. Via Paysafe Holdings US Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	15/06/2029	7.878.150	0,26
3.796.000	Titan Acquisition Ltd. Via Titan Co-Borrower LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,750 %	15/04/2026	3.800.745	0,12
Dalas Halds					51.531.619	1,68
Reino Unido 5.191.000	eG Global Finance Plc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,750 %	07/02/2025	5.255.887	0,17
	eG Global Finance Plc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,500 %	30/10/2025	7.737.075	0,25
	International Game Technology Plc. 144A(c)	USD	4,125 %	15/04/2026	2.072.468	0,07
3.457.000	International Game Technology Plc. 144A(c)	USD	5,250 %	15/01/2029	3.603.923	0,12
9.290.000	Modulaire Global Finance 2 Plc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	10,000 %	15/08/2023	9.440.962	0,31
6.020.000	TechnipFMC Plc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,500 %	01/02/2026	6.471.500	0,21
6.100.000	Virgin Media Finance Plc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	15/07/2030	5.917.000	0,19
					40.498.815	1,32
Estados Unido						
	180 Medical, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	15/10/2029	395.000	0,01
	Acrisure LLC Via Acrisure Finance, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Acrisure LLC Via Acrisure Finance, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	7,000 %	15/11/2025	2.050.552 9.718.406	0,07
	Acrisure LLC Via Acrisure Finance, Inc. 144A <sup>(c)</sup>		4,250 %	15/02/2029		0,32
		USD	6,000 %	01/08/2029	1.617.600	0,05
	AdaptHealth LLC 144A <sup>(c)</sup> ADT Security Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	5,125 % 4,125 %	01/03/2030 01/08/2029	2.223.825 5.236.725	0,07 0,17
	Alarm.com Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	2,724 %	15/01/2026	2.830.353	0,17
	Albertsons Cos., Inc. Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via Albertsons		7,500 %			
4.205.000	LLC 144A <sup>(c)</sup> Albertsons Cos., Inc. Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via Albertsons	USD		15/03/2026	2.420.375	0,08
3.656.000	LLC 144A <sup>(c)</sup> Albertsons Cos., Inc. Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via Albertsons	USD	5,875 %	15/02/2028	4.431.019	0,14
	LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	15/02/2030	3.884.500	0,13
∠.915.000	Albertsons Cos., Inc. Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via Albertsons LLC 144A <sup>(c)</sup>	LICD	2 500 6	45/00/0000	2 000 405	0.00
8 030 000	Allen Media LLC Via Allen Media Co-Issuer, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	3,500 % 10,500 %	15/03/2029 15/02/2028	2.900.425 8.662.022	0,09 0,28
	Alliant Holdings Intermediate LLC Via Alliant Holdings Co-Issuer 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,750 %	15/10/2027	10.850.962	0,28 0,35
10.7 17.000	, and a color in the intermediate LEO via / alliant i loidings Oo-issael 144A	000	0,700 /0	13/10/2027	10.000.002	0,00

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos – (con	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·				-	
	os – (continuación)  Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	9,750 %	15/07/2027	10.426.402	0,34
	Allison Transmission, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,750 %	30/01/2031	2.437.050	0,04
	American Builders & Contractors Supply Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	15/11/2029	9.892.300	0,32
	Amkor Technology, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,625 %	15/09/2027	6.438.758	0,21
	ANGI Group LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	15/08/2028	5.109.164	0,17
	APi Escrow Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/10/2029	678.110	0,02
5.503.000	APi Group DE, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	15/07/2029	5.420.455	0,18
4.383.000	APX Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,750 %	15/02/2027	4.563.799	0,15
	APX Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,750 %	15/07/2029	6.996.312	0,23
	Arko Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,125 %	15/11/2029	4.006.700	0,13
	Asbury Automotive Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	15/11/2029	1.772.721	0,06
	Asbury Automotive Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	15/02/2032	982.125	0,03
	Ashland LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,375 %	01/09/2031	3.523.375	0,12
	Atkore, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	01/06/2031	5.626.887	0,18
	Audacy Capital Corp. 144A <sup>(c)</sup> Avient Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,500 %	01/05/2027	3.292.358	0,11
	Avis Budget Car Rental LLC Via Avis Budget Finance, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	5,750 % 5,375 %	15/05/2025 01/03/2029	3.231.417 2.722.050	0,11 0,09
	Axalta Coating Systems LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,375 %	15/02/2029	6.554.087	0,09
	Bausch Health Americas, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	9,250 %	01/04/2026	18.329.287	0,60
	Bausch Health Americas, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,500 %	31/01/2027	2.452.188	0,08
	BCPE Empire Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,625 %	01/05/2027	9.178.890	0,30
	Berry Petroleum Co., LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,000 %	15/02/2026	4.128.000	0,13
	Black Knight InfoServ LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,625 %	01/09/2028	2.186.925	0,07
	Booz Allen Hamilton, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	01/09/2028	1.501.325	0,05
	Boyd Gaming Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/06/2031	2.320.788	0,08
	Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,000 %	01/02/2026	2.532.049	0,08
	Buckeye Partners LP 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	01/03/2028	2.055.719	0,07
	Builders FirstSource, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,750 %	01/06/2027	8.888.362	0,29
	Builders FirstSource, Inc. 144A(c)	USD	5,000 %	01/03/2030	3.452.420	0,11
1.822.000	BWX Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	30/06/2028	1.822.000	0,06
1.998.000	BWX Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	15/04/2029	2.002.995	0,07
2.643.000	Caesars Entertainment, Inc. 144A(c)	USD	6,250 %	01/07/2025	2.755.328	0,09
2.273.000	Caesars Entertainment, Inc. 144A(c)	USD	8,125 %	01/07/2027	2.505.983	0,08
3.065.000	Caesars Entertainment, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	15/10/2029	3.003.700	0,10
	Caesars Resort Collection LLC Via CRC Finco, Inc. 144A(c)	USD	5,750 %	01/07/2025	2.863.300	0,09
	California Resources Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,125 %	01/02/2026	3.837.600	0,13
	Calpine Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	15/02/2028	2.933.315	0,10
	Calpine Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,125 %	15/03/2028	4.204.175	0,14
	Calpine Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,750 %	01/03/2031	4.666.869	0,15
	Cars.com, Inc. 144A(c)	USD	6,375 %	01/11/2028	4.964.642	0,16
	Carvana Co. 144A(c)	USD	5,625 %	01/10/2025	4.725.175	0,15
	Carvana Co. 144A <sup>(c)</sup> Carvana Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	5,500 %	15/04/2027	5.557.650	0,18
	Castle US Holding Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 % 9,500 %	01/09/2029 15/02/2028	4.450.300 2.629.688	0,15 0,09
	Catalent Pharma Solutions, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,500 %	01/04/2030	1.910.813	0,09
	CCO Holdings LLC Via CCO Holdings Capital Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	01/05/2026	3.581.988	0,12
	CCO Holdings LLC Via CCO Holdings Capital Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	01/03/2030	6.528.759	0,12
	CCO Holdings LLC Via CCO Holdings Capital Corp. 144A(c)	USD	4,500 %	15/08/2030	2.686.438	0,09
	CCO Holdings LLC Via CCO Holdings Capital Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	01/02/2031	16.268.194	0,53
	CD&R Smokey Buyer, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,750 %	15/07/2025	1.419.563	0,05
	Cedar Fair LP Via Canada's Wonderland Co. Via Magnum Management Cor		,			-,
	Millennium Op 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	01/05/2025	2.687.895	0,09
1.459.000	Central Garden & Pet Co. 144A(c)	USD	4,125 %	30/04/2031	1.466.295	0,05
3.920.000	Chemours Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,750 %	15/11/2028	4.047.400	0,13
7.855.000	Chemours Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	15/11/2029	7.638.987	0,25
	Cheniere Energy Partners LP 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	01/03/2031	3.853.125	0,13
4.850.000	Cheniere Energy Partners LP 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,250 %	31/01/2032	4.686.312	0,15
	Chobani LLC Via Chobani Finance Corp., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,500 %	15/04/2025	4.348.264	0,14
	CHS Via Community Health Systems, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,000 %	15/03/2026	4.993.099	0,16
	CHS Via Community Health Systems, Inc. 144A(c)	USD	5,625 %	15/03/2027	7.859.956	0,26
	CHS Via Community Health Systems, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,125 %	01/04/2030	2.472.019	0,08
	CHS Via Community Health Systems, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/02/2031	1.692.900	0,06
	Cinemark USA, Inc. 144A(c)	USD	8,750 %	01/05/2025	1.482.188	0,05
	Cinemark USA, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,250 %	15/07/2028	2.921.344	0,10
	Civitas Resources, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	15/10/2026	1.364.688	0,04
	CNX Midstream Partners LP 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/04/2030	1.231.772	0,04
	CNX Resources Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,250 %	14/03/2027	3.135.438	0,10
	Coinbase Global, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	3,375 % 6,000 %	01/10/2028 01/03/2026	4.367.606 3.069.102	0,14 0,10
					J.009.10Z	
	CommScope, Inc. 144A <sup>(c)</sup> CP Atlas Ruyer, Inc. 144A <sup>(c)</sup>					
5.717.000	COP Holdco LP Via BIP-V Chinook Holdco LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	7,000 % 5,500 %	01/12/2028 15/06/2031	5.545.490 4.885.800	0,18 0,16

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)		1			
Estados Unido	s – (continuación)					
	Cracker Barrel Old Country Store, Inc. 144A(c)	USD	0,625 %	15/06/2026	3.009.115	0,10
	CrownRock LP Via CrownRock Finance, Inc. "F" 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,625 %	15/10/2025	4.808.494	0,16
	CrownRock LP Via CrownRock Finance, Inc. "F" 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	5,000 %	01/05/2029	1.499.850	0,05 0,09
	CSC Holdings LLC 144A <sup>(c)</sup> CSC Holdings LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 % 5,750 %	15/04/2027 15/01/2030	2.693.450 1.907.033	0,09
	CSC Holdings LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	01/12/2030	25.276.230	0,82
	CSC Holdings LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,375 %	15/02/2031	5.703.600	0,19
4.132.000	CTR Partnership LP Via CareTrust Capital Corp. 144A(c)	USD	3,875 %	30/06/2028	4.160.354	0,14
	Cumulus Media New Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,750 %	01/07/2026	3.180.653	0,10
	DaVita, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	01/06/2030	7.756.650	0,25
	DaVita, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Dealer Tire LLC Via DT Issuer LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	3,750 % 8,000 %	15/02/2031 01/02/2028	4.634.525 8.462.400	0,15 0,28
	Devon Energy Corp. 144A(c)	USD	5,250 %	15/09/2024	5.437	0,28
	Diamond Sports Group LLC Via Diamond Sports Finance Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,625 %	15/08/2027	2.469.250	0,08
	DISH DBS Corp. 144A	USD	5,250 %	01/12/2026	4.850.625	0,16
4.705.000	Dornoch Debt Merger Sub, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,625 %	15/10/2029	4.646.187	0,15
	Dropbox, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	0,234 %	01/03/2028	3.083.032	0,10
	DT Midstream, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	15/06/2031	4.728.850	0,15
	Dun & Bradstreet Corp. 144A(c)	USD	6,875 %	15/08/2026	2.994.719	0,10
	Dun & Bradstreet Corp. 144A <sup>(c)</sup> Dycom Industries, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	10,250 % 4,500 %	15/02/2027 15/04/2029	3.109.628 2.201.093	0,10 0,07
	Endeavor Energy Resources LP Via EER Finance, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,625 %	15/07/2025	4.436.250	0,07
	Endure Digital, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,000 %	15/02/2029	8.751.757	0,14
	EnLink Midstream LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,625 %	15/01/2028	3.046.538	0,10
4.030.000	EQT Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,625 %	15/05/2031	4.115.637	0,13
640.000	Everi Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	15/07/2029	638.400	0,02
	FirstEnergy Transmission LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,450 %	15/07/2044	2.577.875	0,08
	Foot Locker, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	01/10/2029	3.114.488	0,10
	Ford Motor Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	(6,019 %)	15/03/2026	5.506.419	0,18
	Foundation Building Materials, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Freedom Mortgage Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	6,000 % 7,625 %	01/03/2029 01/05/2026	8.420.912 9.654.825	0,27 0,32
	Freedom Mortgage Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,625 %	15/01/2027	3.896.300	0,32
	Frontier Communications Holdings LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,875 %	15/10/2027	4.582.987	0,15
	Gap, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,625 %	01/10/2029	952.875	0,03
990.000	Gap, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	01/10/2031	952.875	0,03
3.275.000	Gartner, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,625 %	15/06/2029	3.266.813	0,11
	Getty Images, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	9,750 %	01/03/2027	4.558.775	0,15
	Glatfelter Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/11/2029	3.062.813	0,10
	Global Infrastructure Solutions, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Global Medical Response, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	5,625 % 6,500 %	01/06/2029 01/10/2025	6.261.300 5.126.448	0,20 0,17
	Go Daddy Operating Co., LLC Via GD Finance Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,250 %	01/12/2027	2.889.438	0,17
	Go Daddy Operating Co., LLC Via GD Finance Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,500 %	01/03/2029	2.868.670	0,09
	Goodyear Tire & Rubber Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	15/07/2029	3.723.604	0,12
3.559.000	Goodyear Tire & Rubber Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,250 %	15/07/2031	3.719.155	0,12
	Graham Holdings Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,750 %	01/06/2026	4.642.888	0,15
	Gray Escrow II, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,375 %	15/11/2031	5.879.250	0,19
	Gray Television, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,000 %	15/05/2027	4.901.006	0,16
	Group 1 Automotive, Inc. 144A <sup>(c)</sup> GrubHub Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	4,000 % 5,500 %	15/08/2028 01/07/2027	6.021.180 5.146.537	0,20 0,17
	GTCR AP Finance, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,000 %	15/05/2027	1.668.520	0,17
	GYP Holdings III Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	01/05/2029	5.403.168	0,18
	HealthEquity, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	01/10/2029	1.758.240	0,06
4.421.000	H-Food Holdings LLC Via Hearthside Finance Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,500 %	01/06/2026	4.544.160	0,15
	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,375 %	01/05/2025	1.831.578	0,06
	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	01/05/2031	2.624.000	0,09
	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,625 %	15/02/2032	4.270.500	0,14
	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC Via Hilton Grand Vacations Borrower Escrow 144A(c) Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC Via Hilton Grand Vacations	USD	5,000 %	01/06/2029	5.129.225	0,17
4.000.000	Borrower Escrow 144A(c)	USD	4,875 %	01/07/2031	4.316.310	0,14
5.367.000	HLF Financing SARL LLC Via Herbalife International, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	01/06/2029	5.078.524	0,17
	Home Point Capital, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	01/02/2026	3.298.500	0,11
	Howard Hughes Corp. 144A(c)	USD	4,125 %	01/02/2029	1.415.505	0,05
	Howard Hughes Corp. 144A(c)	USD	4,375 %	01/02/2031	1.415.505	0,05
	HUB International Ltd. 144A <sup>(C)</sup>	USD	7,000 %	01/05/2026	5.888.622	0,19
	iHeartCommunications, Inc. 144A <sup>(c)</sup> iHeartCommunications, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	5,250 % 4,750 %	15/08/2027 15/01/2028	4.714.384 1.546.125	0,15 0,05
	Illuminate Buyer LLC Via Illuminate Holdings IV, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	9,000 %	01/07/2028	1.663.850	0,05
	Imola Merger Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/05/2029	4.922.665	0,16
	Ingevity Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	01/02/2026	2.526.188	0,08
	Ingevity Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	01/11/2028	1.190.400	0,04

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (cor	ntinuación)					
Estados Unide	os – (continuación)					
2.104.000	IRB Holding Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,000 %	15/06/2025	2.219.720	0,07
	IRB Holding Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,750 %	15/02/2026	11.125.493	0,36
	Iron Mountain, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	15/02/2031	3.071.125	0,10
	ITT Holdings LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,500 %	01/08/2029	1.429.575	0,05
	Jane Street Group Via JSG Finance, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	15/11/2029	3.869.031	0,13
	JELD-WEN, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	15/12/2025	2.088.675	0,07
	USELD-WEN, Inc. 144A <sup>(c)</sup> UKBR, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	4,875 % 4,750 %	15/12/2027 30/09/2028	3.054.400 3.937.380	0,10 0,13
	Ken Garff Automotive LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/09/2028	3.072.300	0,13
	Kronos Acquisition Holdings, Inc. Via KIK Custom Products, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7.000 %	31/12/2027	3.314.880	0,10
	LABL, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,750 %	15/07/2026	5.915.250	0,19
	LABL, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	10,500 %	15/07/2027	5.950.835	0,19
	LCM Investments Holdings II LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	01/05/2029	7.490.762	0,24
	LD Holdings Group LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,500 %	01/11/2025	5.874.320	0,19
4.742.000	LD Holdings Group LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,125 %	01/04/2028	4.371.531	0,14
1.628.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	01/07/2029	1.608.668	0,05
13.177.000	Level 3 Financing, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	15/09/2027	13.457.011	0,44
5.487.000	Level 3 Financing, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	01/07/2028	5.349.825	0,17
1.935.000	Level 3 Financing, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,625 %	15/01/2029	1.799.550	0,06
	LGI Homes, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	15/07/2029	5.374.282	0,18
	Lions Gate Capital Holdings LLC 144A(c)	USD	5,500 %	15/04/2029	5.306.262	0,17
	Lithia Motors, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	01/06/2029	1.911.245	0,06
	Lithia Motors, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	15/01/2031	1.347.200	0,04
	LogMeIn, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	01/09/2027	4.583.430	0,15
	LPL Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	15/03/2029	4.556.250	0,15
	LPL Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	15/05/2031	3.599.438	0,12
	Lumen Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	15/01/2029	1.992.800	0,07
	MACOM Technology Solutions Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	0,250 %	15/03/2026	3.352.356	0,11
	MajorDrive Holdings IV LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,375 %	01/06/2029	6.252.475	0,20
	Manitowoc Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup> Marriott Ownership Resorts, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	9,000 %	01/04/2026	6.135.280 3.846.500	0,20 0,13
	MasTec, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 % 4,500 %	15/06/2029 15/08/2028	5.924.241	0,13
	Match Group Holdings II LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	01/06/2028	6.022.582	0,19
	Match Group Holdings II LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,625 %	01/10/2031	2.988.828	0,10
	Mattel, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,375 %	01/04/2026	2.042.381	0,10
	Mattel, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,875 %	15/12/2027	2.236.163	0,07
	Mattel, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,750 %	01/04/2029	6.283.162	0,21
	Mauser Packaging Solutions Holding Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,250 %	15/04/2025	5.846.987	0,19
	May Acquisition Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,000 %	01/08/2029	8.021.250	0,26
4.290.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP Via MGP Finance Co-Issuer, Inc. $144A^{(c)}$	USD	4,625 %	15/06/2025	4.571.531	0,15
1.954.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP Via MGP Finance Co-Issuer,					
	Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	15/02/2029	2.056.585	0,07
	Midcap Financial Issuer Trust 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,500 %	01/05/2028	2.862.405	0,09
	Midcap Financial Issuer Trust 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,625 %	15/01/2030	4.633.275	0,15
	Minerals Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	01/07/2028	5.128.560	0,17
	Moog, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Mozart Debt Merger Sub, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	4,250 %	15/12/2027	4.498.010 3.246.375	0,15 0,11
	Mozart Debt Merger Sub, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Mozart Debt Merger Sub, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 % 5,250 %	01/04/2029 01/10/2029	5.353.100	0,11
	MPH Acquisition Holdings LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,750 %	01/11/2028	9.939.870	0,32
	MSCI, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,625 %	01/09/2030	2.202.538	0,07
	MSCI, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,625 %	01/11/2031	1.875.780	0,06
	Mueller Water Products, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	15/06/2029	4.709.630	0,15
	Murphy Oil USA, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,750 %	15/02/2031	4.497.894	0,15
	Nabors Industries, Inc. 144A	USD	7,375 %	15/05/2027	2.982.525	0,10
	Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,000 %	15/01/2027	4.051.125	0,13
	Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/08/2028	4.590.452	0,15
2.704.000	Netflix, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,625 %	15/06/2025	2.847.650	0,09
625.000	Nexstar Media, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	01/11/2028	628.906	0,02
4.865.000	NGL Energy Operating LLC Via NGL Energy Finance Corp. 144A(c)	USD	7,500 %	01/02/2026	4.895.406	0,16
2.055.000	Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(c)	USD	4,500 %	15/07/2029	1.995.919	0,07
80.000	Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,875 %	01/10/2030	83.500	0,00
	Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(c)	USD	4,750 %	15/07/2031	2.479.875	0,08
	NRG Energy, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,375 %	15/02/2029	2.328.970	0,08
	ON Semiconductor Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	01/09/2028	3.214.399	0,10
	Option Care Health, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	31/10/2029	2.026.530	0,07
	Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A(c)	USD	4,125 %	30/04/2028	1.298.475	0,04
	Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A(c)	USD	5,125 %	30/04/2031	7.889.700	0,26
	Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,250 %	15/06/2025	1.821.094	0,06
	Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	15/01/2029	2.431.250	0,08
4.369.000	Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	15/03/2030	4.303.465	0,14

			Tipo de		Valor de mercado	% del
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en USD	patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
Estados Unido	s – (continuación)					
	Par Pharmaceutical, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,500 %	01/04/2027	3.352.663	0,11
	Park River Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,625 %	01/02/2029	4.149.500	0,14
	Peloton Interactive, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,256 %	15/02/2026	4.030.455	0,13
	PennyMac Financial Services, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	15/02/2029	2.829.920	0,09
	PennyMac Financial Services, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,750 %	15/09/2031	3.753.900	0,12
	Performance Food Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup> PetSmart, Inc. Via PetSmart Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	4,250 % 4,750 %	01/08/2029 15/02/2028	5.431.412 1.967.063	0,18 0,06
	Pike Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	01/09/2028	4.275.565	0,00
	Polar US Borrower LLC Via Schenectady International Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,750 %	15/05/2026	4.644.441	0,15
	Post Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,750 %	01/03/2027	11.604.387	0,38
	Post Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,625 %	15/01/2028	8.378.325	0,27
	Post Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	15/04/2030	1.790.910	0,06
1.281.000	PRA Health Sciences, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	2,875 %	15/07/2026	1.277.798	0,04
5.490.000	Premier Entertainment Sub LLC Via Premier Entertainment Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,625 %	01/09/2029	5.517.450	0,18
5.490.000	Premier Entertainment Sub LLC Via Premier Entertainment Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,875 %	01/09/2031	5.551.762	0,18
	Presidio Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,250 %	01/02/2028	1.842.143	0,06
	Prestige Brands, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,125 %	15/01/2028	1.964.560	0,06
	Prestige Brands, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,750 %	01/04/2031	3.118.456	0,10
	Prime Security Services Borrower LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,250 %	15/01/2028	2.992.630	0,10
	Prime Security Services Borrower LLC Via Prime Finance, Inc. 144A(c)	USD	5,250 %	15/04/2024	5.436.296	0,18
	Prime Security Services Borrower LLC Via Prime Finance, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,375 %	31/08/2027	4.528.712	0,15
	Primo Water Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	30/04/2029	4.544.294	0,15
	PROG Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	6,000 %	15/11/2029	4.651.625	0,15
	PTC, Inc. 144A(c)  Peoplegy Cray LLC Via Peoplegy Co. Jacquer Corp. 144A(c)	USD	4,000 % 4,875 %	15/02/2028	1.398.670 2.806.750	0,05 0,09
	Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp. 144A <sup>(c)</sup> Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	9,375 %	01/06/2023 01/04/2027	6.019.580	0,09
	Redfin Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	0,500 %	01/04/2027	2.431.578	0,20
	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. Via LifePoint Health, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	9,750 %	01/12/2026	6.210.095	0,00
	Resideo Funding, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	01/09/2029	3.126.600	0,10
	Reynolds Group Issuer, Inc. Via Reynolds Group Issuer LLC Via Reynolds Group					
	Issuer Lu 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	15/10/2027	5.015.355	0,16
	Roller Bearing Co. of America, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	15/10/2029	198.378	0,01
	SBA Communications Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,125 %	01/02/2029	4.348.164	0,14
	Scientific Games International, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,250 %	15/03/2026	4.906.997	0,16
	Scotts Miracle-Gro Co. 144A <sup>(c)</sup> Scripps Escrow II, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	4,000 %	01/04/2031 15/01/2029	7.226.700 719.563	0,24 0,02
	SeaWorld Parks & Entertainment, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 % 5,250 %	15/08/2029	7.800.000	0,02
	Sensata Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	15/02/2030	4.954.062	0,23
	Sinclair Television Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	01/12/2030	4.029.300	0,13
	Sirius XM Radio, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	01/08/2027	2.481.188	0,08
	Sirius XM Radio, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	15/07/2028	1.441.194	0,05
	Sirius XM Radio, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	01/07/2030	4.620.525	0,15
	Sirius XM Radio, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	01/09/2031	4.278.942	0,14
5.507.000	Six Flags Theme Parks, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,000 %	01/07/2025	5.792.676	0,19
1.332.000	Sonic Automotive, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	15/11/2029	1.313.685	0,04
1.532.000	Sonic Automotive, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	15/11/2031	1.486.040	0,05
7.868.000	Spectrum Brands, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	15/03/2031	7.631.960	0,25
	Spirit AeroSystems, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/01/2025	1.564.650	0,05
	Spirit AeroSystems, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,500 %	15/04/2025	4.169.306	0,14
	SRM Escrow Issuer LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,000 %	01/11/2028	10.322.687	0,34
	SRS Distribution, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,125 %	01/07/2029	3.912.187	0,13
	SRS Distribution, Inc. 144A	USD	6,000 %	01/12/2029	4.970.000	0,16
	SS&C Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	30/09/2027	2.866.006	0,09
	Standard Industries, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	15/02/2027	7.186.571	0,23
	Standard Industries, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Staples, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	4,375 % 7,500 %	15/07/2030 15/04/2026	4.684.074 6.881.235	0,15 0,22
	Staples, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	10,750 %	15/04/2027	5.959.440	0,22
	Suburban Propane Partners LP Via Suburban Energy Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	01/06/2031	4.558.137	0,15
	Summit Midstream Holdings LLC Via Summit Midstream Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,500 %	15/10/2026	5.649.750	0,18
	Sunoco LP Via Sunoco Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	30/04/2030	7.123.050	0,23
	SWF Escrow Issuer Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,500 %	01/10/2029	4.475.625	0,15
	Switch Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	15/06/2029	2.430.079	0,08
	Tallgrass Energy Partners LP Via Tallgrass Energy Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,500 %	01/10/2025	5.739.947	0,19
	Tallgrass Energy Partners LP Via Tallgrass Energy Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,000 %	31/12/2030	3.900.525	0,13
	Tallgrass Energy Partners LP Via Tallgrass Energy Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,000 %	01/09/2031	4.329.000	0,14
6.040.000	Targa Resources Partners LP Via Targa Resources Partners Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	15/01/2032	6.251.400	0,20
	ITHY:	000	7,000 /0	13/01/2032	0.231.400	0,20

					Valor de	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
Estados Unido	s - (continuación)					
	Team Health Holdings, Inc. 144A(c)	USD	6,375 %	01/02/2025	4.127.085	0,13
	TEGNA, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/03/2026	1.128.855	0,04
	Tenet Healthcare Corp. 144A(c)	USD	7,500 %	01/04/2025	4.678.062	0,15
	Tenet Healthcare Corp. 144A <sup>(c)</sup> Tenet Healthcare Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	4,625 % 4,250 %	15/06/2028 01/06/2029	4.680.500 4.796.212	0,15 0,16
	Tenneco, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5.125 %	15/04/2029	5.301.075	0,10
	Thor Industries. Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	15/10/2029	7.673.400	0,17
	Travel & Leisure Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,625 %	31/07/2026	2.219.240	0,07
	Travel & Leisure Co. 144A(c)	USD	4,500 %	01/12/2029	4.868.287	0,16
3.076.000	Trident TPI Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,625 %	01/11/2025	3.107.443	0,10
3.855.000	TriMas Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	15/04/2029	3.859.819	0,13
	Triumph Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,875 %	01/06/2024	1.191.190	0,04
	Triumph Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,250 %	15/09/2024	7.585.631	0,25
	Tronox, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,500 %	01/05/2025	3.099.056	0,10
	Tronox, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	15/03/2029	6.019.775	0,20
	Twitter, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	3,875 %	15/12/2027	4.395.180	0,14
	Uber Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Uber Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,500 % 4,500 %	15/05/2025 15/08/2029	10.085.900 5.104.350	0,33 0,17
	Unifrax Escrow Issuer Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,250 %	30/09/2028	1.422.000	0,17
	Unifrax Escrow Issuer Corp. 144A(c)	USD	7,500 %	30/09/2029	2.988.490	0,10
	United Airlines, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	15/04/2026	1.250.438	0,04
	United Natural Foods, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,750 %	15/10/2028	6.100.805	0,20
	United Wholesale Mortgage LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/11/2025	6.209.437	0,20
1.841.000	Univar Solutions USA, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,125 %	01/12/2027	1.926.146	0,06
6.560.000	Univision Communications, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	01/05/2029	6.555.900	0,21
	Urban One, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,375 %	01/02/2028	4.612.500	0,15
	US Foods, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,250 %	15/04/2025	3.005.809	0,10
	US Foods, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/02/2029	6.193.320	0,20
	US Foods, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	01/06/2030	1.537.650	0,05
	USI, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	6,875 %	01/05/2025	5.683.162	0,19
	Valvoline, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Valvoline, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 % 3,625 %	15/02/2030 15/06/2031	2.677.765 4.133.850	0,09 0,13
	Vertiv Group Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	15/11/2028	2.966.398	0,10
	Vistra Operations Co., LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,625 %	15/02/2027	1.171.575	0,04
	Waste Pro USA, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/02/2026	1.279.570	0,04
2.957.000	WESCO Distribution, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,125 %	15/06/2025	3.121.483	0,10
3.392.000	WMG Acquisition Corp. 144A(c)	USD	3,875 %	15/07/2030	3.400.480	0,11
4.331.000	WMG Acquisition Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,000 %	15/02/2031	4.081.967	0,13
+ 4,887,000	Wolverine Escrow LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,500 %	15/11/2024	4.605.997	0,15
	WR Grace Holdings LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,625 %	01/10/2024	13.951.500	0,46
	WR Grace Holdings LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	15/06/2027	864.435	0,03
	WR Grace Holdings LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,625 %	15/08/2029	3.381.825	0,11
	Wyndham Destinations, Inc. 144A(c)	USD	4,625 %	01/03/2030	3.274.406	0,11
	Wynn Las Vegas LLC Via Wynn Las Vegas Capital Corp. 144A <sup>(c)</sup> Xerox Holdings Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	5,500 % 5,000 %	01/03/2025 15/08/2025	7.543.690 6.178.219	0,25 0,20
	Yum! Brands, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/01/2030	3.780.563	0,20
	Ziff Davis, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	15/10/2030	6.767.550	0,12
	ZoomInfo Technologies LLC Via ZoomInfo Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	01/02/2029	4.633.350	0,15
	200mmile Technologies EEO via 200mmile i manee Oorp. 14474				1.422.228.616	46,39
TOTAL DE BO						
(coste USD 1.8					1.791.308.497	58,43
(coste USD 1.8	ORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO (06.868.816)				1.791.308.497	58,43
Otros valores						
Bonos – 3,32 Luxemburgo	%					
-	Intelsat Jackson Holdings S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,500 %	15/10/2024	5.904.475	0,19
	Intelsat Jackson Holdings S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	9,750 %	15/07/2025	11.248.738	0,37
			,		17.153.213	0,56
Estados Unido						
	Beacon Roofing Supply, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	15/05/2029	7.180.737	0,23
	CoreLogic, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	01/05/2028	8.025.644	0,26
	DIRECTV Holdings LLC Via DIRECTV Financing Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,875 %	15/08/2027	5.004.120	0,16
	Jefferies Finance LLC Via JFIN Co-Issuer Corp. 144A <sup>(c)</sup> Nabors Industries, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	5,000 %	15/08/2028	4.141.714	0,14
	Novelis Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	9,000 % 4,750 %	01/02/2025 30/01/2030	7.239.575 10.635.170	0,24 0,35
	Penn National Gaming, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 % 4,125 %	01/07/2029	7.058.875	0,35
	PennyMac Financial Services, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,375 %	15/10/2025	2.467.465	0,23
	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		., 70			2,30

USD	20.069.478	GBP	14.571.726			21/01/2022	585.568	0,02
Divisa								
	Compra	Divisa	Venta			Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% de patrimonio
	NTENTE SOBRE CONTRA livisas a plazo – 0,00 %		<u> </u>				(1.758.575)	(0,06
						(88.388.617)	(1.298.440)	(0,04
	22/03/2022		, large place a 10 and		Corta _	(5.144.453)	(99.258)	(0,00
`	22/03/2022		muy largo plazo a 10 años		Corta	(31.307.672)	(638.548)	(0,02
` '			muy largo plazo 22/03/2022 muy largo plazo a 10 años		Corta	(998.750)	(34.492)	(0,00
, ,	Futuros sobre pagarés del				Corta	(17.159.039)	(177.817)	(0,01
(74)	Futuros sobre pagarés del	Tesoro de EE. UU.	a 2 años 31/03/2022		Corta	(16.207.734)	(57.261)	(0,00
, ,	Futuros sobre pagarés del		• .		Corta	(15.465.375)	(240.689)	(0,00
	USD Futuros sobre bonos del Te	esoro de FF UU a l	argo plazo 22/03/2022		Corta	(2.105.594)	(50.375)	(0,00
					_	(43.336.110)	(460.135)	(0,02
		•	de Alemania a 30 años 08/12/2021 de Alemania a 5 años 08/12/2021		Corta Corta	(1.983.865) (19.755.271)	(30.585) (90.653)	(0,00 (0,01
(110) I		•	de Alemania a 10 años 08/12/2021		Corta	(21.596.974)	(338.897)	(0,01
	Descripción del valor					Valor de mercado USD	latente en USD	% de patrimonio
	ENTE SOBRE CONTRAT	OS DE FUTUROS				Compromiso	1.642.618 Minusvalía	0,00
						122.291.875	1.642.618	0,06
89 1	Futuros sobre bonos del Te	esoro de EE. UU. a i	muy largo plazo 22/03/2022		Larga _	17.777.750	508.022	0,02
	Futuros sobre pagarés del				Larga	45.879.133	464.516	0,02
	Futuros sobre pagarés del Futuros sobre pagarés del				Larga Larga	19.493.086	52.887	0,02
	Futuros sobre bonos del Te Futuros sobre pagarés del		- ·		Larga	1.133.781 38.008.125	27.604 589.589	0,00 0,02
	USD							
Número de contratos	Descripción del valor					Valor de mercado USD	latente en USD	% de patrimonio
Contratos de f	uturos – (0,00 %)					Compromiso	Plusvalía	
(coste USD 2.96	6.938.413)	SALO EXOLUTEND	O DEMINDOO				2.968.501.457	96,83
(coste USD 119.			O DERIVADOS				102.585.724	3,35
TOTAL DE OTRO	.465) OS VALORES MOBILIARI	ios					933.378	0,03
	Valaris Ltd. <sup>(9)</sup> ONES ORDINARIAS						845.306	0,03
Estados Unidos							00.072	
Islas Caimán	Noble Corp.(g)						88.072	0,00
Acciones ordin	Descripción del valor						en USD	patrimonio
							Valor de mercado	% de
TOTAL DE BON (coste USD 119.							101.652.346	3,32
6.485.000	Wheel Pros, Inc. 144A <sup>(c)</sup>			USD	6,500 %	15/05/2029	6.310.716 84.499.133	2,70
4.700.000	TriNet Group, Inc. 144A(c)			USD	3,500 %	01/03/2029	4.635.375	0,1
	Solaris Midstream Holdings Synaptics, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	s LLC 144A <sup>(c)</sup>		USD USD	7,625 % 4,000 %	01/04/2026 15/06/2029	8.494.100 4.402.055	0,28 0,14
2.120.000	SM Energy Co. 144A <sup>(c)</sup>			USD	10,000 %	15/01/2025	2.321.400	0,0
	<ul> <li>– (continuación)</li> <li>Science Applications Intern</li> </ul>	national Corp. 144A	c)	USD	4,875 %	01/04/2028	6.582.187	0,2
Bonos - (conti	•							
Tenencias I	Descripción del valor			Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	mercado en USD	% de patrimonio

Contratos de	divisas a plazo – (contir	nuación)				
Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente en USD	% del patrimonio
USD	74.660.038	EUR	66.057.969	10/02/2022	(675.194)	(0,02)
MINUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRA	TOS DE DIVISAS A	PLAZO		(675.194)	(0,02)
Contratos de	divisas a plazo específic	cos de una clase	de acciones – 0,33 %			
Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
USD	68.610	SEK	604.172	20/01/2022	1.481	0,00
USD	1.826.177	GBP	1.364.358	21/01/2022	1.887	0,00
EUR	594.533.190	USD	671.343.311	10/02/2022	6.686.853	0,22
JPY	73.458.577.060	USD	645.441.385	16/02/2022	7.687.897	0,25
PLUSVALÍA LAT	ENTE SOBRE CONTRATOS	DE DIVISAS A PLAZ	O CELEBRADOS CON FINES DE COBERTU	RA	14.378.118	0,47
Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente en USD	% del patrimonio
SEK	57.613.452	USD	6.684.080	20/01/2022	(282.597)	(0,02)
GBP	103.105.212	USD	141.548.276	21/01/2022	(3.685.906)	(0,12)
CHF	11.324.094	USD	12.411.531	25/01/2022	(22.709)	(0,00)
USD	949.838	CHF	871.205	25/01/2022	(3.282)	(0,00)
AUD	4.676.356	USD	3.462.864	31/01/2022	(111.646)	(0,00)
SGD	1.012.301	USD	750.030	07/02/2022	(7.954)	(0,00)
USD	3.683	SGD	5.039	07/02/2022	(11)	(0,00)
USD	12.599.958	EUR	11.122.000	10/02/2022	(84.030)	(0,00)

MINUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA

Importe teórico	,			Fecha	Plusvalía latente	% del
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	de vencimiento	en USD	patrimonio
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)					
1.445.000	Fijo 1,000 %	Variable (Transocean, Inc.)	USD	20/12/2022	80.810	0,00
68.015.600	Variable (The Markit CDX North America High Yield 34 Version 1 Index)	Fijo 5,000 %	USD	20/06/2025	4.118.584	0,14
PLUSVALÍA LATEN	NTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMIEN	ITO CREDITICIO (CDS)			4.199.394	0,14
	Permutas de rendimiento total					
94.034	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	Fijo 0,000 %	USD	20/12/2021	154.937	0,00
98.250	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	Variable (iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF)	USD	20/12/2021	16.774	0,00
PLUSVALÍA LATENT	E SOBRE PERMUTAS DE RENDIMIENTO TOTA	L			171.711	0,00
TOTAL DE PLUSVAL	ÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE PERMUT	TAS FINANCIERAS			4.371.105	0,14
Importe teórico					Minusvalía latente	% del
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	en USD	patrimonio
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)					
131.050.000	Variable (The Markit CDX North America Hi	gh Fijo 5,000 %				(
	Yield 37 Version 1 Index)		USD	20/12/2026	(1.490.815)	(0,05)
	ENTE SOBRE PERMUTAS DE CREDITICIO (CDS)				(1.490.815)	(0,05)
TOTAL DE MINUS\ PERMUTAS FINAN	/ALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE ICIERAS				(1.490.815)	(0,05)
VALOR DE MERCA (coste USD 2.966.9	ADO DE LAS INVERSIONES 938.413)				2.981.230.611	97,25
OTROS ACTIVOS	Y PASIVOS		,		84.393.396	2,75
					3.065.624.007	100,00

16/02/2022

(125.536)

(4.323.671)

(0,00)

(0,14)

TOTAL DE INVERSIONES	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Total inversiones excluyendo derivados (coste USD 2.966.938.413)	2.968.501.457	96,83
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	1.642.618	0,06
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(1.758.575)	(0,06)
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	585.568	0,02
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	(675.194)	(0,02)
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	14.378.118	0,47
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	(4.323.671)	(0,14)
Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	4.371.105	0,14
Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	(1.490.815)	(0,05)
Otros activos y pasivos	84.393.396	2,75
Patrimonio	3.065.624.007	100,00

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Australia and New Zealand Banking Group Ltd., Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Morgan Stanley & Co., Inc., Natwest Markets Plc., Royal Bank of Canada, Standard Chartered Bank, State Street Bank & Trust y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Credit Suisse, JP Morgan Chase Bank N.A. y Merrill Lynch International.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,14 %.

- Una parte de estos valores estaba cedida en préstamo a 30 de noviembre de 2021. Consulte la Nota 6.
- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida
- 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (d) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.

  (e) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- (f) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.
- (g) La valoración de este valor la realiza el Tasador. Consulte la Nota 4.

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del
		Divisa	interes.	recha de vencimiento	eli OSD	patrinionic
Valores mobili Bonos – 86,87 Australia	iarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial %					
	Bonos del Estado de Australia – Serie 133	AUD	5,500 %	21/04/2023	2.747.347	0,50
2.660.000	Bonos del Estado de Australia – Serie 142	AUD	4,250 %	21/04/2026	2.154.088	0,39
					4.901.435	0,89
Austria						
	Bonos del Estado de Austria 144A <sup>(c)</sup>	EUR	2,100 %	Perp.	1.111.443	0,20
570.000	Bonos del Estado de Austria 144A <sup>(c)</sup>	EUR	0,850 %	Perp.	635.753	0,12
					1.747.196	0,32
Bélgica						
·	Bonos del Estado de Bélgica – Serie 73 144A <sup>(c)</sup>	EUR	3,000 %	22/06/2034	1.392.145	0,25
2.870.000	Bonos del Estado de Bélgica – Serie 79 144A <sup>(c)</sup>	EUR	0,200 %	22/10/2023	3.326.143	0,61
1.660.000	Bonos del Estado de Bélgica – Serie 87 144A <sup>(c)</sup>	EUR	0,900 %	22/06/2029	2.058.695	0,38
					6.776.983	1,24
Canadá						
	Bonos del Estado de Canadá	CAD	2,750 %	01/12/2048	961.414	0,17
2.040.000	Provincia de Ontario, Canadá	CAD	2,850 %	02/06/2023	1.643.854	0,30
1.520.000	Provincia de Ontario, Canadá	CAD	2,600 %	02/06/2025	1.236.736	0,23
					3.842.004	0,70
Chile						
655.000.000	Bonos de la Tesorería de la República en pesos	CLP	4,500 %	01/03/2026	763.278	0,14
	Bonos de la Tesorería de la República en pesos	CLP	5,000 %	01/03/2035	1.149.901	0,21
2.660.000.000	Bonos de la Tesorería de la República en pesos 144A <sup>(c)</sup>	CLP	4,700 %	01/09/2030	3.007.515	0,55
					4.920.694	0,90
China						
76.340.000	Bonos del Estado de China	CNY	1,990 %	09/04/2025	11.725.054	2,14
48.610.000	Bonos del Estado de China – Serie 1906	CNY	3,290 %	23/05/2029	7.847.314	1,43
					19.572.368	3,57
Colombia						
	Colombian TES	COP	3,300 %	17/03/2027	456.407	0,08
	TES de Colombia – Serie B	COP	6,250 %	26/11/2025	836.922	0,15
	OTES de Colombia – Serie BOTES de Colombia –	COP COP	5,750 % 6,000 %	03/11/2027 28/04/2028	1.539.938 439.541	0,28 0,08
	TES de Colombia – Serie B	COP	7,750 %	18/09/2030	765.537	0,00
	TES de Colombia – Serie B	COP	7,000 %	30/06/2032	2.300.924	0,42
	TES de Colombia – Serie B	COP	7,250 %	26/10/2050	692.191	0,13
					7.031.460	1,28
Banública Cha					7.001.100	
República Chec 34.970.000	Bonos del Estado de la República Checa – Serie 120	CZK	1,250 %	14/02/2025	1.492.877	0,27
	Bonos del Estado de la República Checa – Serie 121	CZK	1,200 %	13/03/2031	537.525	0,10
	Bonos del Estado de la República Checa – Serie 125	CZK	1,500 %	24/04/2040	407.232	0,07
11.210.000	Bonos del Estado de la República Checa – Serie 49	CZK	4,200 %	04/12/2036	599.395	0,11
	Bonos del Estado de la República Checa – Serie 94	CZK	0,950 %	15/05/2030	3.907.586	0,71
68.380.000	Bonos del Estado de la República Checa – Serie 95	CZK	1,000 %	26/06/2026	2.833.882	0,52
					9.778.497	1,78
Dinamarca						
4.605.000	Bonos del Estado de Dinamarca	DKK	1,750 %	15/11/2025	768.138	0,14
Francia			0.12= 1:		4 000	
	Agence Francaise de Developpement EPIC     Caisse Centrale du Credit Immobilier de France S.A.	EUR	0,125 %	29/09/2031	1.360.997	0,25 0,28
	Dexia Credit Local S.A.	EUR GBP	(0,472 %) 0,250 %	17/01/2024 10/12/2026	1.494.915 1.159.948	0,28
	Bonos del Estado de Francia OAT	EUR	(0,615 %)	25/03/2025	7.903.815	1,44
	Bonos del Estado de Francia OAT	EUR	4,750 %	25/04/2035	54.991	0,01
	Bonos del Estado de Francia OAT	EUR	4,500 %	25/04/2041	4.664.524	0,85
330.000	Bonos del Estado de Francia OAT 144A <sup>(c)</sup>	EUR	2,000 %	25/05/2048	506.154	0,09
500.000	Bonos del Estado de Francia OAT 144A <sup>(c)</sup>	EUR	1,750 %	25/05/2066	771.292	0,14

Tononcias	Descripción del valer	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	•	DIVISA	Interes**	recna de vencimiento	en 02D	patrimonio
•	tinuacion)					
•	Bonos del Estado de Hungría – Serie 24/B	HUF	3,000 %	26/06/2024	8.089.419	1,48
	Sonos – (continuación) Iungría 2:670.470.000 Bonos del Estado de Hungría – Serie 24/B 96.570.000 Bonos del Estado de Hungría – Serie 24/B 96.570.000 Bonos internacionales del Estado de Indonesia 1.120.000 Bonos internacionales del Estado de Indonesia 1.120.000 Bonos internacionales del Estado de Indonesia 1.120.000 Bonos del Estado de Irlanda 820.000 Bono del Estado de Israel - Fijo – Serie 327 7.320.000 Bono del Estado de Israel - Fijo – Serie 825  Italia 1.990.000 Buoni poliennali del Tesoro Italia 950.000 Buoni poliennali del Tesoro Italia 950.000 Buoni poliennali del Tesoro Italia 80.000 Buoni poliennali del Tesoro Italia 80.000 Buoni poliennali del Tesoro Italia 800.000 Buoni del Estado de Japón – Serie 14 534.250.000 Bono del Estado de Japón – Serie 14 7.050.000 Bono del Estado de Japón – Serie 175 551.650.000 Bono del Estado de Japón – Serie 178 821.100.000 Bono del Estado de Japón – Serie 380 837.550.000 Bono del Estado de Japón – Serie 381 10.350.000 Bono del Estado de Japón – Serie 384 44.850.000 Bono del Estado de Japón – Serie 384 80.000.000 Bono del Estado de Japón – Serie 89 837.550.000 Bono del Estado de Japón – Serie 89 838.550.000 Bono del Estado de Japón – Serie 89 838.550.000 Bono del Estado de Japón – Serie 89 838.550.000 Bono del Estado de Japón – Serie 89 838.550.000 Bono del Estado de Japón – Serie 81 838.000.0000 Bono del Estado de J	HUF	3,000 %	21/08/2030	271.952	0,05
Bonos - (continuación)   Hungría   2.670.470.000   Bonos del Estado de Hungría - Serie 24/B   HUI   96.570.000   Bonos del Estado de Hungría - Serie 30/A   HUI   96.570.000   Bonos del Estado de Hungría - Serie 30/A   HUI   96.570.000   Bonos internacionales del Estado de Indonesia   EUF   1.120.000   Bonos internacionales del Estado de Indonesia   EUF   1.120.000   Bonos del Estado de Irlanda   EUF   1.120.000   Bono del Estado de Israel - Fijo - Serie 327   ILS   1.120.000   Bono del Estado de Israel - Fijo - Serie 825   ILS   1.120.000   Bono del Estado de Israel - Fijo - Serie 825   ILS   1.120.000   Bono del Estado de Israel - Fijo - Serie 825   ILS   1.120.000   Bono del Estado de Israel - Fijo - Serie 825   ILS   1.120.000   Bono del Estado de Israel - Fijo - Serie 825   ILS   1.120.000   Bono del Estado de Israel - Fijo - Serie 825   ILS   1.120.000   Bono del Estado de Israel - Fijo - Serie 825   ILS   1.120.000   Bono del Estado de Israel - Fijo - Serie 825   ILS   1.120.000   Bono del Estado de Israel - Fijo - Serie 825   ILS   1.120.000   Bono del Estado de Israel - Fijo - Serie 825   ILS   1.120.000   Bono del Estado de Israel - Fijo - Serie 144   ISP   1.120.000   Bono del Estado de Japón - Serie 144   ISP   1.120.000   Bono del Estado de Japón - Serie 145   ISP   1.120.000   Bono del Estado de Japón - Serie 145   ISP   1.120.000   Bono del Estado de Japón - Serie 175   ISP   1.120.000   Bono del Estado de Japón - Serie 1864   ISP   1.120.000   Bono del Estado de Japón - Serie 1864   ISP   1.120.000   Bono del Estado de Japón - Serie 1864   ISP   1.120.000   Bono del Estado de Japón - Serie 836   ISP   1.120.000   Bono del Estado de Japón - Serie 860   ISP   1.120.000   Bono del Estado de Japón - Serie 860   ISP   1.120.000   Bono del Estado de Japón - Serie 860   ISP   1.120.000   ISP   1.120.000   Bono de				8.361.371	1,53	
Indonesia						
	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	EUR	2,625 %	14/06/2023	3.432.543	0,63
		EUR	3,750 %	14/06/2028	1.482.351	0,27
					4.914.894	0,90
		,			4.514.054	0,50
	Ponos del Estado de Irlanda	ELID	0,200 %	18/10/2030	556.737	0,10
		EUR	0,106 %	18/10/2031	923.296	0,10
					1.480.033	0,27
					1.400.000	0,21
	Pono del Estado de Israel Eijo Serie 327	11.0	2,000 %	31/03/2027	18.967.151	3,46
		ILS	1,750 %	31/08/2025	2.465.133	0,45
		,			21.432.284	3,91
	Durai astisanati dal Taran V. C.		4.055.07		0.000.5==	*
	·	EUR	1,350 % 0,950 %	15/04/2022 01/03/2023	2.280.377 1.100.275	0,42 0,20
	·	EUR	4,500 %	01/03/2024	63.048	0,20
		EUR	0,144 %	01/04/2026	6.872.012	1,26
580.000	Buoni poliennali del Tesoro Italia	EUR	2,800 %	01/12/2028	764.563	0,14
		EUR	6,000 %	01/05/2031	1.442.228	0,26
			0,950 %	01/12/2031	547.075 4.511.568	0,10
3.210.000	Italy Buotii Polietinali Dei Tesoro 144A.	EUR	2,950 %	01/09/2038		0,82
					17.581.146	3,21
•						
	•	JPY	0,700 %	20/03/2061	5.362.230	0,98
	•		0,100 % 0,500 %	20/09/2024 20/12/2040	4.775.180 63.444	0,87 0,01
	•	JPY	0,500 %	20/09/2041	4.943.979	0,90
	•	JPY	2,300 %	20/06/2035	2.510.840	0,46
	•	JPY	0,100 %	20/03/2028	3.547.749	0,65
	•	JPY	0,100 %	20/03/2029	7.538.099	1,37
	•		0,100 % 0,100 %	20/12/2030 20/06/2031	401.957 92.482	0,07 0,02
	•	JPY	0,100 %	20/09/2031	71.381	0,02
	•	JPY	0,005 %	01/07/2023	206.935	0,04
	•	JPY	0,005 %	01/09/2023	33.385	0,01
	•	JPY	0,005 %	01/10/2023	1.853.274	0,34
	•		0,005 % 0,700 %	01/11/2023 20/12/2050	19.894.548 74.530	3,63 0,01
	·	JPY	0,700 %	20/06/2051	925.656	0,01
		JPY	0,700 %	20/09/2051	3.320.774	0,60
		JPY	(0,163 %)		65.602.840	11,97
5.867.700.000	Depósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028	JPY	(0,147 %)	11/04/2022	52.138.631	9,51
					173.357.914	31,62
México						
		MXN	5,750 %	05/03/2026	812.615	0,15
		MXN	7,750 %	29/05/2031	10	0,00
		MXN MXN	8,000 % 7,500 %	07/11/2047 03/06/2027	3.131.853 5.517.897	0,57 1,01
		MXN	8,500 %	31/05/2029	2.896.709	0,53
		MXN	10,000 %	20/11/2036	3.241.369	0,59
					15.600.453	2,85
Países Bajos		,				
	BNG Bank NV	GBP	0,375 %	15/12/2025	2.305.211	0,42
Noruega	Bonos del Estado de Noruega – Serie 477 144A <sup>(c)</sup>	NOK	1,750 %	13/03/2025	148.742	0,03
	Delice del Estado de Nordega - Selle 477 144A(-7	NON	1,730 70	13/03/2025	140.742	
Perú 335 000	Bonos del Estado de Perú	PEN	5,940 %	12/02/2029	84.736	0,01
	Bonos del Estado de Perú	PEN	6,150 %	12/08/2032	571.073	0,10

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de
		Divisu	Interes	T coma de venemmento		putililoili
Bonos – (continua Perú – (continua	·					
•	Bonos del Estado de Perú	PEN	5.400 %	12/08/2034	2.616.470	0,48
	Bonos del Estado de Perú	PEN	5,350 %	12/08/2040	861.602	0,16
	Bonos internacionales del Estado de Perú	PEN	6,950 %	12/08/2031	881.101	0,16
					5.014.982	0,91
Filipinas						
	Bonos del Estado de Filipinas – Serie 1063	PHP	6,250 %	22/03/2028	1.169.110	0,2
	Bonos del Estado de Filipinas – Serie 1064	PHP	6,875 %	10/01/2029	2.964.369	0,54
	Bonos internacionales del Estado de Filipinas	PHP	3,900 %	26/11/2022	199.515	0,04
243.000.000	Bonos internacionales del Estado de Filipinas	PHP	6,250 %	14/01/2036	5.516.014	1,01
Polonia					9.849.008	1,80
	Bonos del Estado de Polonia – Serie 425	PLN	0,750 %	25/04/2025	6.418.253	1,1
	Bonos del Estado de Polonia – Serie 428	PLN	2,750 %	25/04/2028	3.639.205	0,66
	Bonos del Estado de Polonia – Serie 727	PLN	2,500 %	25/07/2027	4.848.498	0,89
					14.905.956	2,72
Portugal						
1.540.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 144A <sup>(c)</sup>	EUR	1,950 %	15/06/2029	2.008.562	0,37
Rumanía	Panas dal Estado do Rumania - Cario 15 a	DON	2.650.0/	04/00/0004	1 004 504	0.00
	Bonos del Estado de Rumanía – Serie 15 a	RON	3,650 %	24/09/2031	1.264.561	0,23
2.870.000	Bonos del Estado de Rumanía – Serie 8 a	RON	4,150 %	26/01/2028	619.016	0,11
Dl-					1.883.577	0,34
Rusia	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ – Serie 6212	RUB	7,050 %	19/01/2028	1.294.533	0,24
	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ – Serie 6221	RUB	7,700 %	23/03/2033	1.708.572	0,25
	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ – Serie 6228	RUB	7,760 %	10/04/2030	5.546.900	1,01
	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ – Serie 6230	RUB	7,700 %	16/03/2039	389.427	0,07
	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ – Serie 6232	RUB	6,000 %	06/10/2027	1.128.913	0,21
	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ – Serie 6235	RUB	5,900 %	12/03/2031	1.922.353	0,35
	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ – Serie 6237	RUB	6,700 %	14/03/2029	2.264.017	0,41
					14.254.715	2,60
Singapur	Bonos del Estado de Singapur	SGD	2,375 %	01/06/2025	903.289	0,16
Corea del Sur	25.100 doi 25.000 do 5.11gapa.		2,010 70	0.700,2020		0,10
	Bonos del Tesoro de Corea indexados a la inflación – Serie 2306	KRW	1,125 %	10/06/2023	350.674	0,06
	Bonos del Tesoro de Corea indexados a la inflación – Serie 2506	KRW	1,750 %	10/06/2025	193.703	0,04
	Bonos del Tesoro de Corea indexados a la inflación – Serie 2606	KRW	1,000 %	10/06/2026	2.453.325	0,45
6.174.570.000	Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2506	KRW	2,250 %	10/06/2025	5.311.305	0,97
600.000.000	Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2706	KRW	2,125 %	10/06/2027	510.664	0,09
371.830.000	Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2806	KRW	2,625 %	10/06/2028	326.177	0,06
17.757.180.000	Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906	KRW	1,875 %	10/06/2029	14.785.143	2,70
13.714.780.000	Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2912	KRW	1,375 %	10/12/2029	10.930.145	1,99
	Bonos del Tesoro de Corea – Serie 3006	KRW	1,375 %	10/06/2030	9.543.188	1,74
6.856.740.000	Bonos del Tesoro de Corea – Serie 3106	KRW	2,000 %	10/06/2031	5.725.849	1,04
					50.130.173	9,14
España 560 000	Bonos del Estado de España	EUR	(0.308.0%)	31/01/2026	645.888	0.10
	Bonos del Estado de España  Bonos del Estado de España 144A <sup>(c)</sup>	EUR	(0,308 %) 5,850 %	31/01/2022	1.138.953	0,12 0,21
	Bonos del Estado de España 144A <sup>(c)</sup>	EUR	5,900 %	30/07/2026	132.361	0,02
	Bonos del Estado de España 144A(c)	EUR	1,500 %	30/04/2027	4.677.443	0,02
	Bonos del Estado de España 144A <sup>(c)</sup>	EUR	0,100 %	30/04/2031	1.227.229	0,00
	Bonos del Estado de España 144A <sup>(c)</sup>	EUR	3,450 %	30/07/2066	1.453.827	0,27
					9.275.701	1,69
Supranacionales	s Banco Europeo de Inversiones	SEK	1,750 %	12/11/2026	457.573	0,08
Tailandia	Sanda Europea de inversiónica	JLN	1,100 /0	12/11/2020	401.010	0,00
	Bonos del Estado de Tailandia	THB	1,250 %	12/03/2028	9.209.341	1,68
	Bonos del Estado de Tailandia	THB	1,600 %	17/12/2029	4.231.695	0,77
	Bonos del Estado de Tailandia	THB	3,650 %	20/06/2031	1.862.859	0,34
54.285.000	Borios del Estado de Taliandia	1110	0,000 /0	20/00/2001	1.002.000	
	Bonos del Estado de Tailandia	THB	3,775 %	25/06/2032	9.858.501	1,80

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de
Bonos – (contin	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					
Tailandia – (conti	•					
	Bonos del Estado de Tailandia	THB	3,400 %	17/06/2036	2.398.994	0,44
29.230.000	Bonos del Estado de Tailandia	THB	3,300 %	17/06/2038	957.221	0,18
89.130.000	Bonos del Estado de Tailandia	THB	3,600 %	17/06/2067	2.977.561	0,54
					31.956.819	### ### ### ### ### ### ### ### ### ##
Reino Unido						
	Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	0,375 %	22/10/2030	3.228.616	
	Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	4,500 %	07/09/2034	2.858.711	
	Bonos del Estado del Reino Unido (gilts) Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP GBP	3,500 % 1,500 %	22/01/2045 31/07/2053	2.910.984	
	Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	1,750 %	22/07/2057	1.517.584	
	Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	3,500 %	22/07/2068	1.550.302	
		-			13.145.022	
TOTAL DE BONO						
(coste USD 485.1	27.663)				476.222.836	86,87
					Valor de mercado	
Tenencias	Descripción del valor				en USD	patrimonio
Fondos de inve Irlanda	rsión – 0,32 %					
	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de $\chi$ )(d)(e)	distribución			1.720.498	0,32
	OS DE INVERSIÓN		-			
(coste USD 1.720					1.720.498	0,32
(coste USD 486.8	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VALC 348.161)	RES OFICIAL			477.943.334	87,19
					Valor de	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	mercado en USD	
Valores mobilia	rios negociados en otro mercado regulado					
Bonos - 8,27 %						
Alemania						
42.900.000.000	Bonos del Tesoro de Indonesia—Deutsche Bank AG 144A <sup>(c)</sup>	IDR	7,500 %	19/08/2032	3.201.962	0,58
Reino Unido						
	Bonos del Tesoro de Indonesia—Standard Chartered Bank 144A(c)	IDR	8,375 %	17/09/2026	4.648.905	
	Bonos del Tesoro de Indonesia—Standard Chartered Bank 144A <sup>(c)</sup> Bonos del Tesoro de Indonesia—Standard Chartered Bank 144A <sup>(c)</sup>	IDR IDR	8,750 % 7,500 %	19/05/2031 19/08/2032		-
3.123.000.000	Bollos del Tesoro de Indonesia—Standard Charlered Bank 144A	IDK -	7,300 %	19/06/2032		
					5.712.242	1,04
Estados Unidos	Fodoral Home Loan Ponko	LICD	2.625.0/	40/00/0005	744.070	0.44
	Federal Home Loan Banks Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(c)</sup>	USD	2,625 %	12/09/2025		
	Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(c)</sup>	IDR IDR	8,375 % 7,000 %	17/09/2026 17/05/2027		-
				19/03/2029		
	Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(c)</sup> Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(c)</sup>	IDR IDR	9,000 % 8,250 %	17/05/2029	8.929.808 958.444	
	Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(c)</sup>	IDR	7,000 %	18/09/2030	2.224.834	
	Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(c)</sup>	IDR	6,500 %	15/02/2031	2.859.271	
	Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(c)</sup>	IDR	8,750 %	17/05/2031	6.975.388	
	Bonos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(c)(f)</sup>	IDR	7,500 %	17/06/2035	10.716.713	
		-			36.437.150	6,65
TOTAL DE BONO (coste USD 44.17					45.351.354	8,27
·	RES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO				45.351.354	
	CADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS					-,
(coste USD 531.0					523.294.688	95,46

Número de contratos	Descripción del valor		Valor de mercado de la asignación en USD	Plusvalía latente en USD	% de patrimoni
	AUD				
30	Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021	Larga	2.993.741	29.097	0,0
### AUD    30   Futuri     19   Futuri     26   Futuri     12   Futuri     13   Futuri     14   Futuri     15   Futuri     16   Futuri     17   Futuri     18   Futuri     19   Futuri     10   Futuri     10   Futuri     10   Futuri     10   Futuri     10   Futuri     11   Futuri     12   Futuri     13   Futuri     14   Futuri     15   Futuri     15   Futuri     16   Futuri     17   Futuri     18   Futuri     18   Futuri     19   Futuri     19   Futuri     19   Futuri     10   Futuri     11   Futuri     12   Futuri     13   Futuri     14   Futuri     15   Futuri     16   Futuri     17   Futuri     17   Futuri     18   Futuri     19   Futuri     10   Futuri     10   Futuri     10   Futuri     11   Futuri     12   Futuri     13   Futuri     14   Futuri     15   Futuri     16   Futuri     17   Futuri     17   Futuri     18   Futuri     19   Futuri     10   Futuri     11   Futuri     12   Futuri     13   Futuri     14   Futuri     15   Futuri     16   Futuri     17   Futuri     17   Futuri     18   Futuri     19   Futuri     10   Futuri     10	Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 3 años 15/12/2021	Larga	1.559.411	6.730	0,0
			4.553.152	35.827	0,0
	EUR				
		Larga	2.300.734	42.055	
	·	Larga	5.104.739	60.818	
	•	Larga	2.975.798	170.313	
13	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/12/2021	Larga	2.006.395	16.135	0,0
			12.387.666	289.321	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
AUD  30 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  19 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 3 años 15/12/2021  EUR  12 Futuros sobre OAT en euros 08/12/2021  26 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años 08/12/2021  12 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/2021  13 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/12/2021  GBP  16 Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022  USD  22 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022  395 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022  101 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022  69 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022  PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS  Búmero de contratos  Descripción del valor  EUR  14 Futuros sobre Euro BTP Bonos del Estado de Italia 08/12/2021  (119) Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/12/2021					
16		Larga	2.709.093	36.124	0,0
າາ			0.500.040	04.400	0.0
		Larga	3.563.313	84.198	- , -
	. •	Larga	51.769.687	799.170	
		Larga	22.121.367	73.793	
69	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022	Larga	13.782.750	489.946	
			91.237.117	1.447.107	0,20
PLUSVALÍA LA	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS			1.808.379	0,3
Número de contratos	Descripción del valor		Valor de mercado de la asignación en USD	Minusvalía latente en USD	% de patrimonio
	EUR				
		Larga	2.421.346	(19.674)	(0,00
(119)	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/12/2021	Corta	(15.225.527)	(36.559)	patrimoni  0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0
			(12.804.181)	(56.233)	(0,01
	JPY				
(2)	Futuros sobre bonos del Estado de Japón a 10 años 13/12/2021	Corta	(2.700.000)	(355)	(0,00
		_			
, ,		Corta	(5.963.070)	(37.174)	(0,01
(137)		Corta	(20.136.860)	(388.523)	(0,07
			(26.099.930)	(425.697)	(0,08

Contratos a	nlazo sobre	honos no	entregables	- 0 00 %

Número de contratos	Descripción del valor		Valor de mercado de la asignación en USD	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
0.700.400.000	COP		0.400	0.400	
8.768.400.000	Contratos a plazo sobre bonos en COP de BFS Finance 04/01/2022	Larga	8.430	8.430	0,00
PLUSVALÍA LA	ATENTE DE CONTRATOS A PLAZO SOBRE BONOS NO ENTREGABLES			8.430	0,00

### Contratos de divisas a plazo – (0,01 %)

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
BRL	1.194.925	USD	213.170	02/12/2021	195	0,00
EUR	360.049	PLN	1.660.061	06/12/2021	5.484	0,00
USD	2.201.603	INR	164.540.186	07/12/2021	10.364	0,00
USD	85.797	TRY	1.089.613	10/12/2021	2.946	0,00
USD	87.900	ZAR	1.339.447	13/12/2021	4.035	0,00
USD	451.000	TRY	4.270.068	14/12/2021	126.920	0,02
CAD	1.695.624	EUR	1.139.042	15/12/2021	31.375	0,01
CHF	3.450.096	EUR	3.219.222	15/12/2021	103.735	0,03
CHF	1.393.297	USD	1.520.446	15/12/2021	1.378	0,00
CNH	31.705.039	USD	4.902.679	15/12/2021	70.875	0,01
EUR	191.931	CAD	276.501	15/12/2021	1.931	0,00
EUR	568.317	PLN	2.613.331	15/12/2021	10.944	0,00
EUR	568.151	SEK	5.733.620	15/12/2021	10.535	0,00

### Contratos de divisas a plazo - (continuación)

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
GBP	969.293	EUR	1.135.286	15/12/2021	2.828	0,00
ILS	681.568	EUR	187.766	15/12/2021	3.034	0,00
JPY	97.814.304	EUR	759.894	15/12/2021	3.831	0,00
USD	436.757	AUD	594.656	15/12/2021	10.809	0,00
USD	7.497.399	CAD	9.472.715	15/12/2021	78.378	0,01
USD	4.556.310	CZK	98.449.564	15/12/2021	173.138	0,03
USD	128.154.636	EUR	108.310.067	15/12/2021	4.859.096	0,86
USD	6.635.411	GBP	4.827.345	15/12/2021	185.020	0,04
USD	1.011.026	HUF	317.219.001	15/12/2021	24.705	0,00
USD	2.946.489	JPY	329.939.800	15/12/2021	15.709	0,01
USD	32.366.587	MXN	653.179.769	15/12/2021	1.813.765	0,32
USD	1.273.359	NOK	10.947.106	15/12/2021	63.455	0,01
USD	1.338.033	NZD	1.907.148	15/12/2021	34.013	0,00
USD	1.572.426	PLN	6.260.715	15/12/2021	48.763	0,01
USD	2.162.381	RON	9.263.504	15/12/2021	34.699	0,01
USD	2.015.971	SEK	17.424.567	15/12/2021	82.476	0,01
USD	440.793	SGD	599.589	15/12/2021	1.158	0,00
USD	1.882.353	THB	62.469.644	15/12/2021	28.535	0,01
USD	1.877.179	TRY	17.218.849	15/12/2021	570.944	0,13
USD	1.282.782	ZAR	19.053.743	15/12/2021	90.144	0,03
USD	2.241.724	IDR	31.933.358.199	17/12/2021	15.021	0,00
USD	142.501		1.706.811	20/12/2021	13.321	0,00
USD	55.874		171.197	21/12/2021	1.402	0,00
USD	264.033	ILS	828.429	22/12/2021	426	0,00
ILS	1.907.121	USD	602.000	24/12/2021	4.922	0,00
USD	52.212		161.151	24/12/2021	927	0,00
PHP	283.404.911		5.539.039	18/01/2022	68.443	0,01
TWD	10.800.375		388.908	19/01/2022	2.722	0,00
USD	452.880	SEK	3.877.730	20/01/2022	22.022	0,01
USD	14.034.670		10.202.390	21/01/2022	393.017	0,07
USD	726.313		4.616.126	25/01/2022	18.777	0,00
USD	787.743		6.571.470	25/01/2022	61.727	0,01
USD	393.290		123.175.026	26/01/2022	11.052	0,00
USD	9.665.159		13.051.185	31/01/2022	312.285	0,06
USD	1.036.480		1.290.340	31/01/2022	25.564	0,01
USD	9.457.522		145.921.399	03/02/2022	385.496	0,07
USD	520.403		428.869.191	07/02/2022	10.827	0,00
USD	800.023		1.079.762	07/02/2022	8.493	0,00
EUR	50.481.534		57.055.239	10/02/2022	515.983	0,10
USD	215.720		254.840.952	10/02/2022	953	0,00
USD	7.508.572		30.565.911	10/02/2022	100.571	0,02
USD	646.339		48.537.676	10/02/2022	1.357	0,00
USD	901.000		8.694.199	14/06/2022	304.008	0,06
-	TENTE SOBRE CONTRA				10.784.533	1.97

PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO	10.784.533	1,97
------------------------------------------------------	------------	------

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente en USD	% del patrimonio
USD	218.966	BRL	1.239.786	02/12/2021	(2.408)	(0,00)
PLN	344.947	EUR	75.000	06/12/2021	(1.350)	(0,00)
INR	166.792.474	USD	2.252.283	07/12/2021	(31.049)	(0,01)
USD	1.182.990	ZAR	18.896.991	09/12/2021	(868)	(0,00)
ZAR	22.217.286	USD	1.393.460	09/12/2021	(1.590)	(0,00)
KRW	2.571.541.565	USD	2.181.115	13/12/2021	(12.317)	(0,00)
ZAR	6.865.984	USD	447.908	13/12/2021	(18.018)	(0,00)
TRY	7.973.850	USD	901.000	14/12/2021	(295.818)	(0,06)
AUD	611.796	NZD	641.481	15/12/2021	(389)	(0,00)
AUD	7.844.389	USD	5.785.776	15/12/2021	(166.888)	(0,03)
CAD	4.676.191	USD	3.746.274	15/12/2021	(83.887)	(0,01)
CZK	14.314.261	EUR	563.908	15/12/2021	(4.629)	(0,00)
CZK	4.823.446	USD	219.752	15/12/2021	(5.003)	(0,00)
EUR	569.785	AUD	918.798	15/12/2021	(9.510)	(0,00)
EUR	380.758	CHF	411.996	15/12/2021	(16.562)	(0,00)
EUR	379.952	CZK	9.753.538	15/12/2021	(1.726)	(0,00)
EUR	193.176	GBP	165.788	15/12/2021	(1.625)	(0,00)
EUR	948.424	HUF	347.330.644	15/12/2021	(301)	(0,00)
EUR	759.600	JPY	99.783.717	15/12/2021	(21.661)	(0,00)
EUR	14.273.855	USD	16.337.236	15/12/2021	(88.492)	(0,02)
GBP	2.591.728	USD	3.504.180	15/12/2021	(41.062)	(0,02)
HUF	270.473.288	EUR	756.337	15/12/2021	(20.008)	(0,00)

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Contratos	de	divisas	а	plazo -	(continuación)	
-----------	----	---------	---	---------	----------------	--

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente en USD	% del patrimonio
HUF	508.719.570	USD	1.713.634	15/12/2021	(131.886)	(0,03)
JPY	343.997.856	USD	3.100.710	15/12/2021	(45.054)	(0,02)
MXN	13.669.936	USD	659.822	15/12/2021	(20.403)	(0,00)
NOK	11.674.108	EUR	1.139.901	15/12/2021	(7.360)	(0,00)
NOK	2.002.051	USD	231.750	15/12/2021	(10.477)	(0,00)
NZD	1.162.747	USD	827.762	15/12/2021	(32.729)	(0,01)
PLN	3.468.749	EUR	754.233	15/12/2021	(14.400)	(0,00)
PLN	56.492.307	USD	14.785.485	15/12/2021	(1.037.020)	(0,19)
RON	36.099.942	USD	8.573.383	15/12/2021	(281.788)	(0,05)
SEK	3.798.265	EUR	379.085	15/12/2021	(10.065)	(0,00)
SEK	7.718.265	USD	867.844	15/12/2021	(11.398)	(0,00)
SGD	590.762	USD	438.135	15/12/2021	(4.972)	(0,00)
THB	38.971.462	USD	1.163.623	15/12/2021	(7.126)	(0,00)
TRY	9.404.748	USD	968.073	15/12/2021	(254.622)	(0,06)
USD	2.765.600	CHF	2.541.193	15/12/2021	(10.012)	(0,00)
USD	4.400.961	CNH	28.497.693	15/12/2021	(69.457)	(0,01)
USD	7.915.083	ILS	25.356.358	15/12/2021	(149.757)	(0,03)
ZAR	170.040.612	USD	11.731.947	15/12/2021	(1.088.532)	(0,19)
IDR	15.684.728.718	USD	1.097.969	17/12/2021	(4.278)	(0,00)
ILS	1.443.528	USD	461.585	22/12/2021	(2.254)	(0,00)
INR	20.937.415	USD	278.600	27/12/2021	(198)	(0,00)
USD	2.657.889	TWD	73.590.058	19/01/2022	(10.544)	(0,00)
COP	11.397.180.496	USD	3.004.302	21/01/2022	(173.809)	(0,03)
MXN	851.673.683	USD	41.631.774	24/01/2022	(2.096.974)	(0,38)
NOK	5.059.927	USD	589.082	25/01/2022	(30.061)	(0,01)
ILS	15.635.646	USD	5.039.907	26/01/2022	(58.448)	(0,01)
USD	19.197.241	CNH	123.569.164	28/01/2022	(119.700)	(0,02)
CZK	187.071.707	USD	8.573.987	31/01/2022	(258.449)	(0,05)
CLP	350.947.284	USD	434.825	07/02/2022	(17.835)	(0,00)
MYR	146.398.614	USD	35.028.962	09/02/2022	(342.279)	(0,06)
IDR	57.331.688.197	USD	3.982.473	10/02/2022	(5.998)	(0,00)
KRW	2.776.605.639	USD	2.341.823	10/02/2022	(1.841)	(0,00)
PEN	1.909.477	USD	473.229	10/02/2022	(5.014)	(0,00)
RUB	349.727.120	USD	4.839.328	10/02/2022	(192.052)	(0,04)
USD	55.613.198	JPY	6.324.416.343	16/02/2022	(617.969)	(0,11)
USD	64.159.901	JPY	7.389.578.064	25/02/2022	(1.547.168)	(0,28)
USD	50.996.812	JPY	5.870.457.232	11/04/2022	(1.229.609)	(0,23)
TRY	4.727.833	USD	451.000	14/06/2022	(126.361)	(0,02)
MINUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTR	ATOS DE DIV	ISAS A PLAZO		(10.853.060)	(1,98)

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones – (0,69 %)

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
USD	676.382	EUR	570.000	15/12/2021	27.519	0,01
EUR	63.686.538	USD	71.984.065	10/02/2022	646.688	0,11
PLUSVALÍA LATE	ENTE SOBRE CONTRA	TOS DE DIVISAS A	PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA		674.207	0,12
Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
GBP	111.241.000	USD	153.211.006	21/01/2022	(4.470.244)	(0,81)
USD	2.680.434	GBP	2.006.176	21/01/2022	(2.032)	(0,00)
MINUSVALÍA LAT	TENTE SOBRE CONTR	ATOS DE DIVISAS A	A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA		(4.472.276)	(0,81)

Opciones - (0,31 %)

Tenencias	Descripción del valor				/(minusvalía) latente USD	mercado en USD	% del patrimonio
	Opciones adquiridas EUR						
750.000	Put EUR / Call PLN	Vence	02/12/2021	Precio de ejercicio 4,56	(1.959)	1	0,00
750.000	Put EUR / Call PLN	Vence	02/12/2021	Precio de ejercicio 4,56	(2.265)	1	0,00
6.087.000	Put EUR / Call USD	Vence	13/12/2021	Precio de ejercicio 1,12	(10.629)	8.782	0,00
6.651.000	Put EUR / Call USD	Vence	13/12/2021	Precio de ejercicio 1,12	(20.475)	6.849	0,00

nencias	Descripción del valor				Plusvalía /(minusvalía) latente USD	Valor de mercado en USD	% de patrimoni
	Opciones adquiridas – (continuación) EUR – (continuación)						
6.049.000	Put EUR / Call USD	Vence	13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	(3.553)	21.922	0,0
6.048.000	Put EUR / Call USD	Vence	13/12/2021	Precio de ejercicio 1,14	10.943	34.257	0,0
					(27.938)	71.812	0,0
	GBP						
10.800.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence	08/09/2022	Precio de ejercicio 0,28	(17.157)	3.476	0,0
14.100.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence	08/09/2022	Precio de ejercicio 0,30	(22.624)	4.819	0,0
13.240.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence	10/10/2022	Precio de ejercicio 0,42	(21.695)	7.004	0,0
	Call Swaption del SONIA a 12 meses		10/10/2022	Precio de ejercicio 0,46	(19.229)	7.242	0,0
	Call Swaption del SONIA a 12 meses		11/10/2022	Precio de ejercicio 0,92	(4.814)	33.780	0,0
	Call Swaption del SONIA a 12 meses		13/10/2022	Precio de ejercicio 0,93	(4.118)	27.326	0,0
	Call Swaption del SONIA a 12 meses		15/11/2022	Precio de ejercicio 0,52	(21.136)	10.156	0,0
12.120.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	vence	16/11/2022	Precio de ejercicio 0,54	(18.410)	10.097	0,0
					(129.183)	103.900	0,0
F47 F00 000	JPY	\/	00/05/0000	Deserte de eleccicio 0.40	(55.540)	0.4.707	0.0
517.520.000	Put Swaption del LIBOR a 6 meses	vence	26/05/2022	Precio de ejercicio 0,43	(55.548)	34.707	0,0
13 120 000	USD Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vanca	23/12/2021	Precio de ejercicio 0,63	(33.830)	2.848	0,0
	Call Swaption del LIBOR a 3 meses		07/01/2022	Precio de ejercicio 0,63	(33.663)	4.034	0,0
	Call Swaption del LIBOR a 3 meses		22/02/2022	Precio de ejercicio 0,47	(14.409)	2.603	0,0
	Call Swaption del LIBOR a 3 meses		23/03/2022	Precio de ejercicio 0,86	(31.732)	28.022	0,0
	Call Swaption del LIBOR a 3 meses		21/06/2022	Precio de ejercicio 1,05	(32.501)	39.503	0,0
	Call USD / Put ILS		17/12/2021	Precio de ejercicio 3,11	29.152	35.453	0,0
	Call USD / Put ILS		20/12/2021	Precio de ejercicio 3,13	17.744	24.524	0,0
1.721.000	Call USD / Put ILS	Vence	22/12/2021	Precio de ejercicio 3,14	16.594	23.461	0,0
	Call LISD / Dut IND	Vence	23/12/2021	Precio de ejercicio 75,26	7.124	16.521	0,0
3.417.000	Call USD / Ful link						
	Call USD / Put INK		07/12/2021	Precio de ejercicio 15,90	3.835	14.805	0,0
1.309.000		Vence	07/12/2021 07/12/2021	Precio de ejercicio 15,90 Precio de ejercicio 16,15	3.835 (6.006)	14.805 12.549	
1.309.000	Call USD / Put ZAR	Vence		•			0,0
1.309.000 2.581.000	Call USD / Put ZAR Call USD / Put ZAR Ciones adquiridas	Vence		•	(6.006)	12.549	0,0 0,0 0,0
1.309.000 2.581.000 OTAL DE OPC	Call USD / Put ZAR Call USD / Put ZAR CIONES ADQUIRIDAS 5.103) Opciones suscritas	Vence		•	(6.006)	12.549 204.323	0,0
1.309.000 2.581.000 PTAL DE OPC pate USD 705	Call USD / Put ZAR Call USD / Put ZAR  CIONES ADQUIRIDAS 6.103)  Opciones suscritas EUR	Vence Vence	07/12/2021	Precio de ejercicio 16,15	(6.006)	12.549 204.323 <b>414.742</b>	0,0 0,0 <b>0</b> ,0
1.309.000 2.581.000 2.581.000 OTAL DE OPC oste USD 705 (5.350.000)	Call USD / Put ZAR Call USD / Put ZAR  CIONES ADQUIRIDAS 5.103)  Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence Vence	07/12/2021	Precio de ejercicio 16,15  Precio de ejercicio 0,20	(6.006) (77.692) (19.346)	12.549 204.323 <b>414.742</b> (59.783)	0,0 0,0 <b>0,0</b> (0,0
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 3.581.000 3.581.000 3.581.000 3.581.000	Call USD / Put ZAR Call USD / Put ZAR Call USD / Put ZAR  CIONES ADQUIRIDAS 5.103)  Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence Vence Vence Vence	07/12/2021 13/12/2021 20/12/2021	Precio de ejercicio 16,15  Precio de ejercicio 0,20  Precio de ejercicio 0,19	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685)	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939)	0,0 0,0 0,0 (0,0°
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000)	Call USD / Put ZAR Call USD / Put ZAR Call USD / Put ZAR  CIONES ADQUIRIDAS 5.103)  Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence Vence Vence Vence Vence	07/12/2021 13/12/2021 20/12/2021 29/12/2021	Precio de ejercicio 16,15  Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314)	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518)	0,0 0,0 0,0 0,0 (0,0) (0,0)
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000)	Call USD / Put ZAR Call USD / Put ZAR CIONES ADQUIRIDAS 5.103)  Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence Vence Vence Vence Vence Vence	07/12/2021 13/12/2021 20/12/2021	Precio de ejercicio 16,15  Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,18	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728)	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292)	0,0 0,0 0,0 0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0)
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 3.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000)	Call USD / Put ZAR Call USD / Put ZAR Call USD / Put ZAR  CIONES ADQUIRIDAS 5.103)  Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence Vence Vence Vence Vence Vence Vence Vence Vence	13/12/2021 20/12/2021 20/12/2021 29/12/2021 06/01/2022	Precio de ejercicio 16,15  Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314)	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518)	0,0 0,0 0,0 (0,0°
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.990.000)	Call USD / Put ZAR Call USD / Put ZAR Call USD / Put ZAR  CIONES ADQUIRIDAS 5.103)  Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence Vence Vence Vence Vence Vence Vence Vence	07/12/2021 13/12/2021 20/12/2021 20/12/2021 06/01/2022 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830)	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188)	0,0 0,0 0,0 (0,0 (0,0) (0,0) (0,0) (0,0)
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.940.000)	Call USD / Put ZAR Call USD / Put ZAR Call USD / Put ZAR  CIONES ADQUIRIDAS 6.103)  Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence	13/12/2021 13/12/2021 20/12/2021 29/12/2021 06/01/2022 01/11/2022 01/11/2022	Precio de ejercicio 16,15  Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830) (17.443)	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188) (73.005)	0,0 0,0 0,0 (0,0 (0,0) (0,0) (0,0)
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (4.940.000) (4.000.000) (4.000.000)	Call USD / Put ZAR Call USD / Put ZAR Call USD / Put ZAR  CIONES ADQUIRIDAS 5.103)  Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence	13/12/2021 13/12/2021 20/12/2021 29/12/2021 06/01/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830) (17.443) (11.415)	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188) (73.005) (90.387)	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (4.940.000) (4.940.000) (4.940.000) (3.300.000)	Call USD / Put ZAR Call USD / Put ZAR Call USD / Put ZAR  CIONES ADQUIRIDAS i.103)  Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence Vence Vence Vence Vence Vence Vence Vence Vence Vence Vence Vence	13/12/2021 20/12/2021 20/12/2021 29/12/2021 06/01/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022	Precio de ejercicio 16,15  Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830) (17.443) (11.415) (22.858)	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188) (73.005) (90.387) (89.079)	0,0 0,0 0,0 (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0)
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (4.000.000) (4.000.000) (3.300.000) (5.350.000) (5.350.000)	Call USD / Put ZAR  CIONES ADQUIRIDAS 6.103)  Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence	13/12/2021 20/12/2021 20/12/2021 29/12/2021 06/01/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 13/12/2021 06/01/2022	Precio de ejercicio 16,15  Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830) (17.443) (11.415) (22.858) (18.271)	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188) (73.005) (90.387) (89.079) (73.490)	0,0 0,0 0,0 (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0)
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (4.940.000) (4.940.000) (4.000.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (9.120.000)	Call USD / Put ZAR  Call Supplication del EURIBOR a 6 meses Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence	07/12/2021 13/12/2021 20/12/2021 29/12/2021 06/01/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/05/2021	Precio de ejercicio 16,15  Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,11	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830) (17.443) (11.415) (22.858) (18.271) 27.534 7.775 3.026	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188) (73.005) (90.387) (89.079) (73.490) (12.903) (37.788) (90.215)	0,0 0,0 0,0 (0,0 (0,0 (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0)
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (4.940.000) (4.940.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (6.350.000) (9.120.000) (4.000.000)	Call USD / Put ZAR  Call Supplies Suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence	13/12/2021 20/12/2021 20/12/2021 29/12/2021 06/01/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022	Precio de ejercicio 16,15  Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,13	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830) (17.443) (11.415) (22.858) (18.271) 27.534 7.775 3.026 13.567	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188) (73.005) (90.387) (89.079) (73.490) (12.903) (37.788) (90.215) (38.919)	0,0 0,0 0,0 (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0)
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.990.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (6.350.000) (6.350.000) (6.350.000) (6.350.000) (6.350.000) (6.350.000) (6.350.000) (6.350.000) (6.350.000) (6.350.000) (6.350.000) (6.350.000) (6.350.000)	Call USD / Put ZAR CIONES ADQUIRIDAS 5.103)  Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence	13/12/2021 20/12/2021 20/12/2021 29/12/2021 06/01/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 06/05/2022 01/11/2022 01/11/2022	Precio de ejercicio 16,15  Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830) (17.443) (11.415) (22.858) (18.271) 27.534 7.775 3.026 13.567 16.616	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188) (73.005) (90.387) (89.079) (73.490) (12.903) (37.788) (90.215) (38.919) (38.822)	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.940.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.940.000) (4.940.000)	Call USD / Put ZAR Call Supplied Service Servic	Vence	07/12/2021 13/12/2021 20/12/2021 29/12/2021 06/01/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 13/12/2021 06/01/2022 26/05/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830) (17.443) (11.415) (22.858) (18.271) 27.534 7.775 3.026 13.567 16.616 11.580	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188) (73.005) (90.387) (89.079) (73.490) (12.903) (37.788) (90.215) (38.919) (38.822) (48.065)	0,0 0,0 0,0 (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (4.000.000) (4.000.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (4.000.000) (4.000.000) (4.000.000) (4.940.000) (4.000.000)	Call USD / Put ZAR  CIONES ADQUIRIDAS 5.103)  Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence	07/12/2021 13/12/2021 20/12/2021 29/12/2021 29/12/2021 06/01/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 13/12/2021 06/01/2022 26/05/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022	Precio de ejercicio 16,15  Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830) (17.443) (11.415) (22.858) (18.271) 27.534 7.775 3.026 13.567 16.616 11.580 29.789	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188) (73.005) (90.387) (89.079) (73.490) (12.903) (37.788) (90.215) (38.919) (38.822) (48.065) (33.343)	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (4.000.000) (4.940.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (9.120.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.940.000) (4.940.000) (4.940.000) (4.940.000) (4.940.000) (4.940.000) (4.940.000) (4.940.000) (3.300.000)	Call USD / Put ZAR  Ciones Adquiridas 5.103)  Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence	07/12/2021 13/12/2021 20/12/2021 29/12/2021 29/12/2021 06/01/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022	Precio de ejercicio 16,15  Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,12 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830) (17.443) (11.415) (22.858) (18.271) 27.534 7.775 3.026 13.567 16.616 11.580 29.789 27.710	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188) (73.005) (90.387) (73.490) (12.903) (37.788) (90.215) (38.919) (38.822) (48.065) (33.343) (27.508)	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.940.000) (5.350.000) (9.120.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.940.000) (3.900.000) (4.940.000) (3.300.000) (5.350.000)	Call USD / Put ZAR  Call Superior Call Superior Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence	07/12/2021 13/12/2021 20/12/2021 29/12/2021 06/01/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022	Precio de ejercicio 16,15  Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,19	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830) (17.443) (11.415) (22.858) (18.271) 27.534 7.775 3.026 13.567 16.616 11.580 29.789 27.710 14.163	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188) (73.005) (90.387) (89.079) (12.903) (37.788) (90.215) (38.919) (38.822) (48.065) (33.343) (27.508) (24.090)	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.390.000) (4.340.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.940.000) (4.940.000) (4.940.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000)	Call USD / Put ZAR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence	07/12/2021 13/12/2021 20/12/2021 29/12/2021 06/01/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 20/12/2021	Precio de ejercicio 16,15  Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,23	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830) (17.443) (11.415) (22.858) (18.271) 27.534 7.775 3.026 13.567 16.616 11.580 29.789 27.710 14.163 17.992	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188) (73.005) (90.387) (89.079) (73.490) (12.903) (37.788) (90.215) (38.919) (38.822) (48.065) (33.343) (27.508) (24.090) (22.212)	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.940.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.940.000) (4.000.000) (3.300.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (3.044.000)	Call USD / Put ZAR Call SUSD / Put ZAR  Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence	07/12/2021  13/12/2021 20/12/2021 20/12/2021 06/01/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 13/12/2021 06/01/2022 26/05/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2021	Precio de ejercicio 16,15  Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,23 Precio de ejercicio 0,13	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830) (17.443) (11.415) (22.858) (18.271) 27.534 7.775 3.026 13.567 16.616 11.580 29.789 27.710 14.163 17.992 7.917	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188) (73.005) (90.387) (89.079) (73.490) (12.903) (37.788) (90.215) (38.919) (38.822) (48.065) (33.343) (27.508) (24.090) (22.212) (11.032)	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.940.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.940.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (3.044.000) (3.041.000)	Call USD / Put ZAR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence	07/12/2021 13/12/2021 20/12/2021 29/12/2021 06/01/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 20/12/2021	Precio de ejercicio 16,15  Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,23	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830) (17.443) (11.415) (22.858) (18.271) 27.534 7.775 3.026 13.567 16.616 11.580 29.789 27.710 14.163 17.992	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188) (73.005) (90.387) (89.079) (73.490) (12.903) (37.788) (90.215) (38.919) (38.822) (48.065) (33.343) (27.508) (24.090) (22.212)	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.940.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.000.000) (3.300.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (3.044.000) (3.041.000)	Call USD / Put ZAR  Ciones Adquiridas 5.103)  Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence	07/12/2021  13/12/2021 20/12/2021 29/12/2021 06/01/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2021 13/12/2021 13/12/2021	Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 1,13 Precio de ejercicio 1,13 Precio de ejercicio 1,13 Precio de ejercicio 1,13	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830) (17.443) (11.415) (22.858) (18.271) 27.534 7.775 3.026 13.567 16.616 11.580 29.789 27.710 14.163 17.992 7.917	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188) (73.005) (90.387) (89.079) (73.490) (12.903) (37.788) (90.215) (38.919) (38.822) (48.065) (33.343) (27.508) (24.090) (22.212) (11.032) (11.021)	0,0 0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.940.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.000.000) (3.300.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (3.044.000) (3.041.000)	Call USD / Put ZAR  Ciones Adquiridas 5.103)  Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence	07/12/2021  13/12/2021 20/12/2021 29/12/2021 06/01/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2021 13/12/2021 13/12/2021	Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 1,13 Precio de ejercicio 1,13 Precio de ejercicio 1,13 Precio de ejercicio 1,13	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830) (17.443) (11.415) (22.858) (18.271) 27.534 7.775 3.026 13.567 16.616 11.580 29.789 27.710 14.163 17.992 7.917 17.765 757	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188) (73.005) (90.387) (89.079) (73.490) (12.903) (37.788) (90.215) (38.919) (38.822) (48.065) (33.343) (27.508) (24.090) (22.212) (11.032) (11.021) (17.129)	0,0 0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.940.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.000.000) (4.000.000) (3.300.000) (5.350.000) (5.350.000) (3.300.000) (5.350.000) (3.304.000) (3.044.000) (3.044.000) (3.024.000)	Call USD / Put ZAR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del LIBOR a 6 meses Put EUR / Call USD Put EUR / Call USD	Vence	07/12/2021  13/12/2021 20/12/2021 29/12/2021 06/01/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2021 13/12/2021 13/12/2021	Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 1,13 Precio de ejercicio 1,13 Precio de ejercicio 1,13 Precio de ejercicio 1,13	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830) (17.443) (11.415) (22.858) (18.271) 27.534 7.775 3.026 13.567 16.616 11.580 29.789 27.710 14.163 17.992 7.917 17.765 757	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188) (73.005) (90.387) (89.079) (73.490) (12.903) (37.788) (90.215) (38.919) (38.822) (48.065) (33.343) (27.508) (24.090) (22.212) (11.032) (11.021) (17.129)	0,0 0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (4.000.000) (4.000.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.000.000) (3.300.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000)	Call USD / Put ZAR  Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put EUR / Call USD Put EUR / Call USD  GBP Call Swaption del SONIA a 12 meses Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence	07/12/2021  13/12/2021 20/12/2021 29/12/2021 29/12/2021 06/01/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2021 13/12/2021 13/12/2021 13/12/2021 13/12/2021	Precio de ejercicio 16,15  Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 1,13 Precio de ejercicio 1,13 Precio de ejercicio 1,14  Precio de ejercicio 1,14	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830) (17.443) (11.415) (22.858) (18.271) 27.534 7.775 3.026 13.567 16.616 11.580 29.789 27.710 14.163 17.992 7.917 17.765 757	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188) (73.005) (90.387) (89.079) (73.490) (12.903) (37.788) (90.215) (38.919) (38.822) (48.065) (33.343) (27.508) (24.090) (22.212) (11.032) (11.021) (17.129) (1.080.728)	0,6 0,6 0,6 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,
1.309.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.940.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.000.000) (3.990.000) (4.940.000) (4.940.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000)	Call USD / Put ZAR  Ciones Adquiridas 5.103)  Opciones suscritas EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put Swaption del LIBOR a 6 meses Put Swaption del LIBOR a 6 meses Put Swaption del LIBOR a 6 meses Put EUR / Call USD Put EUR / Call USD Put EUR / Call USD Call Swaption del SONIA a 12 meses Call Swaption del SONIA a 12 meses Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence	07/12/2021 13/12/2021 20/12/2021 29/12/2021 29/12/2021 06/01/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 13/12/2021 13/12/2021 13/12/2021 13/12/2021 08/09/2022 08/09/2022 08/09/2022	Precio de ejercicio 16,15  Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 1,13 Precio de ejercicio 1,13 Precio de ejercicio 1,13 Precio de ejercicio 1,13 Precio de ejercicio 1,14  Precio de ejercicio 0,36 Precio de ejercicio 0,40 Precio de ejercicio 0,40 Precio de ejercicio 0,40 Precio de ejercicio 0,38	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830) (17.443) (11.415) (22.858) (18.271) 27.534 7.775 3.026 13.567 16.616 11.580 29.789 27.710 14.163 17.992 7.917 17.765 757 10.301	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188) (73.005) (90.387) (89.079) (73.490) (12.903) (37.788) (90.215) (38.919) (38.822) (48.065) (33.343) (27.508) (24.090) (22.212) (11.032) (11.021) (17.129) (1.080.728)	0,6 0,7 0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,
1.309.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 2.581.000 (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (4.000.000) (3.390.000) (4.940.000) (4.000.000) (3.300.000) (4.940.000) (4.000.000) (3.300.000) (4.940.000) (4.000.000) (3.300.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (5.350.000) (1.370.000) (1.110.000) (1.1460.000) (1.230.000)	Call USD / Put ZAR  Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Put EUR / Call USD Put EUR / Call USD  GBP Call Swaption del SONIA a 12 meses Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence	07/12/2021  13/12/2021 20/12/2021 29/12/2021 29/12/2021 06/01/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2022 01/11/2021 13/12/2021 13/12/2021 13/12/2021 13/12/2021	Precio de ejercicio 16,15  Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 0,18 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,20 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,11 Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,22 Precio de ejercicio 0,19 Precio de ejercicio 1,13 Precio de ejercicio 1,13 Precio de ejercicio 1,14  Precio de ejercicio 1,14	(6.006) (77.692) (19.346) (22.685) (44.314) (17.728) (11.830) (17.443) (11.415) (22.858) (18.271) 27.534 7.775 3.026 13.567 16.616 11.580 29.789 27.710 14.163 17.992 7.917 17.765 757	12.549 204.323 414.742 (59.783) (60.939) (84.518) (63.292) (73.188) (73.005) (90.387) (89.079) (73.490) (12.903) (37.788) (90.215) (38.919) (38.822) (48.065) (33.343) (27.508) (24.090) (22.212) (11.032) (11.021) (17.129) (1.080.728)	0,6 0,6 0,6 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,

### Opciones - (continuación)

Tenencias	Descripción del valor			Plusvalía /(minusvalía) latente USD	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	Opciones suscritas – (continuación)					
(4.300.000)	GBP – (continuación)	Vence 15/11/2022	Dracia da ciarciaia O EE	(2.020)	(24.440)	(0.04)
(1.380.000) (1.250.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 15/11/2022 Vence 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,55 Precio de ejercicio 0,60	(3.038) (5.822)	(34.419) (34.279)	(0,01)
(1.250.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,60	(5.622)	(34.279)	(0,01)
				(59.198)	(292.284)	(0,05)
	USD					
(6.640.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 06/12/2021	Precio de ejercicio 1,58	(10.980)	(61.195)	(0,01)
(6.640.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,64	(41.852)	(99.205)	(0,02)
(6.640.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 1,67	(67.175)	(123.947)	(0,02)
(4.260.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 1,30	28.163	(8.505)	(0,00)
(6.640.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 1,60	(30.832)	(92.584)	(0,02)
(4.220.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 07/01/2022	Precio de ejercicio 1,12	33.399	(4.248)	(0,00)
(4.220.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/02/2022	Precio de ejercicio 0,85	13.685	(3.331)	(0,00)
(4.260.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/03/2022	Precio de ejercicio 1,41	11.777	(47.962)	(0,01)
(4.250.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 21/06/2022	Precio de ejercicio 1,38	13.009	(58.962)	(0,01)
(860.000)	Call USD / Put ILS	Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 3,06	(21.305)	(28.384)	(0,01)
(860.000)	Call USD / Put ILS	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 3,08	(15.634)	(23.322)	(0,01)
(860.000)	Call USD / Put ILS	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 3,09	(15.009)	(23.032)	(0,00)
(1.709.000)	Call USD / Put INR	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 74,72	(6.224)	(15.063)	(0,00)
(429.000)	Call USD / Put TRY	Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 12,30	(30.663)	(35.486)	(0,01)
(1.290.000)	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 15,90	1.669	(14.590)	(0,00)
(6.640.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 06/12/2021	Precio de ejercicio 1,58	39.839	(10.376)	(0,00)
(6.640.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,64	42.848	(14.505)	(0,00)
(6.640.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 1,67	35.381	(21.391)	(0,00)
(6.640.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 1,60	21.652	(40.100)	(0,01)
				1.748	(726.188)	(0,13)
TOTAL DE OPCIO (coste USD (2.052.0					(2.099.200)	(0,38)
TOTAL DE OPCIO (coste USD (1.346.9	·				(1.684.458)	(0,31)

### Contratos de permutas financieras - (0,28 %)

Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
	Permutas de tipos de interés					
7.340.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 2,000 %	AUD	17/03/2032	37.070	0,01
18.480.000	Fijo 1,750 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2026	25.208	0,00
16.690.000	Fijo 1,680 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	22/08/2028	227.133	0,04
9.660.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,500 %	CAD	14/10/2031	73.083	0,01
14.100.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,250 %	CAD	15/12/2051	211.307	0,04
1.770.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,180 %	CAD	22/08/2052	757	0,00
14.870.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,000 %	CHF	16/03/2032	159.445	0,03
2.390.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,500 %	CHF	17/03/2032	16.228	0,00
7.998.610.000	Fijo 4,300 %	Variable (CLOIS a 6 meses en CLP)	CLP	15/12/2023	154.163	0,03
817.000.000	Fijo 2,700 %	Variable (PRIBOR a 6 meses en CZK)	CZK	15/12/2023	445.553	0,08
458.005.000	Variable (PRIBOR a 6 meses en CZK)	Fijo 3,600 %	CZK	15/12/2023	95.599	0,02
53.100.000	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	03/11/2023	89.421	0,02
2.160.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2024	10.595	0,00
3.611.231	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2026	17.060	0,00
8.210.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,200 %	EUR	03/11/2027	24.738	0,00
3.790.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,500 %	EUR	26/11/2031	30.674	0,01
4.340.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,500 %	EUR	17/03/2032	22.780	0,00
880.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,500 %	EUR	15/12/2041	2.271	0,00
800.000	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	Fijo 0,750 %	GBP	15/12/2051	24.120	0,00
10.000	Fijo 3,750 %	Variable (LIBOR a 6 meses en INR)	INR	16/09/2022	0	0,00
2.784.970.000	Variable (LIBOR a 3 meses en KRW)	Fijo 1,500 %	KRW	16/03/2024	9.691	0,00
701.830.000	Variable (LIBOR a 3 meses en KRW)	Fijo 1,750 %	KRW	15/09/2031	7.318	0,00
3.883.062	Fijo 6,700 %	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	09/12/2026	4.672	0,00
32.450.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,250 %	MYR	17/06/2022	4.564	0,00
18.500.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,250 %	MYR	17/06/2022	2.587	0,00
29.400.000	Variable (LIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,250 %	MYR	17/06/2022	6.203	0,00
14.250.000	Variable (LIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,250 %	MYR	17/06/2022	2.870	0,00
10.490.000	Variable (LIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,250 %	MYR	17/06/2022	1.611	0,00
90.660.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,650 %	MYR	27/02/2024	559.328	0,10
91.610.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,693 %	MYR	01/03/2024	586.809	0,11
49.190.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,250 %	MYR	18/12/2024	201.118	0,04

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

mporte teórico ocal neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% de patrimonio
	Permutas de tipos de interés – (contin	uación)				
19.540.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,000 %	MYR	18/03/2025	37.655	0,0
	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,250 %	MYR	15/12/2031	37.253	0,0
	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 3,000 %	NZD	16/09/2031	5.272	0,00
	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	Fijo 1,750 %	PLN	15/12/2023	30.703	0,0
	Fijo 1,700 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2026	42.968	0,0
	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,500 %	SEK	16/03/2024	39.225	0,0
	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,750 %	SEK	15/12/2031	39.694	0,0
	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 1,000 %	SEK	17/03/2032	1.736	0,00
	Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD	25/07/2024	2.321	0,00
	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	Fijo 1,530 %	USD	22/09/2031	12.814	0,00
	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	Fijo 1,750 %	USD	15/12/2031	82.633	0,02
LUSVALÍA LATENT	TE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE IN	TERÉS			3.386.250	0,62
	Permutas de inflación					
	Fijo 2,250 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/10/2023	1.558	0,0
4.160.000	Fijo 3,250 %	Variable (LIBOR a 12 meses en USD)	USD	07/10/2022	48.138	0,0
LUSVALÍA LATENT	TE SOBRE PERMUTAS DE INFLACIÓN				49.696	0,0
OTAL DE PLUSVAL	LÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE	PERMUTAS FINANCIERAS			3.435.946	0,6
mporte teórico					Plusvalía latente	% de
ocal neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	USD	patrimonic
	Permutas de tipos de interés					
34.210.000	Variable (BBSW a 3 meses en AUD)	Fijo 0,190 %	AUD	22/02/2023	(47.843)	(0,01
	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 1,250 %	AUD	15/12/2026	(698.576)	(0,13
	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 2,000 %	AUD	15/12/2031	(184.271)	(0,03
	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 1,560 %	CAD	22/08/2025	(204.171)	(0,04
14.420.000	,	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2031	(174.400)	(0,03
	Variable (LIBOR a 3 meses en COP)	Fijo 4,900 %	COP	15/12/2023	(10.774)	(0,00
	Variable (PRIBOR a 6 meses en CZK)	Fijo 1,500 %	CZK	15/09/2023	(425.421)	(0,08
	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2023	(9.027)	(0,00
12.370.000	,	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	03/11/2027	(111.867)	(0,02
	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2028	(14.470)	(0,00
	Fijo 0,000 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2031	(2.621)	(0,00
	Fijo 0,750 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	26/11/2041	(30.527)	(0,01
	Fijo 0,250 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2051	(59.540)	(0,01
17.810.000		Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2026	(79.932)	(0,01
	Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)	Fijo 4,060 %	GBP	15/12/2028	(192.647)	(0,04
	Fijo 0,750 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2031	(204.674)	(0,04
	Fijo 1,000 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	17/03/2032	(89.659)	(0,02
		Variable (BUBOR a 6 meses en HUF)	HUF	16/03/2024	(3.497)	(0,00
	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)	JPY	15/12/2031	(27.240)	(0,01
	Variable (LIBOR a 3 meses en KRW)	Fijo 1,250 %	KRW	18/03/2023	(42.157)	(0,01
	Variable (LIBOR a 3 meses en KRW)	Fijo 1,750 %	KRW	20/06/2029	(189.368)	(0,03
	Variable (LIBOR a 3 meses en KRW)	Fijo 1,700 %	KRW	16/09/2030	(667.798)	(0,03
	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	Fijo 5,600 %	MXN	13/09/2023	(142.213)	(0,03
	Variable (LIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,250 %	MYR	17/06/2025	(100.155)	(0,03
	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,000 %	MYR	16/06/2026	(157.568)	(0,02
	Variable (LIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,000 %	MYR	16/06/2026	(3.568)	(0,00
	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,000 %	MYR	15/12/2031	(24.145)	(0,00
	Fijo 2,000 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	16/03/2027	(88.554)	(0,00
80.550.000	•	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	11/05/2031	(101.503)	(0,02
21.490.000		Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	16/03/2032	(44.489)	(0,02
	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 1,250 %	NZD	15/12/2022	(7.262)	(0,01
	Fijo 2,000 %	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	NZD	15/12/2022	(25.646)	(0,00
129.640.000		Variable (WIBOR a 3 meses en PLN)	PLN	16/12/2021	(59.519)	(0,00
	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,250 %	SEK	15/12/2026	(11.953)	(0,0)
	Variable (LIBOR a 6 meses en THB)	Fijo 1,000 %	THB	16/03/2027		
	,			16/03/2027	(6.091)	(0,00
12.620.000	Fijo 0,250 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD		(43.287)	(0,01
10 220 000	FIJU 1,UUU 70	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2027	(68.800)	(0,01
19.220.000	File 2 F00 0/	Veriable (LIDOD a 2 LIOD)				
3.370.000	Fijo 2,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD	17/09/2031	(9.048)	(0,00
3.370.000 15.630.000		Variable (LIBOR a 3 meses en USD) Variable (SOFR a 1 mes en USD) Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD USD USD	17/09/2031 22/09/2036 16/03/2052	(9.048) (21.612) (109.497)	(0,00 (0,00 (0,02

### Contratos de permutas financieras - (continuación)

Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% de patrimoni
	Permutas de incumplimiento cred	diticio (CDS)				
1.470.000	Fijo 1,000 %	Variable (Bonos internacionales del Estado de China)	USD	20/12/2022	(6.508)	(0,00
50.000	Fijo 1,000 %	Variable (Bonos internacionales del Estado de China)	USD	20/12/2022	(246)	(0,00
	NTE SOBRE PERMUTAS DE CREDITICIO (CDS)				(6.754)	(0,00
	Permutas de inflación					•
3.670.000	Torridad de initación	Variable (LIBOR a 12 meses en				
	Fijo 1,920 %	EUR)	EUR	15/11/2031	(28.225)	(0,01
6.050.000	Variable (LIBOR a 12 meses en GB	P) Fijo 4,170 %	GBP	15/11/2028	(463.590)	(0,08
MINUSVALÍA LATE	NTE SOBRE PERMUTAS DE INFLA	ACIÓN			(491.815)	(0,09)
TOTAL DE MINUSV PERMUTAS FINAN	ALÍA LATENTE SOBRE CONTRAT	OS DE			(4.993.959)	(0,91)
VALOR DE MERCA (coste USD 529.67	ADO DE LAS INVERSIONES 1.430)	-			517.520.145	94,4
OTROS ACTIVOS Y	/ PASIVOS				30.678.533	5,59
PATRIMONIO					548.198.678	100,00
TOTAL DE INVERS	IONES				Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Total inversiones ex	cluyendo derivados (coste USD 531.	018.378)			523.294.688	95,46
Plusvalía latente sol	bre contratos de futuros				1.808.379	0,33
Minusvalía latente s	obre contratos de futuros				(482.285)	(0,09)
Plusvalía latente de	contratos a plazo sobre bonos no en	tregables			8.430	0,00
Plusvalía latente sol	bre contratos de divisas a plazo				10.784.533	1,97
Minusvalía latente s	obre contratos de divisas a plazo				(10.853.060)	(1,98)
Plusvalía latente sol	bre contratos de divisas a plazo celet	orados con fines de cobertura			674.207	0,12
Minusvalía latente s	obre contratos de divisas a plazo cel	ebrados con fines de cobertura			(4.472.276)	(0,81)
Valor de mercado de	e opciones compradas (coste USD 7	05.103)			414.742	0,07
Valor de mercado de	e opciones suscritas (coste USD (2.0	52.051))			(2.099.200)	(0,38)
Plusvalía latente sol	bre contratos de permutas financiera	s			3.435.946	0,63
Minusvalía latente s	obre contratos de permutas financier	ras			(4.993.959)	(0,91)
Otros activos y pasi	vos				30.678.533	5,59
Patrimonio					548.198.678	100.00

El Comisionista de futuros fue Morgan Stanley & Co., Inc.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Credit Suisse International, Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Natwest Markets Plc., Royal Bank of Canada, Standard Chartered Bank, State Street Bank & Trust y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc. y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley, Morgan Stanley & Co. International Plc. y Morgan Stanley & Co. LLC.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,98 %.

<sup>(</sup>a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.

<sup>(</sup>b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.

<sup>(</sup>c) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.

<sup>(</sup>d) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

<sup>(</sup>e) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

<sup>(</sup>f) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.

# Goldman Sachs Funds—Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado USD	% del patrimonio
Valores mobil	iarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial		•			
Bonos - 16,26						
Islas Caimán						
101.886	Noble Finance Co.	USD	11,000 %	15/02/2028	112.075	0,06
Francia	Allies France C.A. 444A(C)	HCD	E 10E 0/	45/07/2020	402 442	0.25
	Altice France S.A. 144A <sup>(c)</sup> Altice France S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,125 % 5,500 %	15/07/2029 15/10/2029	493.112 690.640	0,25 0,35
712.000	Affice France S.A. 144A(*)	030	3,300 %	15/10/2029		
					1.183.752	0,60
Alemania	ADLER Real Estate AG	EUR	2 000 %	27/04/2026	518.166	0.26
	ADLER Real Estate AG	EUK	3,000 %	27/04/2020	310.100	0,26
175.000	Royal Caribbean Cruises Ltd.	USD	5,250 %	15/11/2022	179.156	0,09
Luxemburgo	Toyal Sanssoan Grados La.		0,200 70	10,11,2022		
-	Herens Holdco SARL 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/05/2028	227.988	0,12
Países Bajos						
-	Ziggo Bond Co. BV 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,125 %	28/02/2030	302.250	0,15
245.000	Ziggo BV 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	15/01/2030	247.450	0,13
					549.700	0,28
Noruega						
•	Adevinta ASA	EUR	3,000 %	15/11/2027	292.689	0,15
Reino Unido	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		-,,,,,,			
	TransDigm UK Holdings Plc.	USD	6,875 %	15/05/2026	1.792.407	0,91
Estados Unidos	<u> </u>					
1.943.000		USD	5,125 %	15/03/2027	2.113.012	1,07
80.000	Asbury Automotive Group, Inc.	USD	4,500 %	01/03/2028	80.600	0,04
	Asbury Automotive Group, Inc.	USD	4,750 %	01/03/2030	50.188	0,03
1.252.000	Centene Corp.	USD	4,250 %	15/12/2027	1.301.917	0,66
1.260.000	Cheniere Energy Partners LP	USD	4,500 %	01/10/2029	1.324.575	0,67
	Cheniere Energy, Inc.	USD	4,625 %	15/10/2028	669.500	0,34
300.000	Dana, Inc.	USD	5,625 %	15/06/2028	317.625	0,16
265.000	Dana, Inc.	USD	4,250 %	01/09/2030	266.159	0,14
232.000	DISH DBS Corp.	USD	7,375 %	01/07/2028	227.215	0,12
735.000	DISH DBS Corp.	USD	5,125 %	01/06/2029	652.313	0,33
679.000	Encompass Health Corp.	USD	4,500 %	01/02/2028	684.093	0,35
1.139.000	Ford Motor Credit Co., LLC	USD	4,063 %	01/11/2024	1.191.813	0,61
	Ford Motor Credit Co., LLC	USD	4,687 %	09/06/2025	265.156	0,13
	Global Partners LP Via GLP Finance Corp.	USD	6,875 %	15/01/2029	430.500	0,22
	HCA, Inc.	USD	3,500 %	01/09/2030	693.680	0,35
	Hillenbrand, Inc.	USD	3,750 %	01/03/2031	384.138	0,20
	iHeartCommunications, Inc.	USD	6,375 %	01/05/2026	1.039.375	0,53
	Lumen Technologies, Inc. – Serie T	USD	5,800 %	15/03/2022	1.510.312	0,77
	Navient Corp.	USD	4,875 %	15/03/2028	680.340	0,35
	Navient Corp.	USD	5,500 %	15/03/2029	648.919	0,33
	Netflix, Inc.	USD	4,875 %	15/04/2028	395.063	0,20
	NuStar Logistics LP	USD	5,750 %	01/10/2025	433.575	0,22
	NuStar Logistics LP	USD	6,000 %	01/06/2026	636.000	0,32
	Occidental Petroleum Corp.	USD	8,000 %	15/07/2025	572.500	0,29
	Occidental Petroleum Corp.	USD	5,500 %	01/12/2025	368.900	0,19
	Occidental Petroleum Corp.	USD	6,625 %	01/09/2030	757.812	0,39
	Pactiv LLC	USD	8,375 %	15/04/2027	303.875	0,15
	Penske Automotive Group, Inc.	USD	3,750 %	15/06/2029	534.176	0,13
	Service Properties Trust	USD	7,500 %	15/09/2025	137.867	0,07
	Southwestern Energy Co.	USD	5,375 %	01/02/2029	528.988	0,27
	Southwestern Energy Co.	USD	5,375 %	15/03/2030	484.763	0,25
	Spirit AeroSystems, Inc.	USD	4,600 %	15/06/2028	700.087	0,36
	Targa Resources Partners LP Via Targa Resources Partners Finance Corp.	USD	4,875 %	01/02/2031	517.200	0,26
	TEGNA, Inc.	USD	5,000 %	15/09/2029	1.738.945	0,88
	Tenet Healthcare Corp.	USD	4,625 %	15/07/2024	356.876	0,18
	TK Elevator US Newco, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,250 %	15/07/2027	1.568.875	0,80
	TransDigm, Inc.	USD	5,500 %	15/11/2027	870.480	0,44
	TransDigm, Inc.	USD	4,625 %	15/01/2029	512.263	0,26
	TransDigm, Inc.	USD	4,875 %	01/05/2029	313.816	0,20
319.000						
	Tri Pointe Homes, Inc.	USD	5,250 %	01/06/2027	151.575	0,08

# Goldman Sachs Funds—Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

						Valor de	a
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo d	e interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	mercado USD	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)						
	s – (continuación)						
	United Wholesale Mortgage LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD		5,500 %	15/04/2029	417.600	0,2
168.000	Yum! Brands, Inc.	USD	_	3,625 %	15/03/2031	162.960	0,08
	NO.					27.123.997	13,79
(coste USD 31.						31.979.930	16,26
Tenencias	Descripción del valor					Valor de mercado en USD	% de
Acciones ord	inarias - 0,43 %						
Estados Unido							
37.260	Noble Corp.					842.076	0,43
TOTAL DE ACC	CIONES ORDINARIAS 3.060)					842.076	0,43
Fondos de in	versión – 0,00 %						
	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución	X) <sup>(d)(e)</sup>				2.209	0,00
TOTAL DE FON	NDOS DE INVERSIÓN 109)					2.209	0,00
TOTAL DE VAL	ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VALC 880.052)	RES O	FICIAL			32.824.215	16,69
				Tipo de		Valor de mercado	% de
Tenencias	Descripción del valor		Divisa	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>		patrimonio
Valores mobil Bonos – 71,88 Bermudas	liarios negociados en otro mercado regulado 5 %						
1.538.000	Nabors Industries Ltd. 144A <sup>(c)</sup>		USD	7,500 %	15/01/2028	1.345.750	0,68
	NCL Corp., Ltd. 144A <sup>(c)</sup>		USD	3,625 %	15/12/2024		0,10
	NCL Corp., Ltd. 144A <sup>(c)</sup>		USD	5,875 %	15/03/2026		0,0
356.000	NCL Finance Ltd. 144A <sup>(c)</sup>		USD	6,125 %	15/03/2028		0,18
						1.954.531	0,99
Canadá 991 000	1011778 BC ULC Via New Red Finance, Inc. 144A <sup>(c)</sup>		USD	4,375 %	15/01/2028	988.522	0,50
	1011778 BC ULC Via New Red Finance, Inc. 144A <sup>(c)</sup>		USD	4,000 %	15/10/2030		0,5
	Air Canada 144A <sup>(c)</sup>		USD	3,875 %	15/08/2026		0,31
1.075.000	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(c)</sup>		USD	5,500 %	01/11/2025	1.091.125	0,5
727.000	Brookfield Residential Properties, Inc. Via Brookfield Residential US LLC						
202 202	144A <sup>(c)</sup>		USD	4,875 %	15/02/2030		0,37
	GFL Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup> GFL Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup>		USD	3,500 %	01/09/2028		0,3
	Mattamy Group Corp. 144A <sup>(c)</sup>		USD	4,375 % 4,625 %	15/08/2029 01/03/2030		0,2° 0,48
	MEG Energy Corp. 144A <sup>(c)</sup>		USD	5,875 %	01/02/2029		0,14
	Open Text Corp. 144A <sup>(c)</sup>		USD	3,875 %	15/02/2028		0,2
	Open Text Corp. 144A <sup>(c)</sup>		USD	3,875 %	01/12/2029		0,2
						7.632.136	3,88
Islas Caimán							
	Avolon Holdings Funding Ltd. 144A <sup>(c)</sup>		USD	2,528 %	18/11/2027	66.351	0,03
	Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(c)</sup>		USD	6,500 %	15/09/2024		0,2
	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd. Via HawaiianMiles Loyalty Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	C)	USD	5,750 %	20/01/2026		0,24
	Transocean Poseidon Ltd. 144A <sup>(c)</sup>		USD	6,875 %	01/02/2027		0,09
	Transocean Proteus Ltd. 144A(c)		USD	6,250 %	01/12/2024		0,03
	Transocean Sentry Ltd. 144A(c)		USD	5,375 %	15/05/2023		0,54
950.000	Transocean, Inc. 144A <sup>(c)</sup>		USD	11,500 %	30/01/2027		0,46
Francis						3.229.810	1,64
875.000	Altice France S.A. 144A <sup>(c)</sup>		USD	5,125 %	15/01/2029	830.156	0,42

# Goldman Sachs Funds—Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos – (cont	tinuación)					
	Castlelake Aviation Finance DAC 144A(c)	USD	5,000 %	15/04/2027	366.300	0,19
480.000	Jazz Securities DAC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	15/01/2029	491.400	0,25
					857.700	0,44
Liberia						
	Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup> Royal Caribbean Cruises Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 % 5,500 %	01/07/2026 01/04/2028	670.631 472.800	0,34 0,24
400.000	Royal Calibbean Gruises Etc. 144A	OSD	3,300 /6	01/04/2020		0,58
Luxemburgo					1.143.431	0,56
-	Altice Financing S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	15/01/2028	1.193.850	0,61
2.380.000	Camelot Finance S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	01/11/2026	2.475.200	1,26
517.000	Nielsen Co. Luxembourg SARL 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	01/02/2025	524.884	0,26
					4.193.934	2,13
Países Bajos						
	Alcoa Nederland Holding BV 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/12/2027	350.212	0,18
150.000	Diamond BC BV 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	01/10/2029	147.563	0,07
					497.775	0,25
Panamá	Carried Carr 4444(C)	LIOD	7.605.0/	04/00/0000	200.050	0.00
	Carnival Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,625 %	01/03/2026	392.350	0,20
	Carnival Corp. 144A <sup>(c)</sup> Carnival Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,750 % 9,875 %	01/03/2027 01/08/2027	286.013 335.194	0,15 0,17
	Carnival Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,000 %	01/05/2029	553.612	0,17
0.0.000	ом. на объргати	002		0 1700/2020	1.567.169	0,80
Supranacional	as				1.007.100	0,00
•	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp. Via Atlas					
840.000	Luxco 4 SARL 144A <sup>(c)</sup> Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp. Via Atlas	USD	4,625 %	01/06/2028	194.500	0,10
	Luxco 4 SARL 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	01/06/2028	811.650	0,41
	American Airlines, Inc. Via AAdvantage Loyalty IP Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	20/04/2026	73.980	0,04
	American Airlines, Inc. Via AAdvantage Loyalty IP Ltd. 144A(c)	USD	5,750 %	20/04/2029	251.249	0,13
	Ardagh Packaging Finance Plc. Via Ardagh Holdings USA, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Axalta Coating Systems LLC Via Axalta Coating Systems Dutch Holding B	USD	5,250 %	15/08/2027	1.946.849	0,99
042.000	BV 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/06/2027	353.115	0,18
750.000	Titan Acquisition Ltd. Via Titan Co-Borrower LLC 144A(c)	USD	7,750 %	15/04/2026	750.937	0,38
					4.382.280	2,23
Reino Unido						
780.000	TechnipFMC Plc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,500 %	01/02/2026	838.500	0,43
Estados Unido						
	Acrisure LLC Via Acrisure Finance, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	15/02/2029	1.071.142	0,54
	Acrisure LLC Via Acrisure Finance, Inc. 144A <sup>(c)</sup> AdaptHealth LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,000 % 6,125 %	01/08/2029 01/08/2028	288.000 297.500	0,15 0,15
	Adapthealth LLC 144A(c)	USD	4,625 %	01/08/2029	112.413	0,13
	AdaptHealth LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,125 %	01/03/2030	228.850	0,12
	ADT Security Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	01/08/2029	1.012.050	0,51
1.029.000	Albertsons Cos., Inc. Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via Albertsons LLC $144A^{(c)}$	USD	4,625 %	15/01/2027	1.068.874	0,54
626.000	Albertsons Cos., Inc. Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via Albertsons LLC					
1 654 000	144A(c) Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Figures Corp. 144A(c)	USD	3,500 %	15/03/2029	622.870 1.707.755	0,32 0,87
	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup> Allison Transmission, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,625 % 3,750 %	15/07/2026 30/01/2031	333.025	0,87 0,17
	American Builders & Contractors Supply Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,750 %	15/11/2029	728.237	0,17
	API Escrow Corp. 144A(c)	USD	4,750 %	15/10/2029	160.336	0,08
	APi Group DE, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	15/07/2029	630.400	0,32
	APX Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,750 %	15/02/2027	473.769	0,24
	APX Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,750 %	15/07/2029	490.625	0,25
	Arches Buyer, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,125 %	01/12/2028	71.050	0,04
	Archrock Partners LP Via Archrock Partners Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,250 %	01/04/2028	823.052	0,42
	Arko Corp. 144A <sup>(c)</sup> Asbury Automotive Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,125 % 4,625 %	15/11/2029 15/11/2029	612.675 334.724	0,31 0,17
	Asbury Automotive Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	15/11/2029 15/02/2032	185.288	0,17
	Ashland LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,375 %	01/09/2031	744.375	0,03
	Ashton Woods USA LLC Via Ashton Woods Finance Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	01/04/2030	272.938	0,14
275.000						
	AssuredPartners, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,625 %	15/01/2029	77.800	0,04

# Goldman Sachs Funds—Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
•	s – (continuación)					
	Austin BidCo, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,125 %	15/12/2028	127.969	0,06
	Axalta Coating Systems LLC 144A(c)	USD	3,375 %	15/02/2029	454.812	0,23
	BCPE Empire Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,625 %	01/05/2027	802.000	0,41
	Booz Allen Hamilton, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Booz Allen Hamilton, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	3,875 % 4,000 %	01/09/2028 01/07/2029	738.587 202.005	0,38 0,10
	Boyd Gaming Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,625 %	01/06/2025	233.509	0,10
	Boyd Gaming Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/06/2031	636.587	0,32
320.000	Boyne USA, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/05/2029	324.600	0,16
	BWX Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	15/04/2029	527.315	0,27
	Cable One, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	15/11/2030	732.375	0,37
	Cablevision Lightpath LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	3,875 % 4,625 %	15/09/2027	406.575	0,21
	Caesars Entertainment, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Caesars Resort Collection LLC Via CRC Finco, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,750 %	15/10/2029 01/07/2025	681.100 310.365	0,35 0,16
	California Resources Corp. 144A(c)	USD	7,125 %	01/02/2026	582.400	0,30
	Calpine Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,750 %	01/03/2031	879.544	0,45
691.000	Cargo Aircraft Management, Inc. 144A(c)	USD	4,750 %	01/02/2028	702.229	0,36
	Carvana Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/04/2027	165.825	0,08
	Carvana Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,875 %	01/10/2028	496.237	0,25
	Carvana Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	01/09/2029	740.125	0,38
	Castle US Holding Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	9,500 %	15/02/2028	119.000 546.972	0,06
	CCO Holdings LLC Via CCO Holdings Capital Corp. 144A <sup>(c)</sup> CCO Holdings LLC Via CCO Holdings Capital Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	4,000 % 4,750 %	01/03/2023 01/03/2030	2.724.319	0,28 1,39
	CCO Holdings LLC Via CCO Holdings Capital Corp. 144A(c)	USD	4,750 %	01/02/2031	719.962	0,37
	Century Communities, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	15/08/2029	734.756	0,37
	Chemours Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,750 %	15/11/2028	500.762	0,25
745.000	Chemours Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	15/11/2029	724.512	0,37
460.000	Clarivate Science Holdings Corp. 144A(c)	USD	3,875 %	01/07/2028	454.250	0,23
	Clarivate Science Holdings Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	01/07/2029	613.655	0,31
	Clearwater Paper Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/08/2028	222.475	0,11
	Clearway Energy Operating LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/03/2028	434.119	0,22
	Cleveland-Cliffs, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Cleveland-Cliffs, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	6,750 % 4,625 %	15/03/2026 01/03/2029	473.062 467.325	0,24 0,24
	CNX Resources Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,250 %	14/03/2027	729.937	0,24
	CNX Resources Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,000 %	15/01/2029	266.500	0,14
	Coinbase Global, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,375 %	01/10/2028	472.806	0,24
445.000	CP Atlas Buyer, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,000 %	01/12/2028	431.650	0,22
	CQP Holdco LP Via BIP-V Chinook Holdco LLC 144A(c)	USD	5,500 %	15/06/2031	1.035.300	0,53
	CrownRock LP Via CrownRock Finance, Inc. "F" 144A(c)	USD	5,625 %	15/10/2025	1.600.809	0,81
	CrownRock LP Via CrownRock Finance, Inc. "F" 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	01/05/2029	282.800	0,14
	CSC Holdings LLC 144A <sup>(c)</sup> CSC Holdings LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	5,750 % 4,625 %	15/01/2030 01/12/2030	989.377 758.695	0,50 0,39
	CSC Holdings LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	15/11/2031	966.250	0,39
	Cumulus Media New Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,750 %	01/07/2026	559.886	0,28
	DaVita, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,750 %	15/02/2031	624.775	0,32
	Dealer Tire LLC Via DT Issuer LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,000 %	01/02/2028	453.050	0,23
585.000	DISH DBS Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,250 %	01/12/2026	582.075	0,30
	DT Midstream, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	15/06/2031	1.036.941	0,53
	Endure Digital, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,000 %	15/02/2029	292.433	0,15
	Energizer Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup> EQT Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	4,375 %	31/03/2029	492.469 847.637	0,25 0,43
	Fair Isaac Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,625 % 4,000 %	15/05/2031 15/06/2028	295.738	0,43 0,15
	Flex Acquisition Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,875 %	15/07/2026	1.302.208	0,13
	Freedom Mortgage Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,625 %	01/05/2026	386.000	0,20
	Freedom Mortgage Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,625 %	15/01/2027	423.000	0,22
170.000	Gap, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,625 %	01/10/2029	163.625	0,08
	Gap, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	01/10/2031	163.625	0,08
	GCI LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/10/2028	667.659	0,34
	Glatfelter Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/11/2029	465.750	0,24
	Global Infrastructure Solutions, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,625 %	01/06/2029	703.687	0,36
	Go Daddy Operating Co., LLC Via GD Finance Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup> Gray Escrow II, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	3,500 % 5,375 %	01/03/2029 15/11/2031	788.980 668.325	0,40 0,34
	Gray Television, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/10/2030	512.160	0,26
	Group 1 Automotive, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	15/08/2028	342.540	0,17
	GrubHub Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	01/07/2027	2.085.750	1,06
	Hess Midstream Operations LP 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	15/02/2030	253.175	0,13
665.000	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC Via Hilton Grand Vacations					
654.000	Borrower Escrow 144A(c) Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC Via Hilton Grand Vacations	USD	5,000 %	01/06/2029	661.675	0,34
1 026 000	Borrower Escrow 144A <sup>(c)</sup> HLF Financing SARL LLC Via Herbalife International, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	4,875 %	01/07/2031	650.730	0,33
	Howard Hughes Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 % 4,125 %	01/06/2029 01/02/2029	970.852 394.518	0,49 0,20
390.000	nomala nagrico Corp. 1777	090	7,123 70	0 1/02/2029	JJ4.J 10	0,20

# Goldman Sachs Funds—Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Benome   Continuación	Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
388.000   Howard Hughers Corp. 144APA   9.00   4.375 %   0.100/20201   394-518   0.20   1.520.000   Hugher Service Corp. 144APA   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.500   1.	Bonos - (con	tinuación)					
1.555.000 HUBI International Ltd. 144APi	Estados Unido	s – (continuación)					
585.000   Ingenity Corp. 144AP		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					
471.000   Riel Holding Corp. 1444A <sup>(1)</sup>   USD   7,000 %   15000/2025   498.000   0.26   586.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.000   386.00							
Section   Street Group Val JSC Filance, Inc. 144A <sup>(A)</sup>							
## 48500 Ken Garf Automarke LLC 144A <sup>(c)</sup> ## 58600 LABL, Inc. 144A							
Beatoo  LARII, Inc. 144A <sup>(A)</sup>							
95.000   LARL, Inc. 144A <sup>(A)</sup>							
335.00   LD Holdings Group LLC 144A/PI					01/11/2028		
335.000 LD Holdings Group LLC 144A <sup>(c)</sup>	720.000	LCM Investments Holdings II LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	01/05/2029	725.400	0,37
A25000   Level 3 Financing, Inc. 144AP0	335.000	LD Holdings Group LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,500 %	01/11/2025	324.950	0,17
240.000   Level 3 Financing, Inc. 144A <sup>(5)</sup>		• .					
355.00   LG   Homes, Inc. 144A <sup>(c)</sup>		<b>3</b> .					
400.00 Lilmis Motors, inc. 144A <sup>(c)</sup>							
120.000 Lihis Motins, Inc. 144A <sup>(A)</sup>							
830000 LogMeIn, Inc. 144A <sup>(A)</sup>							
365,000   MajerDriver Holdings IV LLC 144A <sup>(A)</sup>   USD   5.000 %   15/12/2027   593,126   0.30							
## 433.000 Match Group Holdings II LLC 144A/61 ## 430.000 Mauser Packaging Solutions Holding Co. 144A/61 ## 430.000 Mauser Packaging Solutions Holding May Co. 144A/61 ## 430.000 Mauser Packaging Solutions Holding May Co. 144A/61 ## 430.000 Mauser Packaging Solutions Holding May Co. 144A/61 ## 430.000 Mauser Packaging Solutions Holding May Co. 144A/61 ## 430.000 Mauser Packaging Solutions Holding May Co. 144A/61 ## 430.000 Mauser Packaging Solutions Holding May Co. 144A/61 ## 430.000 Mauser Packaging Solutions Holding May Co. 144A/61 ## 430.000 Mauser Packaging Solutions Holding May Co. 144A/61 ## 430.000 Mazer Death Merger Sulp. Inc. 144A/61 ## 430.0000 Mazer Death Merger Sulp. Inc. 144A/61							
497.000 Match Group Holdings II LLC 144A <sup>(6)</sup> USD 6,625 % 10108/2028 430,403 0,.22 1.110.000 Match Group Holdings II LLC 144A <sup>(6)</sup> USD 6,525 % 1018/2020 31,107,225 0,56 333.000 Match Group Holdings II LLC 144A <sup>(6)</sup> USD 6,500 % 1018/2020 31,107,225 0,56 341,000 Meritor, Inc. 144A <sup>(6)</sup> USD 6,250 % 1018/2020 355,335 0,68 321,000 Meritor, Inc. 144A <sup>(6)</sup> USD 6,250 % 1018/2022 355,345 0,18 12,200 Meritor, Inc. 144A <sup>(6)</sup> USD 6,250 % 1018/2022 355,345 0,18 12,200 Meritor, Inc. 144A <sup>(6)</sup> USD 6,250 % 1018/2022 356,345 0,18 12,200 Meritor, Inc. 144A <sup>(6)</sup> USD 6,250 % 1018/2022 356,345 0,18 12,200 Metap Financial Issuer Trast 144A <sup>(6)</sup> USD 6,500 % 1018/2022 356,945 0,18 12,200 Metap Financial Issuer Trast 144A <sup>(6)</sup> USD 6,500 % 1018/2022 356,945 0,18 12,200 Metap Financial Issuer Trast 144A <sup>(6)</sup> USD 6,500 % 1018/2022 356,945 0,18 12,200 Metap Financial Issuer Trast 144A <sup>(6)</sup> USD 6,500 % 1018/2022 356,945 0,18 12,200 Metap Financial Issuer Trast 144A <sup>(6)</sup> USD 6,500 % 1018/2022 356,945 0,18 12,200 Metap Financial Issuer Trast 144A <sup>(6)</sup> USD 6,500 % 1018/2022 356,945 0,18 12,200 Metap Financial Issuer Trast 144A <sup>(6)</sup> USD 6,500 % 1018/2022 366,984 0,18 12,200 Metap Financial Issuer Trast 144A <sup>(6)</sup> USD 6,500 % 1018/2022 366,984 0,18 12,200 Metap Financial Issuer Trast 144A <sup>(6)</sup> USD 6,500 % 1018/2022 348,201 0,10 144A <sup>(6)</sup> USD 6,500 % 1018/2023 364,000 Metap Financial Issuer Trast 144A <sup>(6)</sup> USD 6,500 % 1018/2023 31,300 0,10 144A <sup>(6)</sup> USD 6,500 % 1018/2023 31,300 0,10 144A <sup>(6)</sup> USD 6,500 % 1018/2023 31,10 0,10 144A <sup>(6)</sup> USD 6,500 % 1018/2023 32,200 0,16 45,000 Metal Metap Financial LC Via Nielsen Financial Co. 144A <sup>(6)</sup> USD 6,875 % 1018/2023 31,30 6,13 0,73 Metap Financial LC Via Nielsen Financial Co. 144A <sup>(6)</sup> USD 6,875 % 1018/2023 31,30 6,13 0,73 Metap Financial LC Via Nielsen Financial Co. 144A <sup>(6)</sup> USD 6,875 % 1018/20							
1.110.000 Match Group Holdings II LLC 144A <sup>(G)</sup> USD 6.250 % 101042024 383.332 0.68 383.000 Moritor, Inc. 144A <sup>(G)</sup> USD 6.250 % 101042025 356.345 0.18 129.000 Motel Memper Sub ILC 144A <sup>(G)</sup> USD 6.250 % 101052029 126.581 0.06 335.000 MGM Growth Properties Operating Partnership LP Via MGP Finance Co-Issuer, Inc. 144A <sup>(G)</sup> USD 6.500 % 101052028 536.345 0.18 639.000 Miccap Financial Issuer Trust 144A <sup>(G)</sup> USD 6.500 % 101052028 651.381 0.33 200.000 Miccap Financial Issuer Trust 144A <sup>(G)</sup> USD 6.500 % 101052028 651.381 0.33 200.000 Miccap Financial Issuer Trust 144A <sup>(G)</sup> USD 6.500 % 101052028 651.381 0.33 200.000 Miccap Financial Issuer Trust 144A <sup>(G)</sup> USD 6.500 % 101052028 651.381 0.33 200.000 Miccap Financial Issuer Trust 144A <sup>(G)</sup> USD 6.500 % 101052028 651.381 0.33 200.000 Miccap Financial Issuer Trust 144A <sup>(G)</sup> USD 6.500 % 101052028 651.381 0.33 200.000 Miccap Financial Issuer Trust 144A <sup>(G)</sup> USD 6.500 % 101052028 180.500 0.10 20000 Miccap Financial Issuer Trust 144A <sup>(G)</sup> USD 6.500 % 101052029 1.384.371 0.20 20100 Miccap Financial Issuer Trust 144A <sup>(G)</sup> USD 5.750 % 101102029 1.387.087 0.71 20100 MPH Acquisition Holdings LLC 144A <sup>(G)</sup> USD 5.750 % 101102029 1.387.087 0.71 20100 Micrap Financial Issuer Trust 144A <sup>(G)</sup> USD 5.750 % 101102029 1.384.080 0.33 20100 Micrap Financial Issuer Trust 144A <sup>(G)</sup> USD 5.750 % 101102029 1.384.095 0.22 20100 Microstar Mortagoge Holdings, Inc. 144A <sup>(G)</sup> USD 5.000 % 15052023 130 0.01 20100 Microstar Mortagoge Holdings, Inc. 144A <sup>(G)</sup> USD 5.625 % 15072021 1.140.880 0.38 20100 Nesstar Media, Inc. 144A <sup>(G)</sup> USD 5.625 % 15072021 1.140.880 0.38 20100 Nesstar Media, Inc. 144A <sup>(G)</sup> USD 5.625 % 15072021 1.140.880 0.38 20100 Nesstar Media, Inc. 144A <sup>(G)</sup> USD 5.625 % 15072021 1.140.880 0.38 20100 Nesstar Media, Inc. 144A <sup>(G)</sup> USD 5.625 % 15072021 1.140.880 0.38 20100 Nesstar Media, Inc. 144A <sup>(G)</sup> USD 6.525 % 15072021 1.140.880 0.38 20100 Nesstar Media, Inc. 144A <sup>(G)</sup> USD 6.525 % 15072021 1.140.880 0.38 20100 Nesstar Media (Inc. 144A <sup>(G)</sup> USD 6.525 % 15072022 150.000 0.16 201000 Nesstar Media (In			USD	4,625 %	01/06/2028	430.403	0,22
933.000 Mauser Packaging Solutions Holding Co. 144A <sup>(c)</sup> 341.000 Metro, Inc. 144A <sup>(c)</sup> 342.000 Metro, Inc. 144A <sup>(c)</sup> 345.000 Metro, Metro, Inc. 144A <sup>(c)</sup> 345.000 Miccap Financial Issuer Trust 144A <sup>(c)</sup> 346.000 Miccap Financial Issuer Trust 144A <sup>(c)</sup> 347.000 Miccap Financial Issuer Trust 144A <sup>(c)</sup> 347.000 Miccap Financial Issuer Trust 144A <sup>(c)</sup> 348.000 Miccap Financial Issuer Trust 144A <sup>(c)</sup> 348.000 Miccap Financial Issuer Trust 144A <sup>(c)</sup> 348.000 Miccap Financial Issuer Trust 144A <sup>(c)</sup> 349.000 Miccap Financial Issuer Trust 144A <sup>(c)</sup> 349.000 Micrap Financial Issuer Trust 144A <sup>(c)</sup> 340.000 Micrap Financial Is	497.000	Match Group Holdings II LLC 144A(c)	USD	5,625 %	15/02/2029	536.760	0,27
341,000 Mentor, Inc. 144A ©   USD   6,250 %   0,106/2025   356,345   0,18	1.110.000	Match Group Holdings II LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	01/08/2030	1.107.225	0,56
129.000   Metis Merger Sub LLC 144A(A)							
35.000 MGM Growth Properties Operating Partnership LP Via MGP Finance Co-Issuer, Int. 144A <sup>(c)</sup> USD 6,500 % 01/05/2028 651.381 0.33 0.30 0.00 Midcap Financial Issuer Trust 144A <sup>(c)</sup> USD 5,625 % 15/01/2030 189.50 0.01 0.03 0.00 0.00 0.00 0.00 0.00 0.0		•					
Co-Issuer, Inc. 144A <sup>(c)</sup> 639.000 Midicap Financial Issuer Trust 144A <sup>(c)</sup> 839.000 Midicap Financial Issuer Trust 144A <sup>(c)</sup> 839.000 Midicap Financial Issuer Trust 144A <sup>(c)</sup> 839.000 Midicap Financial Issuer Trust 144A <sup>(c)</sup> 849.000 Midicap Financial Issuer Trust 144A <sup>(c)</sup> 849.000 Mozarl Debt Merger Sub, Inc. 144A <sup>(c)</sup> 849.000 Murphy Oil USA, Inc. 144A <sup>(c)</sup> 849.000 Murphy Oil USA, Inc. 144A <sup>(c)</sup> 849.000 Nurphy Oil USA, Inc. 144A <sup>(c)</sup> 849.000 Nurphy Oil USA, Inc. 144A <sup>(c)</sup> 849.000 Neithin, Inc. 144A <sup>(c)</sup> 849.000 Neit		· ·	USD	6,500 %	15/05/2029	126.581	0,06
639 000   Mickap Financial Issuer Trust 144A(**)	335.000		Hen	4 625 0/	15/06/2025	256 004	0.10
200.000   Microp Pirancial Issuer Trust 144A  6    USD   6,500 %   1501/2030   189,500   0,10	639 000						
Mileage Plus Holdings LLC Via Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd.   144A(°)		•					
144A(a) 1410.00 Mozart Debt Merger Sub, Inc. 144A(a) 1410.00 Nabros industries, Inc. 144A(a) 1410.00 Nabros industries, Inc. 144A(a) 1410.00 Nabros industries, Inc. 144A(a) 1410.00 Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 144A(a) 1410.00 Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 144A(a) 1410.00 Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 144A(a) 1410.00 Nettla, Inc. 144A(a) 1410.00 Nextlar Media, Inc. 144A(a) 1410.00 NEF Corp. 144A(a) 1410.00 NEG Energy Operating LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(a) 1410.00 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(a) 1410.00 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(a) 1410.00 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(a) 1410.00 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(a) 1410.00 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(a) 1410.00 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(a) 1410.00 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(a) 1410.00 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(a) 1410.00 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(a) 1410.00 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(a) 1410.00 Nielsen Finance		•	OOD	0,020 70	10/01/2000	100.000	0,10
95.000 Mozart Debt Meriger Sub, Inc. 144A(c) 1050 Murphy Oil USA, Inc. 144			USD	6,500 %	20/06/2027	384.371	0,20
370,000 MPH Acquisition Flodings LLC 144A( <sup>(c)</sup> USD 5,750 % 15/02/2031 101,456 0,055 445,000 Nators industries, inc. 144A( <sup>(c)</sup> USD 7,375 % 15/05/2027 443,888 0,23 394,000 Nationstar Mortgage Holdings, inc. 144A( <sup>(c)</sup> USD 5,500 % 15/08/2028 394,985 0,20 135,000 Nationstar Mortgage Holdings, inc. 144A( <sup>(c)</sup> USD 5,500 % 15/08/2028 394,985 0,20 136,000 Nationstar Mortgage Holdings, inc. 144A( <sup>(c)</sup> USD 5,125 % 15/12/2030 130,613 0,07 408,000 Netfills, inc. 144A( <sup>(c)</sup> USD 5,256 % 15/08/2028 429,675 0,22 13,97 000 Nexstar Media, inc. 144A( <sup>(c)</sup> USD 5,525 % 15/08/2027 1,140,800 0,58 320,000 Nexstar Media, inc. 144A( <sup>(c)</sup> USD 5,525 % 15/08/2027 1,140,800 0,58 320,000 Nexstar Media, inc. 144A( <sup>(c)</sup> USD 4,755 % 15/08/2028 429,675 0,35 724,000 NPF Corp. 144A( <sup>(c)</sup> USD 6,875 % 15/08/2028 718,577 0,35 74,000 NPF Corp. 144A( <sup>(c)</sup> USD 6,875 % 15/08/2028 718,577 0,35 74,000 Niesen Finance LLC Via Nielsen Finance Cor 144A( <sup>(c)</sup> USD 7,500 % 01/02/2026 744,625 0,38 42,000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co 144A( <sup>(c)</sup> USD 5,625 % 11/10/2028 457,470 0,23 170,000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co 144A( <sup>(c)</sup> USD 5,625 % 11/10/2028 457,470 0,23 170,000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co 144A( <sup>(c)</sup> USD 5,625 % 11/10/2029 457,470 0,23 170,000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co 144A( <sup>(c)</sup> USD 4,500 % 15/07/2029 155,130 0,08 11/10/2029 155,130 Nielsen Finance Co 144A( <sup>(c)</sup> USD 1,450 % 15/07/2029 155,130 0,08 11/10/2029 150,130 0,08 11/10/2029 150,130 0,08 11/10/2029 150,130 0,08 11/10/2029 150,130 0,08 11/10/2029 150,130 0,08 11/10/2029 150,130 0,08 11/10/2029 150,130 0,08 11/10/2029 150,130 0,08 11/10/2029 150,130 0,08 11/10/2029 150,130 0,09 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,	1.410.000	Mozart Debt Merger Sub, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	01/04/2029	1.387.087	0,71
105.000   Murphy (Öi LUSA, Inc. 144A(°)   USD 3,750 %   15(0)22031   101.456   0.05	95.000	Mozart Debt Merger Sub, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,250 %	01/10/2029	94.525	0,05
445,000   Nabors Industries, Inc. 144A(c)   USD   7,375 %   15/08/2027   443,888   0.23   394,000   Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 144A(c)   USD   5,125 %   15/08/2028   394,985   0.20   135,000   Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 144A(c)   USD   3,625 %   15/07/2027   1.140,880   0.58   15/08/2028   429,675   0.22   1.097/000   Nexstar Media, Inc. 144A(c)   USD   3,625 %   15/07/2027   1.140,880   0.58   320,000   Nexstar Media, Inc. 144A(c)   USD   5,625 %   15/07/2027   1.140,880   0.58   320,000   Nexstar Media, Inc. 144A(c)   USD   4,750 %   0.1/11/2028   322,000   0.16   695,000   NFP Corp. 144A(c)   USD   4,750 %   0.1/11/2028   322,000   0.16   695,000   NFP Corp. 144A(c)   USD   4,875 %   15/08/2028   645,75   0.37   740,000   NFP Corp. 144A(c)   USD   6,875 %   15/08/2028   718,570   0.37   740,000   NGL Energy Operating LLC Via NGL Energy Finance Corp. 144A(c)   USD   5,625 %   0.1/10/2028   774,70   0.37   740,000   Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(c)   USD   5,625 %   0.1/10/2028   474,70   0.23   170,000   Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(c)   USD   4,500 %   15/07/2029   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,113   0.08   12/07/2039   165,							
394,000 Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nextsar Media, Inc. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nexstar Media, Inc. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 NESTAR Media, Inc. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 NFP Corp. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> 135.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Fi							
135.000   Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 144A(c)							
408.000   Netfitx, Inc. 144A <sup>(c)</sup>   USD   3,625 %   15/06/2025   429.675   0.22							
1.097.000   Nexstar Media, Inc. 144A <sup>(c)</sup>   USD   5,625 %   15/07/2027   1.140.880   0.58   320.000   Nexstar Media, Inc. 144A <sup>(c)</sup>   USD   4,750 %   01/11/2028   322.000   0,16   695.000   NFP Corp. 144A <sup>(c)</sup>   USD   4,875 %   15/08/2028   718.575   0.35   724.000   NFP Corp. 144A <sup>(c)</sup>   USD   6,875 %   15/08/2028   718.570   0.37   740.000   NFP Corp. 144A <sup>(c)</sup>   USD   6,875 %   15/08/2028   718.570   0.37   740.000   NGL Energy Operating LLC Via NGL Energy Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>   USD   5,625 %   01/10/2026   744.8625   0.38   442.000   Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup>   USD   5,625 %   01/10/2026   744.8625   0.38   442.000   Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup>   USD   4,750 %   15/07/2029   165.113   0.08   210.000   Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup>   USD   4,750 %   15/07/2029   165.113   0.08   210.000   Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup>   USD   3,375 %   15/02/2029   152.290   0.08   419.000   NRG Energy, Inc. 144A <sup>(c)</sup>   USD   3,625 %   15/02/2029   152.290   0.08   419.000   NRG Energy, Inc. 144A <sup>(c)</sup>   USD   3,625 %   15/02/2031   399.098   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20   0.20							
320,000   Nextar Media, Inc. 144A(°)   USD   4,750 %   11/11/2028   322,000   0.16							
865.000 NFP Corp. 144A(c)							
740.000 NGL Energy Operating LLC Via NGL Energy Finance Corp. 144A(c) USD 7,500 % 01/02/2026 744.625 0,38 442.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(c) USD 5,625 % 01/10/2028 457.470 0,23 170.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(c) USD 4,500 % 15/07/2029 165.113 0,08 210.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(c) USD 4,750 % 15/07/2031 204.225 0,10 157.000 NRG Energy, Inc. 144A(c) USD 3,375 % 15/02/2029 152.290 0,08 149.000 NRG Energy, Inc. 144A(c) USD 3,375 % 15/02/2031 399.098 0,20 0,08 NRG Energy, Inc. 144A(c) USD 3,375 % 15/02/2031 399.098 0,20 0,08 NRG Energy, Inc. 144A(c) USD 4,125 % 30/04/2028 303.475 0,15 800.000 Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A(c) USD 4,125 % 30/04/2031 816.000 0,41 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) USD 5,125 % 30/04/2031 816.000 0,41 150.000 Outfront Media Capital LC Orp. 144A(c) USD 6,250 % 15/03/2030 494.2 645 0,48 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) USD 4,250 % 15/03/2030 494.2 645 0,48 150.000 Pactiv Evergreen Group Issuer LLC Via Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. 144A(c) USD 4,250 % 15/03/2030 494.2 645 0,48 150.000 Performance Food Group, Inc. 144A(c) USD 4,250 % 15/09/2031 570.360 0,29 320.000 Performance Food Group, Inc. 144A(c) USD 4,250 % 15/09/2031 570.360 0,29 320.000 Performance Food Group, Inc. 144A(c) USD 4,250 % 15/09/2031 570.360 0,29 320.000 Performance Food Group, Inc. 144A(c) USD 4,750 % 15/09/2028 252.188 0,13 340.000 Pike Corp. 144A(c) USD 5,750 % 15/09/2028 252.188 0,13 340.000 Pike Corp. 144A(c) USD 5,750 % 15/09/2028 306.233 0,16 476.000 Prestige Brands, Inc. 144A(c) USD 5,750 % 15/07/2026 306.233 0,16 476.000 Prestige Brands, Inc. 144A(c) USD 5,750 % 15/07/2026 306.233 0,16 476.000 Prestige Brands, Inc. 144A(c) USD 5,750 % 15/07/2026 306.233 0,16 476.000 Prestige Brands, Inc. 144A(c) USD 5,750 % 15/07/2025 101.676 0,05 345.000 Prestige Brands, Inc. 144A(c) USD 5,750 % 15/07/2025 101.676 0,05 109.000 Realey Grou							
442.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(c) 170.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(c) 180 4,500 % 15/07/2029 165.113 0,08 15/07/2021 204.225 0,10 157.000 NRG Energy, Inc. 144A(c) 180 3,375 % 15/02/2029 152.290 0,08 15/03/2031 399.098 0,20 305.000 Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A(c) 180 0.000 Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A(c) 180 0.000 Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A(c) 180 0.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 180 0.001 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 180 0.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 180 0.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 180 0.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 180 0.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 180 0.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 180 0.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 180 0.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 180 0.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 180 0.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 180 0.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 180 0.000 Outfront	724.000	NFP Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,875 %	15/08/2028	718.570	0,37
170.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> USD 4,500 % 15/07/2029 165.113 0,08 210.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A <sup>(c)</sup> USD 4,750 % 15/07/2031 204.225 0,10 175.000 NRG Energy, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,375 % 15/02/2029 152.290 0,08 419.000 NRG Energy, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,625 % 15/02/2029 152.290 0,08 419.000 NRG Energy, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,625 % 15/02/2031 399.098 0,20 305.000 Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A <sup>(c)</sup> USD 4,125 % 30/04/2028 303.475 0,15 800.000 Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A <sup>(c)</sup> USD 5,125 % 30/04/2031 816.000 0,41 150.000 Outfront Media Capital LCV Via Outfront Media Capital Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 6,250 % 15/06/2025 156.094 0,08 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 4,250 % 15/01/2029 145.875 0,07 957.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 4,625 % 15/03/2030 942.645 0,48 560.000 Pactive Evergreen Group Issuer LLC Via Pactive Evergreen Group Issuer Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 4,250 % 15/09/2031 570.360 0,29 320.000 Performance Food Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 4,250 % 15/09/2031 570.360 0,29 320.000 PetSmart, Inc. Via PetSmart Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 4,250 % 15/09/2031 570.360 0,29 320.000 PetSmart, Inc. Via PetSmart Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,500 % 15/09/2028 252.188 0,13 340.000 Pike Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,500 % 01/09/2028 849.450 0,43 340.000 Pike Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,125 % 15/01/2028 306.233 0,16 476.000 Prestige Brands, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,750 % 01/04/2031 330.122 0,17 360.000 Qorvo, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,750 % 01/04/2031 330.122 0,17 360.000 Real Herto Merger Sub 2, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,750 % 01/04/2031 330.122 0,17 360.000 Real Herto Merger Sub 2, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,625 % 15/07/2026 39.5475 0,05 95.000 Real Herto Merger Sub 2, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,875 % 01/06/2029 95.475 0,05 95.000 Realed Energy Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 6,250 % 01/06/2029 15.250 0,11 150.000 Realed Energy Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 6,250 % 01/06/2029 15.250 0,11	740.000	NGL Energy Operating LLC Via NGL Energy Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,500 %	01/02/2026	744.625	0,38
210.000 Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(c) 157.000 NRG Energy, Inc. 144A(c) 157.000 Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A(c) 157.000 Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A(c) 157.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 157.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 157.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 157.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 157.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 157.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 157.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 157.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 157.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 157.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 157.000 PennyMac Financial Services, Inc. 144A(c) 157.000 PennyMac Financial Services, Inc. 144A(c) 157.000 PennyMac Financial Services, Inc. 144A(c) 157.000 Performance Food Group, Inc. 144A(c) 157.000 Prestige Brands, Inc. 144A(c) 157.000 Real Hero Merger Sub 2, Inc. 144A(c) 157.000 Real Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp. 144A(c) 157.000 Real Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp. 144A(c) 157.000 Real Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp.				5,625 %		457.470	0,23
157.000 NRG Energy, Inc. 144A(c) 419.000 Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A(c) 419.000 Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A(c) 410.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 410.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 410.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 410.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 410.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 410.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 410.000 Pactiv Evergreen Group Issuer LLC Via Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. 144A(c) 410.000 Pactiv Evergreen Group Issuer LLC Via Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. 144A(c) 410.000 Performance Food Group, Inc. 144A(c) 410.000 Pike Corp. 144A(c) 410.000 Pike Gorp. 144A(c) 410.000 Pike Gorp							
419.000 NRG Energy, Inc. 144A(c) 305.000 Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A(c) 305.000 Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A(c) 305.000 Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A(c) 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 150.000 Pactiv Evergreen Group Issuer LLC Via Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. 144A(c) 150.000 Pactiv Evergreen Group Issuer LLC Via Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. 144A(c) 150.000 Petformance Food Group, Inc. 144A(c) 150.000 Petforman							
305.000 Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A(c) 800.000 Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A(c) 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 150.000 Pactiv Evergreen Group Issuer LLC Via Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. 144A(c) 150.000 Pactiv Evergreen Group Issuer LLC Via Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. 144A(c) 150.000 PennyMac Financial Services, Inc. 144A(c) 150.000 PennyMac Financial Services, Inc. 144A(c) 150.000 Petformance Food Group, Inc. 144A(c) 150.000 Petformance Food Group, Inc. 144A(c) 150.000 Pike Corp. 144A(c) 150.000 Pike Corp. 144A(c) 150.000 Pike Corp. 144A(c) 150.000 Pike Corp. 144A(c) 150.000 Prestige Brands, Inc. 144A(c) 150.000 Prestige Brands, I							
800.000 Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A(c) 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 150.000 Pactiv Evergreen Group Issuer LLC Via Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. 144A(c) 150.000 Pactiv Evergreen Group Issuer LLC Via Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. 144A(c) 150.000 Pactiv Evergreen Group Issuer LLC Via Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. 144A(c) 150.000 Pactiv Evergreen Group Issuer LLC Via Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. 144A(c) 150.000 Performance Food Group, Inc. 144A(c) 150.000 Performance Food Group, Inc. 144A(c) 150.000 Performance Food Group, Inc. 144A(c) 150.000 Petsmart, Inc. Via Petsmart Finance Corp. 144A(c) 150.000 Petsmart, Inc. Via Petsmart Finance Corp. 144A(c) 150.000 Pike Pike Pike Pike Pike Pike Pike Pike		4.					
150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) USD 6,250 % 15/06/2025 156.094 0,08 150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) USD 4,250 % 15/01/2029 145.875 0,07 957.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) USD 4,625 % 15/03/2030 942.645 0,48 560.000 Pactiv Evergreen Group Issuer LLC Via Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. 144A(c) USD 4,375 % 15/10/2028 547.400 0,28 588.000 PennyMac Financial Services, Inc. 144A(c) USD 5,750 % 15/09/2031 570.360 0,29 320.000 PetSmart, Inc. Via PetSmart Finance Corp. 144A(c) USD 4,250 % 01/08/2029 311.200 0,16 250.000 PetSmart, Inc. Via PetSmart Finance Corp. 144A(c) USD 4,750 % 15/02/2028 252.188 0,13 840.000 Pike Corp. 144A(c) USD 5,500 % 01/09/2028 849.450 0,43 307.000 PRA Health Sciences, Inc. 144A(c) USD 5,500 % 01/09/2028 849.450 0,43 307.000 Prestige Brands, Inc. 144A(c) USD 5,750 % 15/07/2026 306.233 0,16 476.000 Prestige Brands, Inc. 144A(c) USD 5,750 % 15/07/2028 495.040 0,25 345.000 Prestige Brands, Inc. 144A(c) USD 3,750 % 01/04/2031 330.122 0,17 360.000 Qorvo, Inc. 144A(c) USD 3,750 % 01/04/2031 330.122 0,17 360.000 Qorvo, Inc. 144A(c) USD 3,750 % 01/04/2031 363.600 0,18 98.000 Rattler Midstream LP 144A(c) USD 5,625 % 15/07/2025 101.676 0,05 95.000 Real Hero Merger Sub 2, Inc. 144A(c) USD 7,625 % 15/07/2025 179.563 0,09 210.000 Reevable Energy Group, Inc. 144A(c) USD 7,625 % 15/06/2025 179.563 0,09 210.000 Reevable Energy Group, Inc. 144A(c) USD 5,875 % 01/06/2028 215.250 0,11 316.000 Reynolds Group Issuer, Inc. Via Reynolds Group Issuer LLC Via Reynolds Group Is							
150.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 957.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 957.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 957.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) 958.000 Pactiv Evergreen Group Issuer LLC Via Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. 144A(c) 958.000 PennyMac Financial Services, Inc. 144A(c) 958.000 PennyMac Financial Services, Inc. 144A(c) 959.000 PetSmart, Inc. Via PetSmart Finance Corp. 144A(c) 959.000 PetSmart, Inc. Via PetSmart Finance Corp. 144A(c) 959.000 PetSmart, Inc. Via PetSmart Finance Corp. 144A(c) 959.000 Pike Corp. 144A(c) 959.000 Pike Corp. 144A(c) 959.000 Prestige Brands, Inc. 144A(c) 959.000 Prestige Brands, Inc. 144A(c) 959.000 Prestige Brands, Inc. 144A(c) 959.000 Qorvo, Inc. 144A(c) 959.000 Qorvo, Inc. 144A(c) 959.000 Rattler Midstream LP 144A(c) 959.000 Real Hero Merger Sub 2, Inc. 144A(c) 959.000 Real Hero Merger Sub 2, Inc. 144A(c) 959.000 Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp. 144A(c) 959.000 Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp. 144A(c) 959.000 Reprovable Energy Group, Inc. 144A(c) 959.000 Reprovable Energy Gro							
957.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c) USD 4,625 % 15/03/2030 942.645 0,48 560.000 Pactiv Evergreen Group Issuer LLC Via Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. 144A(c) USD 4,375 % 15/10/2028 547.400 0,28 588.000 PennyMac Financial Services, Inc. 144A(c) USD 5,750 % 15/09/2031 570.360 0,29 320.000 Performance Food Group, Inc. 144A(c) USD 4,250 % 01/08/2029 311.200 0,16 250.000 PetSmart, Inc. Via PetSmart Finance Corp. 144A(c) USD 4,750 % 15/02/2028 252.188 0,13 840.000 Pike Corp. 144A(c) USD 5,500 % 01/09/2028 849.450 0,43 307.000 PRA Health Sciences, Inc. 144A(c) USD 5,500 % 01/09/2028 849.450 0,43 307.000 Prestige Brands, Inc. 144A(c) USD 5,125 % 15/07/2026 306.233 0,16 476.000 Prestige Brands, Inc. 144A(c) USD 5,125 % 15/07/2026 306.233 0,16 476.000 Prestige Brands, Inc. 144A(c) USD 3,750 % 01/04/2031 330.122 0,17 360.000 Qorvo, Inc. 144A(c) USD 3,750 % 01/04/2031 330.122 0,17 360.000 Qorvo, Inc. 144A(c) USD 3,375 % 01/04/2031 363.600 0,18 98.000 Rattler Midstream LP 144A(c) USD 3,375 % 01/04/2031 363.600 0,18 98.000 Real Hero Merger Sub 2, Inc. 144A(c) USD 5,625 % 15/07/2025 101.676 0,05 95.000 Real Hero Merger Sub 2, Inc. 144A(c) USD 7,625 % 15/06/2025 179.563 0,09 210.000 Renewable Energy Group, Inc. 144A(c) USD 7,825 % 15/06/2025 179.563 0,09 210.000 Renewable Energy Group, Inc. 144A(c) USD 7,875 % 01/06/2028 215.250 0,11 316.000 Reynolds Group Issuer LLC Via Reynolds Group Issuer LL		·					
588.000       PennyMac Financial Services, Inc. 144A(c)       USD 5,750 %       15/09/2031       570.360       0,29         320.000       Performance Food Group, Inc. 144A(c)       USD 4,250 %       01/08/2029       311.200       0,16         250.000       PetSmart, Inc. Via PetSmart Finance Corp. 144A(c)       USD 4,750 %       15/02/2028       252.188       0,13         840.000       Pike Corp. 144A(c)       USD 5,500 %       01/09/2028       849.450       0,43         307.000       PRA Health Sciences, Inc. 144A(c)       USD 2,875 %       15/07/2026       306.233       0,16         476.000       Prestige Brands, Inc. 144A(c)       USD 5,125 %       15/01/2028       495.040       0,25         345.000       Prestige Brands, Inc. 144A(c)       USD 3,750 %       01/04/2031       330.122       0,17         360.000       Qorvo, Inc. 144A(c)       USD 3,750 %       01/04/2031       363.600       0,18         98.000       Rattler Midstream LP 144A(c)       USD 5,625 %       15/07/2025       101.676       0,05         95.000       Real Hero Merger Sub 2, Inc. 144A(c)       USD 6,250 %       01/02/2029       95.475       0,05         169.000       Realongy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp. 144A(c)       USD 7,625 %       15/06/2025       179.563		·					
320.000 Performance Food Group, Inc. 144A(c) 250.000 PetSmart, Inc. Via PetSmart Finance Corp. 144A(c) 250.000 Pike Corp. 144A(c) 250.000 Pike Corp. 144A(c) 250.000 Pike Corp. 144A(c) 250.000 Pike Corp. 144A(c) 250.000 PRA Health Sciences, Inc. 144A(c) 250.000 PRA Health Sciences, Inc. 144A(c) 250.000 Prestige Brands, Inc. 144A(c) 250			USD				
250.000 PetSmart, Inc. Via PetSmart Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup> 840.000 Pike Corp. 144A <sup>(c)</sup> 840.000 PRA Health Sciences, Inc. 144A <sup>(c)</sup> 840.000 Prestige Brands, Inc. 144A <sup>(c)</sup> 840.000 Prestige Brands, Inc. 144A <sup>(c)</sup> 840.000 Qorvo, Inc. 144A <sup>(c)</sup> 840.000 Rattler Midstream LP 144A <sup>(c)</sup> 840.000 Real Hero Merger Sub 2, Inc. 144A <sup>(c)</sup> 840.000 Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp. 144A <sup>(c)</sup> 840.000 Renewable Energy Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup> 840.000 Reprolls Group Issuer, Inc. Via Reynolds Group Issuer LLC Via Reynolds USD 4,000 % 15/10/2027 304.545 0,15	588.000	PennyMac Financial Services, Inc. 144A(c)	USD	5,750 %	15/09/2031	570.360	0,29
840.000 Pike Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,500 % 01/09/2028 849.450 0,43 307.000 PRA Health Sciences, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 2,875 % 15/07/2026 306.233 0,16 476.000 Prestige Brands, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,125 % 15/01/2028 495.040 0,25 345.000 Prestige Brands, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,750 % 01/04/2031 330.122 0,17 360.000 Qorvo, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,375 % 01/04/2031 330.122 0,17 98.000 Rattler Midstream LP 144A <sup>(c)</sup> USD 3,375 % 101/04/2031 363.600 0,18 98.000 Rattler Midstream LP 144A <sup>(c)</sup> USD 5,625 % 15/07/2025 101.676 0,05 95.000 Real Hero Merger Sub 2, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 7,625 % 15/06/2029 95.475 0,05 169.000 Realogy Group LLC Via Realogy Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 7,625 % 15/06/2025 179.563 0,09 210.000 Renewable Energy Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 7,875 % 01/06/2028 215.250 0,11 316.000 Reynolds Group Issuer, Inc. Via Reynolds Group Issuer LLC Via Reynolds USD 7,000 % 15/10/2027 304.545 0,15	320.000	Performance Food Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	01/08/2029	311.200	0,16
307.000       PRA Health Sciences, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 2,875 %       15/07/2026       306.233       0,16         476.000       Prestige Brands, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,125 %       15/01/2028       495.040       0,25         345.000       Prestige Brands, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,750 %       01/04/2031       330.122       0,17         360.000       Qorvo, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,375 %       01/04/2031       363.600       0,18         98.000       Rattler Midstream LP 144A <sup>(c)</sup> USD 5,625 %       15/07/2025       101.676       0,05         95.000       Real Hero Merger Sub 2, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 6,250 %       01/02/2029       95.475       0,05         169.000       Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 7,625 %       15/06/2025       179.563       0,09         210.000       Renewable Energy Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 7,625 %       01/06/2028       215.250       0,11         316.000       Repynolds Group Issuer, Inc. Via Reynolds Group Issuer LLC Via Reynolds       USD 4,000 %       15/10/2027       304.545       0,15		·					
476.000       Prestige Brands, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,125 %       15/01/2028       495.040       0,25         345.000       Prestige Brands, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,750 %       01/04/2031       330.122       0,17         360.000       Qorvo, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,375 %       01/04/2031       363.600       0,18         98.000       Rattler Midstream LP 144A <sup>(c)</sup> USD 5,625 %       15/07/2025       101.676       0,05         95.000       Real Hero Merger Sub 2, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 6,250 %       01/02/2029       95.475       0,05         169.000       Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 7,625 %       01/06/2025       179.563       0,09         210.000       Reewable Energy Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,875 %       01/06/2028       215.250       0,11         316.000       Reynolds Group Issuer, Inc. Via Reynolds Group Issuer LLC Via Reynolds       USD 4,000 %       15/10/2027       304.545       0,15							
345.000     Prestige Brands, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,750 %     01/04/2031     330.122     0,17       360.000     Qorvo, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,375 %     01/04/2031     363.600     0,18       98.000     Rattler Midstream LP 144A <sup>(c)</sup> USD 5,625 %     15/07/2025     101.676     0,05       95.000     Real Hero Merger Sub 2, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 6,250 %     01/02/2029     95.475     0,05       169.000     Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 7,625 %     15/06/2025     179.563     0,09       210.000     Renewable Energy Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,875 %     01/06/2028     215.250     0,11       316.000     Reynolds Group Issuer, Inc. Via Reynolds Group Issuer LLC Via Reynolds     USD 4,000 %     15/10/2027     304.545     0,15							
360.000 Qorvo, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,375 % 01/04/2031 363.600 0,18 98.000 Rattler Midstream LP 144A <sup>(c)</sup> USD 5,625 % 15/07/2025 101.676 0,05 95.000 Real Hero Merger Sub 2, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 6,250 % 01/02/2029 95.475 0,05 169.000 Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 7,625 % 15/06/2025 179.563 0,09 210.000 Renewable Energy Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,875 % 01/06/2028 215.250 0,11 316.000 Reynolds Group Issuer, Inc. Via Reynolds Group Issuer LLC Via Reynolds Group Issuer Lu 144A <sup>(c)</sup> USD 4,000 % 15/10/2027 304.545 0,15		•					
98.000 Rattler Midstream LP 144A <sup>(c)</sup> USD 5,625 % 15/07/2025 101.676 0,05 95.000 Real Hero Merger Sub 2, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 6,250 % 01/02/2029 95.475 0,05 169.000 Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 7,625 % 15/06/2025 179.563 0,09 210.000 Renewable Energy Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 7,875 % 01/06/2028 215.250 0,11 316.000 Reynolds Group Issuer, Inc. Via Reynolds Group Issuer LLC Via Reynolds Group Issuer LLC Via Reynolds Group Issuer LLC Via Reynolds Group Issuer Lu 144A <sup>(c)</sup> USD 4,000 % 15/10/2027 304.545 0,15		· ·					
95.000 Real Hero Merger Sub 2, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 6,250 % 01/02/2029 95.475 0,05 169.000 Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 7,625 % 15/06/2025 179.563 0,09 210.000 Renewable Energy Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup> USD 5,875 % 01/06/2028 215.250 0,11 316.000 Reynolds Group Issuer, Inc. Via Reynolds Group Issuer LLC Via Re							
169.000       Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp. 144A(c)       USD 7,625 %       15/06/2025       179.563       0,09         210.000       Renewable Energy Group, Inc. 144A(c)       USD 5,875 %       01/06/2028       215.250       0,11         316.000       Reynolds Group Issuer, Inc. Via Reynolds Group Issuer LLC Via Reynolds       USD 4,000 %       15/10/2027       304.545       0,15							
210.000 Renewable Energy Group, Inc. 144A(c) USD 5,875 % 01/06/2028 215.250 0,11 316.000 Reynolds Group Issuer, Inc. Via Reynolds Group Issuer LLC Via Reynolds Group Issuer Lu 144A(c) USD 4,000 % 15/10/2027 304.545 0,15		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					
316.000 Reynolds Group Issuer, Inc. Via Reynolds Group Issuer LLC Via Reynolds Group Issuer Lu 144A <sup>(c)</sup> USD 4,000 % 15/10/2027 304.545 0,15							
Group Issuer Lu 144A <sup>(c)</sup> USD 4,000 % 15/10/2027 304.545 0,15		•					-,
302.000 SBA Communications Corp. 144A <sup>(c)</sup> USD 3,125 % 01/02/2029 287.278 0,15		Group Issuer Lu 144A <sup>(c)</sup>					
	302.000	SBA Communications Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,125 %	01/02/2029	287.278	0,15

# Goldman Sachs Funds—Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (cor	itinuación)					
	os – (continuación)		4.075.0/	0.4/0.0/0.00	404.000	2.24
	Scotts Miracle-Gro Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	01/02/2032 15/01/2029	481.362 1.260.475	0,24
	Scripps Escrow II, Inc. 144A <sup>(c)</sup> SeaWorld Parks & Entertainment, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	3,875 % 5,250 %	15/01/2029	780.000	0,64 0,40
	Shift4 Payments LLC Via Shift4 Payments Finance Sub, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	01/11/2026	108.806	0,40
	Sinclair Television Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	01/12/2030	657.937	0,33
	Sirius XM Radio, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,125 %	01/09/2026	186.913	0,09
295.000	Sirius XM Radio, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	15/07/2028	290.206	0,15
765.000	Sirius XM Radio, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	01/07/2029	811.856	0,41
	Sirius XM Radio, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	01/07/2030	720.525	0,37
	Sirius XM Radio, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	01/09/2031	501.512	0,25
	Sonic Automotive, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	15/11/2029	215.003	0,11
	Sonic Automotive, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	15/11/2031	244.440	0,12
	Specialty Building Products Holdings LLC Via SBP Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,375 %	30/09/2026	319.300	0,16
	Spectrum Brands, Inc. 144A <sup>(c)</sup> SRS Distribution, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 % 6,125 %	15/03/2031 01/07/2029	1.018.500 270.844	0,52 0,14
	SS&C Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	30/09/2027	1.559.307	0,14
	Standard Industries, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	15/02/2027	338.989	0,79
	Stericycle, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	15/01/2029	424.125	0,22
	Summit Midstream Holdings LLC Via Summit Midstream Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,500 %	15/10/2026	369.563	0,19
	Sunoco LP Via Sunoco Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	30/04/2030	569.250	0,13
	Surgery Center Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,750 %	01/07/2025	164.048	0,08
	Tallgrass Energy Partners LP Via Tallgrass Energy Finance Corp. 144A(c)	USD	6,000 %	31/12/2030	337.450	0,17
	Tallgrass Energy Partners LP Via Tallgrass Energy Finance Corp. 144A(c)	USD	6,000 %	01/09/2031	702.000	0,36
133.000	TEGNA, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/03/2026	137.489	0,07
292.000	Tenet Healthcare Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	01/09/2024	297.293	0,15
525.000	Tenet Healthcare Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	01/06/2029	518.109	0,26
353.000	Terrier Media Buyer, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,875 %	15/12/2027	375.063	0,19
600.000	Travel & Leisure Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	01/12/2029	589.500	0,30
	Trident TPI Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	9,250 %	01/08/2024	1.002.155	0,51
454.000	Twitter, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	15/12/2027	473.295	0,24
	Uber Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,500 %	15/05/2025	1.091.800	0,56
	Uber Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,250 %	15/01/2028	482.625	0,25
	Uber Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	15/08/2029	462.675	0,24
	Unifrax Escrow Issuer Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,250 %	30/09/2028	212.313	0,11
	United Airlines, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	15/04/2026	673.312	0,34
	United Natural Foods, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,750 %	15/10/2028	239.205	0,12
	United Wholesale Mortgage LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/11/2025	374.063	0,19
	Urban One, Inc. 144A <sup>(c)</sup> US Foods, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,375 %	01/02/2028	225.500	0,11
	US Foods, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,250 %	15/04/2025	232.338	0,12
	US Foods, Inc. 144A(c)	USD	4,750 % 4,625 %	15/02/2029 01/06/2030	580.750 256.275	0,30 0,13
	Vertiv Group Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	15/11/2028	454.133	0,13
	ViaSat, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,625 %	15/09/2025	1.523.462	0,23
	VICI Properties LP Via VICI Note Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,500 %	15/02/2025	191.599	0,10
	VICI Properties LP Via VICI Note Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,750 %	15/02/2027	164.400	0,08
	Vistra Operations Co., LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	01/05/2029	1.462.062	0,74
	WESCO Distribution, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,125 %	15/06/2025	377.914	0,19
	WMG Acquisition Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,000 %	15/02/2031	306.313	0,16
	Wolverine Escrow LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,500 %	15/11/2024	452.400	0,23
	WR Grace Holdings LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	15/06/2027	1.555.580	0,79
	WR Grace Holdings LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,625 %	15/08/2029	211.050	0,11
618.000	ZoomInfo Technologies LLC Via ZoomInfo Finance Corp. 144A(c)	USD	3,875 %	01/02/2029	604.095	0,31
					114.192.528	58,06
TOTAL DE BO						
(coste USD 14	.1.323.879)  LORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO				141.319.950	71,85
(coste USD 14					141.319.950	71,85
Otros valores Bonos – 2,74						
Canadá						
485.000	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	01/06/2028	478.635	0,25
Estados Unide						
	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp. 144A(c)	USD	6,000 %	01/06/2029	147.444	0,07
	Arches Buyer, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	01/06/2028	566.717	0,29
	Beacon Roofing Supply, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	15/05/2029	650.087	0,33
1.080.000	CCO Holdings LLC Via CCO Holdings Capital Corp. 144A(c)	USD	4,250 %	15/01/2034	1.032.750	0,53

# Goldman Sachs Funds—Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

			Tipo de		Valor o	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b</sup>	en US	D patrimonio
Bonos - (con	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					
	os – (continuación)	HCD	E 07E 0/	15/00/202	040.00	0 46
	DIRECTV Holdings LLC Via DIRECTV Financing Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup> Element Solutions, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,875 % 3,875 %	15/08/2027 01/09/2028		
	Jefferies Finance LLC Via JFIN Co-Issuer Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	15/08/2028		
	Playtika Holding Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	15/03/2029		
	Science Applications International Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	01/04/2028		
365.000	Wheel Pros, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,500 %	15/05/2029		
					4.903.73	1 2,49
(coste USD 5.4	···				5.382.36	6 2,74
Tenencias	Descripción del valor				Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ord	inarias – - %					
Estados Unido					0	_
TOTAL DE AC	CIONES ORDINARIAS					
(coste USD 1.0	152.321) ROS VALORES MOBILIARIOS				0	
(coste USD 6.5					5.382.366	2,74
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés	Fecha de vencimiento	Valor de mercado en USD	% del
	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	DIVISA	interes	recha de vencimiento	en oad	patrillonio
Estados Unido	olazo – 6,79 %					
	ING Bank NV USD Time Deposit	USD	0,030 %	01/12/2021	356.124	0,18
12.989.847	Rabobank Nederland USD Time Deposit	USD	0,020 %	01/12/2021	12.989.847	6,61
					13.345.971	6,79
	PÓSITOS A PLAZO					
(coste USD 13	.345.971)				13.345.971	6,79
VALOR DE ME (coste USD 19	RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS 3.052.159)				192.872.502	98,07
Contratos de	futuros – (0,33 %)					
				Compromiso Valor de mercado	Plusvalía	
Número de				en	latente	
contratos	Descripción del valor			USD	USD	% del patrimonio
	USD					
	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022		Larga	24.092.578	73.465	0,04
	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022		Larga Larga	9.857.320 1.398.250	99.803 41.875	0,05 0,02
			9	35.348.148	215.143	0,11
PLUSVALÍA LA	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS			00.040.140	215.143	0,11
LOOVALIALA	TENTE SOBRE SONTRAISO DE FOTOROS				210.140	
Número de				Compromiso Valor de mercado en	Plusvalía latente	
contratos	Descripción del valor			USD		% del patrimonio
	USD					
, ,	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022		Corta	(41.153.625)	(646.839)	(0,33)
(72)	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03	2022	Corta	(10.582.875)	(215.847)	(0,11)
				(51.736.500)	(862.686)	(0,44)
				(**************************************	(	

## Goldman Sachs Funds—Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Contratos de divisas a plazo – (0,01 %)	Contratos	de divisas	s a plazo –	(0,01 %)
-----------------------------------------	-----------	------------	-------------	----------

	as a plazo – (0,01 %)			Minusvalía	
Divisa	Compra Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	latente en USD	% del patrimonio
USD	808.672 EUR	716.918	10/02/2022	(8.932)	(0,01)
MINUSVALÍA LATEN	NTE SOBRE CONTRATOS D	E DIVISAS A PLAZO		(8.932)	(0,01)
Contratos de divis	sas a plazo específicos de	una clase de acciones – (0,01 %)			
Divisa	Compra Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
EUR	14.235.510 USD	16.075.204	10/02/2022	159.560	0,08
PLUSVALÍA LATENT	TE SOBRE CONTRATOS DE	DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERT	URA	Fecha de vencimiento (8.932)  10/02/2022 (8.932)  (8.932)  Plusvalia latente en USD (8.932)  10/02/2022 159.560  159.560  Minusvalia latente en USD (1.878)  21/01/2022 (1.82.592) 10/02/2022 (1.878)  (184.470)  192.191.117  4.480.190  192.872.502 215.143 (862.686) (8.932) 159.560 (184.470) 4.480.190	0,08
Divisa	Compra Divisa	Venta		latente	% del patrimonio
GBP	4.682.902 USD	6.444.118	21/01/2022	(182.592)	(0,09)
USD	220.731 EUR	195.195	10/02/2022	(1.878)	(0,00)
MINUSVALÍA LATEN	NTE SOBRE CONTRATOS DI	DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBER	TURA	(184.470)	(0,09)
VALOR DE MERCAL (coste USD 193.052	DO DE LAS INVERSIONES .159)			192.191.117	97,72
OTROS ACTIVOS Y	PASIVOS			4.480.190	2,28
PATRIMONIO				196.671.307	100,00
TOTAL DE INVERSI	ONES			mercado	% del patrimonio
Total inversiones exc	luyendo derivados (coste USE	193.052.159)		192.872.502	98,07
	re contratos de futuros				0,11
	bre contratos de futuros			,	(0,44)
	bre contratos de divisas a pla			` ,	(0,01)
		o celebrados con fines de cobertura zo celebrados con fines de cobertura			0,08
Otros activos y pasive		zo celebrados con lines de cobelluia		,	(0,09) 2,28
Patrimonio				196.671.307	100,00

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Australia & New Zealand Banking Group Ltd., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Deutsche Bank AG, Morgan Stanley & Co. International Plc., State Street Bank & Trust y UBS AG.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,11 %.

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de interés anual indicado según cupón, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo vigente que se basará en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (d) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- (e) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,092 %.

	5	<b>.</b>	T: (2)	(b)	Valor de mercado en	, % de
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	USD	patrimoni
Valores mobil Bonos – 58,2	liarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial					
Australia	2 /6					
	Westpac Banking Corp.	USD	1.019 %	18/11/2024	873.758	0,20
	Troopad Darming Gorp.		1,010 70	10/11/2024	070.700	0,2,
Canadá	David of News Coation	HOD	0.400.0/	45/00/0000	704 470	0.4
	Bank of Nova Scotia	USD USD	0,400 %	15/09/2023 17/03/2024	721.179 2.559.215	0,17 0,59
	Bell Telephone Co. of Canada or Bell Canada – Serie US-3 Canadian Imperial Bank of Commerce	USD	0,750 % 0,950 %	23/06/2023	703.129	0,3
	Canadian Natural Resources Ltd.	USD	2.050 %	15/07/2025	532.938	0,12
	Canadian Pacific Railway Co.	USD	1,350 %	02/12/2024	1.575.835	0,36
515.000	Enbridge, Inc.	USD	2,900 %	15/07/2022	521.556	0,12
	Enbridge, Inc. <sup>(c)</sup>	USD	0,450 %	17/02/2023	325.133	0,08
	Enbridge, Inc.	USD	0,550 %	04/10/2023	796.976	0,18
	National Bank of Canada	USD	0,750 %	06/08/2024	1.387.736	0,32
	Royal Bank of Canada TransCanada PipeLines Ltd.	USD USD	0,425 % 1,000 %	19/01/2024 12/10/2024	867.458 895.581	0,20 0,2
900.000	Transcanada FipeLines Ltd.	03D	1,000 /6	12/10/2024		
					10.886.736	2,51
Islas Caimán						
910.000	SA Global Sukuk Ltd.	USD	1,602 %	17/06/2026	900.331	0,21
Colombia						
870.000	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	8.125 %	21/05/2024	991.628	0,23
			-,:			-,
Alemania	Deutsche Beel: AO	HOD	0.000.0/	00/05/0004	4 000 000	0.00
	Deutsche Bank AG Deutsche Bank AG – Serie E	USD USD	0,898 % 0.962 %	28/05/2024 08/11/2023	1.366.062 1.000.060	0,32 0,23
1.000.000	Deutsche Bank AG – Sehe L	03D	0,902 //	00/11/2023		
					2.366.122	0,55
Indonesia						
1.000.000	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	4,450 %	11/02/2024	1.073.750	0,25
320.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III	USD	2,300 %	23/06/2025	330.400	0,07
					1.404.150	0,32
Irlanda						-
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	1,650 %	29/10/2024	1.775.284	0,41
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	6,500 %	15/07/2025	1.287.517	0,30
					3.062.801	0,71
Japón						
	Depósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1026	JPY	(0,155 %)	06/01/2022	21.335.562	4,92
	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	USD	2,998 %	22/02/2022	1.760.430	0,40
	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	USD USD	3,218 % 2,623 %	07/03/2022 18/07/2022	1.360.476 659.022	0,31 0,15
	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. (c)	USD	0,953 %	19/07/2025	2.731.713	0,10
	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.(c)	USD	0,962 %	11/10/2025	1.090.518	0,25
	Mizuho Financial Group, Inc. (c)	USD	1,241 %	10/07/2024	754.545	0,17
	Mizuho Financial Group, Inc.(c)	USD	0,849 %	08/09/2024	199.952	0,05
1.200.000	Panasonic Corp. 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,536 %	19/07/2022	1.212.864	0,28
425.000	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	USD	2,348 %	15/01/2025	436.624	0,10
	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	USD	0,948 %	12/01/2026	292.782	0,07
1.550.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,800 %	12/09/2023	1.551.674	0,36
					33.386.162	7,69
Kuwait						
	Bonos internacionales del Estado de Kuwait	USD	2,750 %	20/03/2022	1.068.032	0,25
			2,700 /0	LOIGOILULL		0,20
Luxemburgo	DIL Furana Financa II CARI	1105	0.000.0/	451111000	2 000 405	
2.025.000	DH Europe Finance II SARL	USD	2,200 %	15/11/2024	2.086.135	0,48
Países Bajos						
	Cooperatieve Rabobank UA <sup>(c)</sup>	USD	0,951 %	10/01/2022	425.361	0,10
	Cooperatieve Rabobank UA	USD	3,875 %	08/02/2022	2.569.697	0,59
	Cooperatieve Rabobank UA	USD	4,625 %	01/12/2023	1.043.426	0,24
	Cooperatieve Rabobank UA	USD	0,375 %	12/01/2024	495.425	0,11
	ING Groep NV Lukoil International Finance BV	USD USD	4,100 % 4,563 %	02/10/2023 24/04/2023	688.519 1.048.506	0,16 0,2 <sup>2</sup>
1.010.000	Euron international i mance by	USD	4,503 %	24/04/2023		
					6.270.934	1,44
Catar		_	·			
1.020.000	Bonos internacionales del Estado de Catar	USD	3,375 %	14/03/2024	1.072.530	0,25

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de
Bonos - (cont	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		.,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,			
España						
	Banco Santander S.A.	USD	2,706 %	27/06/2024	2.286.152	0,52
1.600.000	Banco Santander S.A. <sup>(c)</sup>	USD	0,701 %	30/06/2024	1.594.160	0,37
Supranacional	es				3.880.312	0,89
•	Broadcom Corp. Via Broadcom Cayman Finance Ltd.	USD	3,625 %	15/01/2024	2.993.982	0,69
Suiza	· ·		·			
	Credit Suisse AG	USD	0,520 %	09/08/2023	1.320.879	0,30
	Credit Suisse Group AG	USD	3,800 %	09/06/2023	2.504.112	0,58
	Credit Suisse Group AG 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	2,593 %	11/09/2025	1.359.384	0,31
	UBS AG 144A <sup>(d)</sup> UBS AG 144A <sup>(d)</sup>	USD USD	0,450 %	09/02/2024 09/08/2024	963.212 768.599	0,22 0,18
	UBS AG 144A(d)	USD	0,700 % 1,250 %	01/06/2026	2.119.620	0,16
2.130.000	UBS AG 144A	03D	1,230 /6	01/00/2020	9.035.806	2,08
Emiratos Árabe	es Unidos				0.000.000	2,00
1.070.000	Bonos internacionales del Estado de Abu Dabi	USD	2,125 %	30/09/2024	1.097.820	0,25
Reino Unido	- (1)					
	Barclays Plc. (c)	USD	4,610 %	15/02/2023	378.019	0,09
	GlaxoSmithKline Capital Plc.	USD	0,534 %	01/10/2023 25/05/2023	598.632	0,14
	HSBC Holdings Plc. HSBC Holdings Plc. <sup>(c)</sup>	USD USD	3,600 %	22/11/2024	1.693.867 1.050.567	0,39 0,24
	HSBC Holdings Plc. <sup>(c)</sup>	USD	1,162 % 0,976 %	24/05/2025	1.113.896	0,25
	Lloyds Banking Group Plc.(c)	USD	2,858 %	17/03/2023	1.031.529	0,24
	Lloyds Banking Group Plc.(c)	USD	1,326 %	15/06/2023	1.354.576	0,31
	Lloyds Banking Group Plc.(c)	USD	0,695 %	11/05/2024	898.641	0,21
	Nationwide Building Society 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,000 %	27/01/2023	889.831	0,20
1.275.000	Nationwide Building Society 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,622 %	26/04/2023	1.289.905	0,30
475.000	Nationwide Building Society 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,766 %	08/03/2024	491.568	0,11
	NatWest Markets Plc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,625 %	29/09/2022	1.103.520	0,25
	NatWest Markets Plc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,375 %	21/05/2023	2.023.723	0,47
	NatWest Markets Plc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,800 %	12/08/2024	716.532	0,16
	Royalty Pharma Plc.	USD	0,750 %	02/09/2023	847.382	0,19
	Santander UK Group Holdings Plc. (c) Standard Chartered Plc. 144A(c)(d)	USD USD	1,089 % 4,247 %	15/03/2025 20/01/2023	1.663.292 1.205.604	0,38 0,28
	Standard Chartered Pic. 144A <sup>(c)</sup> (d)	USD	1,319 %	14/10/2023	225.923	0,26
	Standard Chartered Pic. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,885 %	15/03/2024	854.733	0,20
	Standard Chartered Plc. 144A <sup>(c)</sup> (d)	USD	0,991 %	12/01/2025	198.368	0,05
					19.630.108	4,52
Estados Unido:		1100	2.050.0/	04/40/0000	4 040 000	0.00
	AbbVie, Inc. AbbVie, Inc.	USD USD	3,250 % 2,300 %	01/10/2022 21/11/2022	1.016.280 1.396.519	0,23 0,32
	AbbVie, Inc.	USD	2,600 %	21/11/2024	1.816.955	0,32
	Aetna, Inc.	USD	2,800 %	15/06/2023	642.650	0,15
	Aetna, Inc.	USD	3,500 %	15/11/2024	823.399	0,19
1.000.000	Air Lease Corp.	USD	3,750 %	01/02/2022	1.000.000	0,23
	Air Lease Corp.	USD	2,250 %	15/01/2023	305.061	0,07
	Air Lease Corp.	USD	2,750 %	15/01/2023	1.096.414	0,2
	American Express Co.	USD	0,750 %	03/11/2023	1.375.385	0,32
	American Tower Corp.	USD USD	0,600 %	15/01/2024	818.334	0,19
	American Tower Corp. Anthem, Inc.	USD	2,400 % 0,450 %	15/03/2025 15/03/2023	436.526 1.421.281	0,10 0,30
	Astrazeneca Finance LLC	USD	0,700 %	28/05/2024	2.282.255	0,53
	AT&T, Inc.	USD	3,000 %	30/06/2022	707.042	0,16
	AT&T, Inc.	USD	2,625 %	01/12/2022	812.544	0,19
1.000.000	AT&T, Inc.	USD	0,900 %	25/03/2024	996.240	0,23
	AT&T, Inc.	USD	3,950 %	15/01/2025	348.475	0,08
1.500.000		USD	3,400 %	15/05/2025	1.596.885	0,3
	Bank of America Corp.	USD	3,300 %	11/01/2023	1.365.704	0,3
	Bank of America Corp.(c)	USD	3,004 %	20/12/2023	5.016.865	1,16
	Bank of America Corp. (c)	USD	0,593 %	28/05/2024	2.147.510	0,49
	Bank of America Corp. (c) Bank of America NA(c)	USD USD	0,981 % 3,335 %	25/09/2025 25/01/2023	742.702 326.567	0,17 0,08
	Bank of New York Mellon Corp.	USD	0,350 %	07/12/2023	746.062	0,00
	Beam Suntory, Inc.	USD	3,250 %	15/05/2022	1.006.000	0,1
	Becton Dickinson and Co.	USD	3,734 %	15/12/2024	534.735	0,12
	Berry Global, Inc.	USD	0,950 %	15/02/2024	921.726	0,2

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
•	es – (continuación)					
	Boeing Co.	USD	1,167 %	04/02/2023	1.726.432	0,40
	Broadcom, Inc.	USD	3,625 %	15/10/2024	1.276.500	0,29
175.000	Celanese US Holdings LLC	USD	3,500 %	08/05/2024	184.200	0,04
1.800.000	CenterPoint Energy, Inc.	USD	2,500 %	01/09/2022	1.823.490	0,42
1.875.000	Charter Communications Operating LLC Via Charter					
	Communications Operating Capital	USD	4,464 %	23/07/2022	1.910.175	0,44
675.000	Charter Communications Operating LLC Via Charter		4.500.0/	04/00/0004	700 007	0.47
100.000	Communications Operating Capital	USD USD	4,500 %	01/02/2024	720.367 99.009	0,17
	Children's Hospital of Orange County CIT Group, Inc.	USD	0,650 % 4,750 %	01/11/2023 16/02/2024	52.875	0,02 0,01
	Citigroup, Inc.	USD	2,750 %	25/04/2022	1.486.254	0,34
	Citigroup, Inc.	USD	2,700 %	27/10/2022	636.625	0,15
	Citigroup, Inc.	USD	3,875 %	25/10/2023	1.299.664	0,30
	Citigroup, Inc.(c)	USD	0,776 %	30/10/2024	721.824	0,17
1.050.000	Citigroup, Inc.(c)	USD	0,981 %	01/05/2025	1.044.687	0,24
1.050.000	Citigroup, Inc.(c)	USD	1,281 %	03/11/2025	1.049.044	0,24
	Citizens Bank NA Via Providence RI	USD	3,250 %	14/02/2022	1.204.248	0,28
	Constellation Brands, Inc.	USD	3,200 %	15/02/2023	1.644.096	0,38
	Crown Castle International Corp.	USD	1,350 %	15/07/2025	496.610	0,11
	CVS Health Corp.	USD	3,700 %	09/03/2023	267.244	0,06
	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD USD	5,450 %	15/06/2023	1.148.062	0,26
	Dell International LLC Via EMC Corp.  Dominion Energy, Inc. <sup>(e)</sup>	USD	4,000 % 3,071 %	15/07/2024 15/08/2024	854.256 235.098	0,20 0,05
	DTE Energy Co. – Serie F	USD	1,050 %	01/06/2025	395.196	0,05
	DTE Energy Co. – Serie H	USD	0,550 %	01/11/2022	749.895	0,17
	DuPont de Nemours, Inc.	USD	4,205 %	15/11/2023	2.650.150	0,61
	Eastern Energy Gas Holdings LLC	USD	3,550 %	01/11/2023	496.765	0,11
	eBay, Inc.	USD	1,400 %	10/05/2026	691.663	0,16
	Energy Transfer LP	USD	2,900 %	15/05/2025	439.973	0,10
725.000	Energy Transfer LP Via Regency Energy Finance Corp.	USD	4,500 %	01/11/2023	764.440	0,18
525.000	Entergy Louisiana LLC	USD	0,620 %	17/11/2023	522.380	0,12
	Enterprise Products Operating LLC	USD	3,500 %	01/02/2022	1.683.626	0,39
	Enterprise Products Operating LLC	USD	3,350 %	15/03/2023	488.082	0,11
	Evergy, Inc.(e)	USD	5,292 %	15/06/2022	420.403	0,10
	Exxon Mobil Corp.	USD	2,992 %	19/03/2025	791.280	0,18
	Fidelity National Information Services, Inc. First Republic Bank <sup>(c)</sup>	USD	0,600 % 1,912 %	01/03/2024 12/02/2024	889.884 532.576	0,20 0,12
	FirstEnergy Corp.	USD	2,050 %	01/03/2025	300.045	0,12
	Fisery, Inc.	USD	3,800 %	01/10/2023	630.852	0,15
	Fisery, Inc.	USD	2,750 %	01/07/2024	1.478.323	0,34
	Fox Corp.	USD	3,666 %	25/01/2022	1.004.980	0,23
800.000	General Motors Financial Co., Inc.	USD	1,050 %	08/03/2024	797.600	0,18
1.300.000	General Motors Financial Co., Inc.	USD	3,950 %	13/04/2024	1.373.775	0,32
	General Motors Financial Co., Inc.	USD	1,200 %	15/10/2024	945.421	0,22
	General Motors Financial Co., Inc.	USD	1,500 %	10/06/2026	2.042.298	0,47
	Georgia Power Co. – Serie A	USD	2,100 %	30/07/2023	689.020	0,16
	Gilead Sciences, Inc.	USD	0,750 %	29/09/2023	74.930	0,02
	Hewlett Packard Enterprise Co. Hewlett Packard Enterprise Co.	USD	4,400 % 2,250 %	15/10/2022 01/04/2023	1.719.538 458.177	0,40 0,11
	Hewlett Packard Enterprise Co.	USD				
	Hormel Foods Corp.	USD	4,450 % 0,650 %	02/10/2023 03/06/2024	847.696 402.833	0,20 0,09
	Humana, Inc.	USD	0,650 %	03/08/2023	1.321.330	0,30
	Huntington National Bank	USD	3,125 %	01/04/2022	428.022	0,10
825.000	Huntington National Bank	USD	1,800 %	03/02/2023	835.972	0,19
1.250.000	Illumina, Inc.	USD	0,550 %	23/03/2023	1.246.437	0,29
350.000	Intercontinental Exchange, Inc.	USD	0,700 %	15/06/2023	349.864	0,08
300.000	Intuit, Inc.	USD	0,950 %	15/07/2025	296.928	0,07
	ITC Holdings Corp.	USD	2,700 %	15/11/2022	346.035	0,08
	JPMorgan Chase & Co.(c)	USD	3,207 %	01/04/2023	1.917.005	0,44
	JPMorgan Chase & Co.(c)	USD	1,514 %	01/06/2024	808.048	0,19
	JPMorgan Chase & Co.(c)	USD	0,653 %	16/09/2024	1.171.498	0,27
	JPMorgan Chase & Co.(c)	USD	0,563 %	16/02/2025	1.212.137	0,28
	JPMorgan Chase & Co. <sup>(c)</sup> JPMorgan Chase & Co. <sup>(c)</sup>	USD USD	0,824 %	01/06/2025	3.911.882	0,90
	Keurig Dr Pepper, Inc.	USD	0,969 % 4,057 %	23/06/2025 25/05/2023	1.986.800 302.280	0,46 0,07
	KeyBank NA <sup>(c)</sup>	USD	4,057 % 0,423 %	03/01/2024	823.193	0,07
	KeyBank NA <sup>(c)</sup>	USD	0,433 %	14/06/2024	2.638.870	0,19
	Kinder Morgan Energy Partners LP	USD	3,950 %	01/09/2022	127.176	0,03
	Marathon Petroleum Corp.	USD	4,500 %	01/05/2023	461.622	0,11
	Marsh & McLennan Cos., Inc.	USD	3,500 %	03/06/2024	898.977	0,21
400.000	Morgan Stanley	USD	2,750 %	19/05/2022	404.428	0,09
	•					•

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

	Descripción del color	<b>.</b>	Time de int ( (a)	Forbodon /b\	Valor de mercado en	% d
enencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	USD	patrimon
onos – (con stados Unido	tinuacion) s – (continuación)					
	Morgan Stanley	USD	3,125 %	23/01/2023	2.056.980	0,4
	Morgan Stanley <sup>(c)</sup>	USD	0,560 %	10/11/2023	2.646.846	0,6
	Morgan Stanley <sup>(c)</sup>	USD	0,791 %	22/01/2025	1.984.280	0,4
2.900.000	Morgan Stanley <sup>(c)</sup>	USD	0,790 %	30/05/2025	2.862.996	0,6
1.300.000	Morgan Stanley <sup>(c)</sup>	USD	1,164 %	21/10/2025	1.292.486	0,3
	Morgan Stanley – Serie F	USD	3,875 %	29/04/2024	585.117	0,1
	Morgan Stanley – Serie I <sup>(c)</sup>	USD	0,864 %	21/10/2025	444.771	0,1
	MPLX LP	USD	3,500 %	01/12/2022	256.223	0,0
	MPLX LP	USD	3,375 %	15/03/2023	823.440	0,1
	MUFG Union Bank NA	USD	3,150 %	01/04/2022	704.942	0,1
	MUFG Union Bank NA NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	USD USD	2,100 % 2,900 %	09/12/2022 01/04/2022	914.013 654.849	0,2 0,1
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	USD	0,650 %	01/03/2023	1.050.588	0,1
	NiSource, Inc.	USD	0,950 %	15/08/2025	684.572	0,2
	Pacific Gas and Electric Co.	USD	1,750 %	16/06/2022	749.992	0,1
	PayPal Holdings, Inc.	USD	2,200 %	26/09/2022	1.167.721	0,2
	PayPal Holdings, Inc.	USD	2,400 %	01/10/2024	725.711	0,1
	PerkinElmer, Inc.	USD	0,850 %	15/09/2024	741.945	0,1
	Phillips 66	USD	0,900 %	15/02/2024	545.452	0,1
475.000	Pioneer Natural Resources Co.	USD	0,550 %	15/05/2023	473.613	0,1
	Pioneer Natural Resources Co.	USD	0,750 %	15/01/2024	1.436.225	0,3
275.000	Plains All American Pipeline LP Via PAA Finance Corp.	USD	3,650 %	01/06/2022	276.977	0,0
574.000	Plains All American Pipeline LP Via PAA Finance Corp.	USD	3,850 %	15/10/2023	599.308	0,1
725.000	Public Service Enterprise Group, Inc.	USD	0,841 %	08/11/2023	724.072	0,1
450.000	Public Service Enterprise Group, Inc.	USD	2,875 %	15/06/2024	469.076	0,1
450.000	Public Service Enterprise Group, Inc.	USD	0,800 %	15/08/2025	439.902	0,1
225.000	Ralph Lauren Corp.	USD	1,700 %	15/06/2022	226.634	0,0
1.675.000	Realty Income Corp.	USD	4,600 %	06/02/2024	1.790.458	0,4
	Rockwell Automation, Inc.	USD	0,350 %	15/08/2023	697.928	0,1
	Skyworks Solutions, Inc.	USD	0,900 %	01/06/2023	625.187	0,1
	Southern Co.	USD	2,950 %	01/07/2023	1.234.128	0,2
	Southern Copper Corp.	USD	3,500 %	08/11/2022	1.065.506	0,2
	Southern Power Co.	USD	0,900 %	15/01/2026	218.529	0,0
	Teledyne Technologies, Inc.	USD	0,950 %	01/04/2024	1.320.588	0,3
	Thermo Fisher Scientific, Inc.	USD	1,215 %	18/10/2024	1.976.126	0,4
	Time Warner Entertainment Co., LP T-Mobile USA, Inc.	USD USD	8,375 %	15/03/2023	631.022	0,1
	Truist Bank	USD	3,500 %	15/04/2025 09/03/2023	3.420.403 1.587.883	0,7
	UnitedHealth Group, Inc.	USD	1,250 % 0,550 %	15/05/2024	744.120	0,3 0,1
	Verizon Communications, Inc.	USD	0,750 %	22/03/2024	2.165.234	0,1
	VMware, Inc.	USD	1,000 %	15/08/2024	1.443.243	0,3
	Walgreens Boots Alliance, Inc.	USD	0,950 %	17/11/2023	1.298.869	0,3
	WEC Energy Group, Inc.	USD	0,550 %	15/09/2023	472.920	0,1
	Wells Fargo & Co.	USD	3,500 %	08/03/2022	67.576	0,0
	Wells Fargo & Co.	USD	3,750 %	24/01/2024	3.459.407	0,8
	Wells Fargo & Co.(c)	USD	0,805 %	19/05/2025	992.270	0,2
	Westlake Chemical Corp.	USD	0,875 %	15/08/2024	521.026	0,1
	Williams Cos., Inc.	USD	3,600 %	15/03/2022	325.985	0,0
	Williams Cos., Inc.	USD	3,700 %	15/01/2023	1.102.853	0,2
	Xcel Energy, Inc.	USD	0,500 %	15/10/2023	298.389	0,0
	Zimmer Biomet Holdings, Inc.	USD	1,450 %	22/11/2024	1.101.364	0,2
	•		,		151.671.707	34,9
OTAL DE BO						
oste USD 252	2.671.953)				252.679.054	58,2
enencias	Descripción del valor				Valor de mercado en USD	% d patrimon
ondos de inv	versión – 0,00 %					
	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund (Clase de acciones d	e distribución X) <sup>(f)(g</sup>	)		6	0,0
OTAL DE FON	NDOS DE INVERSIÓN				6	0,0

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	liarios negociados en otro mercado regulado	2	po dotoro			patimonio
Bonos - 17,2	•					
Australia						
	Bank Ltd. 144A(d)	USD	2,100 %	17/10/2022	786.354	0,18
1.325.000	Macquarie Group Ltd. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,201 %	14/10/2025	1.317.805	0,31
					2.104.159	0,49
Bermudas	40					
2.298.000	IHS Markit Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,000 %	01/11/2022	2.364.688	0,55
Canadá						
2.025.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,700 %	21/05/2024	2.006.046	0,46
Islas Caimán						
	Avolon Holdings Funding Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,625 %	01/05/2022	883.645	0,21
650.000	Avolon Holdings Funding Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,875 %	15/02/2025	666.373	0,15
					1.550.018	0,36
Dinamarca	(1)					
575.000	Danske Bank A/S 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,226 %	22/06/2024	577.444	0,13
Finlandia						
1.375.000	Nordea Bank Abp 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,625 %	24/05/2024	1.363.244	0,31
Francia						
	Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,125 %	21/11/2022	1.319.370	0,30
	Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 144A <sup>(d)</sup> BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,650 %	27/02/2024	322.504	0,07
	BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD	3,800 % 4,000 %	10/01/2024 12/09/2023	1.213.641 1.104.754	0,28 0,26
	BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,375 %	14/01/2025	588.398	0,14
			<del></del>		4.548.667	1,05
Países Bajos						
-	Enel Finance International NV 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,375 %	12/07/2026	1.354.664	0,32
	JDE Peet's NV 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,800 %	24/09/2024	1.353.344	0,31
475.000	Mondelez International Holdings Netherlands BV 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,125 %	19/09/2022	481.574	0,11
1.325.000	Mondelez International Holdings Netherlands BV 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,750 %	24/09/2024	1.309.073	0,30
600.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,650 %	11/03/2024	596.802	0,14
					5.095.457	1,18
Supranacional						
950.000	NXP BV Via NXP Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,875 %	01/09/2022	969.760	0,22
Suecia						
800.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,550 %	01/09/2023	798.904	0,18
Suiza						
	UBS Group AG 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,650 %	01/02/2022	2.007.640	0,46
375.000	UBS Group AG 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,008 %	30/07/2024	375.769	0,09
					2.383.409	0,55
Reino Unido	40					
750.000	Coca-Cola Europacific Partners Plc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,800 %	03/05/2024	741.952	0,17
Estados Unido						
	7-Eleven, Inc. 144A <sup>(d)</sup> 7-Eleven, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD	0,625 % 0,800 %	10/02/2023 10/02/2024	499.435	0,11 0,25
	7-Eleven, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,950 %	10/02/2024	1.090.573 218.279	0,25
	AIG Global Funding 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,800 %	07/07/2023	300.744	0,07
	AIG Global Funding 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,450 %	08/12/2023	720.759	0,17
	AIG Global Funding 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,650 %	17/06/2024	2.448.889	0,56
	Alabama Federal Aid Highway Finance Authority Arizona Board of Regents "C"	USD USD	0,449 % 0,492 %	01/09/2023 01/06/2023	264.728 104.865	0,06 0,02
	Arizona Board of Regents "C"	USD	0,769 %	01/06/2024	64.779	0,02
1.175.000	Athene Global Funding 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,950 %	08/01/2024	1.173.531	0,27
	Athene Global Funding 144A <sup>(c)</sup> (d)	USD	0,750 %	24/05/2024	1.931.025	0,44
	Athene Global Funding 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,450 %	08/01/2026	470.830	0,11
	Aviation Capital Group LLC 144A <sup>(d)</sup> Aviation Capital Group LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD USD	5,500 % 1,950 %	15/12/2024 30/01/2026	717.281 222.163	0,17 0,05
	Baxter International, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,868 %	01/12/2023	1.695.665	0,03
	City of Austin TX Electric Utility Revenue "A"	USD	2,456 %	15/11/2022	265.418	0,06
	City of Austin TX Electric Utility Revenue "A"	USD	2,524 %	15/11/2023	270.053	0,06
	City of Huntington Beach CA	USD	0,381 %	15/06/2023	79.697	0,02
∠55.000	City of San Francisco CA Public Utilities Commission Water Revenue	USD	4,900 %	01/11/2022	265.708	0,06

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos – (con	tinuación)					
Estados Unido	s – (continuación)					
430.000	City of Tucson AZ	USD	0,459 %	01/07/2024	425.350	0,10
	City of Worcester MA "B"	USD	0,275 %	15/11/2022	34.947	0,01
	County of Nueces TX	USD	0,516 %	15/02/2024	39.816	0,01
	County of Palm Beach FL	USD	0,500 %	01/12/2024	622.117	0,14
	County of Pima AZ Curators of the University of Missouri	USD USD	0,520 % 1,466 %	01/05/2024 01/11/2023	119.054 1.333.603	0,03 0,31
	Dallas Fort Worth International Airport	USD	0,632 %	01/11/2023	906.982	0,21
	Dominion Energy, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,450 %	15/01/2023	790.337	0,18
600.000	Emera US Finance LP 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,833 %	15/06/2024	593.256	0,14
	Equitable Financial Life Global Funding 144A(d)	USD	0,500 %	17/11/2023	746.460	0,17
	Equitable Financial Life Global Funding 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,100 %	12/11/2024	948.261	0,22
	Equitable Financial Life Global Funding 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,400 %	07/07/2025	424.269	0,10
	Georgia-Pacific LLC 144A <sup>(d)</sup> Glencore Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD USD	0,625 % 3,000 %	15/05/2024 27/10/2022	644.475 1.299.467	0,15 0,30
	Glencore Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,625 %	01/09/2025	2.334.396	0,54
	Hoover City Board of Education	USD	0,321 %	15/02/2023	115.051	0,03
	Hoover City Board of Education	USD	0,555 %	15/02/2024	164.850	0,04
1.250.000	Hyundai Capital America 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,000 %	17/09/2024	1.236.150	0,28
	Infor, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,450 %	15/07/2023	301.941	0,07
	International Flavors & Fragrances, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,697 %	15/09/2022	475.632	0,11
	Jackson Financial, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,125 %	22/11/2023	951.795	0,22
	Kinder Morgan, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Long Island Power Authority	USD USD	5,625 %	15/11/2023	1.048.954	0,24 0,05
	Los Angeles Department of Water & Power Water System Revenue	USD	0,359 % 5,281 %	01/03/2023 01/07/2023	219.525 193.233	0,05
	Metropolitan Life Global Funding "I" 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,900 %	08/06/2023	452.327	0,10
	Metropolitan Life Global Funding "I" 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,550 %	07/06/2024	990.280	0,23
	Municipal Improvement Corp. of Los Angeles "A"	USD	0,319 %	01/11/2022	119.982	0,03
2.375.000	New York City Transitional Finance Authority Building Aid Revenue	USD	0,380 %	15/07/2023	2.371.487	0,55
650.000	New York State Dormitory Authority	USD	0,207 %	15/03/2022	649.977	0,15
	New York State Dormitory Authority	USD	0,307 %	15/03/2023	244.635	0,06
	New York State Urban Development Corp. "B"	USD	2,100 %	15/03/2022	201.116	0,05
	NRG Energy, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,750 %	15/06/2024	1.180.114	0,27
	Pacific Life Global Funding II 144A <sup>(d)</sup> Pennsylvania State University	USD USD	0,500 % 1,353 %	23/09/2023 01/09/2023	623.525 147.128	0,14 0,03
	Port Authority of New York & New Jersey	USD	1,086 %	01/07/2023	1.342.246	0,03
	Port of Morrow OR	USD	3,097 %	01/09/2023	229.619	0,05
	Principal Life Global Funding II 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,500 %	08/01/2024	1.166.540	0,27
475.000	Protective Life Global Funding 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,082 %	09/06/2023	478.382	0,11
	Protective Life Global Funding 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,631 %	13/10/2023	374.573	0,09
	Protective Life Global Funding 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,473 %	12/01/2024	964.899	0,22
	Protective Life Global Funding 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,781 %	05/07/2024	1.189.632	0,27
	Reliance Standard Life Global Funding II 144A <sup>(d)</sup> Riverside County Infrastructure Financing Authority	USD USD	2,625 % 0,548 %	22/07/2022 01/11/2023	1.039.196 274.484	0,24 0,06
	State of Iowa Board of Regents	USD	0,200 %	01/10/2022	1.349.475	0,00
	State of Maryland Department of Transportation	USD	0,361 %	01/08/2023	622.799	0,14
	State of Tennessee	USD	0,386 %	01/11/2023	1.758.297	0,41
460.000	University of Massachusetts Building Authority	USD	4,350 %	01/11/2024	505.263	0,12
	Utah State Board of Regents <sup>(c)</sup>	USD	0,842 %	26/12/2031	943.463	0,22
	Vistra Operations Co., LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,550 %	15/07/2024	1.065.313	0,25
	Volkswagen Group of America Finance LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,750 %	23/11/2022	1.201.536	0,28
45.000	Wisconsin Department of Transportation	USD	0,624 %	01/07/2024	44.805	0,01
					50.305.436	11,59
TOTAL DE BOI (coste USD 74.					74.809.184	17,24
-	con garantía de activos emitidos o garantizados por agencias -	7.10 %				
Estados Unido		,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,				
935.619	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	15/06/2041	985.753	0,23
14.487	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	2,000 %	15/07/2041	14.742	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	15/03/2044	279.476	0,06
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	15/08/2046	149.209	0,03
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 % 5,000 %	15/08/2046	153.830	0,03
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD USD	5,000 % 4,500 %	01/05/2048 01/10/2048	87.784 499.125	0,02 0,11
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/11/2048	2.683.050	0,11
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/07/2049	36.393	0,02
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/09/2049	246.924	0,06
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	15/05/2050	1.321.135	0,30
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	15/08/2054	1.356.620	0,31
1.225.423	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	15/11/2054	1.291.765	0,30

Tenencias	Descripción del valor	Divisa Tip	o de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de patrimonio
Obligaciones	con garantía de activos emitidos o garantizados por agencias	- (continuación	)			
-	os – (continuación)	(oontinudolon)	,			
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,700 %	25/01/2034	161.127	0,04
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/01/2023	1.412	0,0
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/08/2033	815.925	0,1
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/07/2035	267.711	0,0
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/05/2038	76.783	0,0
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD USD	2,500 %	25/04/2043	57.495	0,0
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(c)</sup> Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	0,489 % 4,500 %	25/09/2046 01/05/2048	134.460 4.034.500	0,0 0,9
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/05/2048	295.557	0,0
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/07/2048	1.121.481	0,2
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/07/2048	428.854	0,1
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/08/2048	1.214.857	0,2
196.587	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/08/2048	215.569	0,0
1.448.119	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/10/2048	1.587.232	0,3
738.811	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/02/2049	813.465	0,1
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/03/2049	70.310	0,0
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/06/2049	2.644.220	0,6
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/10/2049	431.343	0,1
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD USD	4,500 %	01/09/2050	903.988 809.686	0,2
	Federal National Mortgage Association (FNMA) Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(h)(i)</sup>	USD	4,500 % 4,500 %	01/06/2051 13/12/2051	(8.600.312)	0,1 (1,98
	Government National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	20/08/2047	935.668	0,2
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/06/2048	631.905	0,1
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/08/2048	59.793	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/09/2048	715.886	0,10
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/10/2048	205.116	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/10/2048	210.477	0,0
338.028	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/11/2048	363.200	0,0
2.169.154	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/12/2048	2.303.329	0,5
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/12/2048	1.195.717	0,28
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/12/2048	1.416.659	0,3
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/01/2049	66.705	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/01/2049	1.721.248	0,40
	Government National Mortgage Association (GNMA) Government National Mortgage Association (GNMA)	USD USD	4,500 % 5,000 %	20/03/2049 20/03/2049	1.002.192 19.848	0,23 0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/04/2049	1.742.302	0,40
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/12/2049	1.224.827	0,2
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/03/2050	385.480	0,0
					30.791.821	7,10
TOTAL DE OB (coste USD 30	LIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZ .399.310)	ADOS POR AGEN	ICIAS		30.791.821	7,10
-	con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agend	cias – 10,70 %				
Islas Caimán	(c)(d)					
	AGL CLO 6 Ltd. 2020-6A "AR" 144A <sup>(c)(d)</sup> Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD USD	1,332 %	20/07/2034	3.602.376	0,8
	CIFC Funding Ltd. 2017-2A "AR" 144A(c)(d)	USD	1,182 % 1,082 %	18/04/2034 20/04/2030	823.634 2.000.666	0,19 0,46
	CQS US CLO 2021-1A Ltd. "A" 144A(c)(d)	USD	0,000 %	20/04/2030	2.197.800	0,4
	ICG US CLO Ltd. 2014-1A "A1A2" 144A(c)(d)	USD	1,332 %	20/10/2034	4.352.162	1,00
	Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	0,874 %	15/04/2029	995.013	0,2
	Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(d)	USD	1,412 %	20/01/2032	801.127	0,18
	Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(c)(d)	USD	1,432 %	20/04/2033	2.001.772	0,40
4.300.000	Marble Point CLO XXI Ltd. 2021-3A "A1" 144A(c)(d)	USD	1,369 %	17/10/2034	4.299.613	0,99
3.300.000	Marble Point CLO XXII Ltd. 2021-2A "A" 144A(c)(d)	USD	1,324 %	25/07/2034	3.304.940	0,7
	Tikehau US CLO I Ltd. 2021-1A "A1" 144A(c)(d)	USD	0,000 %	18/01/2035	2.101.050	0,4
	Trinitas CLO XVIII Ltd. 2021-18A "A1" 144A(c)(d)	USD	0,000 %	20/01/2035	4.298.710	0,99
	Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(c)(d)	USD	1,014 %	15/04/2029	602.525	0,1
9.000.000	Venture 28A CLO Ltd. 2017-28AA "A1R" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,210 %	20/10/2034	9.004.500	2,0
Reino Unido					40.385.888	9,3
	Stratton Mortgage Funding 2019-1 Plc. "A"(c)	GBP	1,250 %	25/05/2051	1.205.909	0,2
Estados Unido	os					
	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29 "D" 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,110 %	10/04/2048	435.053	0,1
	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-GC36 "C"(c)	USD	4,908 %	10/02/2049	206.714	0,0
	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01 "1M2" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,600 %	25/10/2041	205.383	0,0
	Educational Funding of the South, Inc. 2011-1 "A2"(c)	USD	0,774 %	25/04/2035	28.497	0,0
	Illinois Student Assistance Commission 2010-1 "A3"(c)	USD	1,024 %	25/07/2045	92.139	0,0
14.866	Massachusetts Educational Financing Authority 2008-1 "A1"(C)	USD	1,074 %	25/04/2038	15.046	0,00
14.866	massachusetts Educational Financing Authority 2008-1 "A1"(c)	บรม	1,074 %	25/04/2038	15.046	(

					Valor de	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	mercado en USD	% del
	s con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias -		<del>-</del>	recha de vencimiento.	030	patrinonio
-	os – (continuación)	- (COIIIII	idacioni			
150.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C23 "D" 144A(c)(d)	USD	4,282 %	15/07/2050	149.869	0,03
150.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 "D" 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,060 %	15/10/2048	143.505	0,03
400.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C34 "D" 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,700 %	15/11/2052	352.865	0,08
168.591	Navient Student Loan Trust 2017-4A "A2" 144A(c)(d)	USD	0,618 %	27/09/2066	169.273	0,04
753.994	Nelnet Student Loan Trust 2012-3A "A" 144A(c)(d)	USD	0,792 %	25/02/2045	761.899	0,18
	Pennsylvania Higher Education Assistance Agency 2006-1 "A3"(c)	USD	0,264 %	25/10/2035	225.505	0,05
	Toyota Auto Receivables Owner Trust 2021-D "A3"	USD		15/04/2026	1.500.295	0,35
	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-LC25 "D" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,198 %	15/12/2059	380.336	0,09
200.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RB1 "D" 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,401 %	15/03/2050	186.440	0,04
					4.852.819	1,12
TOTAL DE OB (coste USD 46	BLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS NO EMITIDOS NI GARANTIZA 3.338.963)	DOS PO	OR AGENCIAS		46.444.616	10,70
TOTAL DE VA	LORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO				152.045.621	35,04
·	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·				132.043.021	33,04
Bonos – 0.34	s mobiliarios					
Estados Unide						
	O Athene Global Funding 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,200 %	13/10/2023	553.636	0,13
	Great-West Lifeco US Finance 2020 LP 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,904 %	12/08/2025	292.425	0,13
	Metropolitan Life Global Funding "I" 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,950 %	13/01/2023	635.162	0,07
023.000	in well opolital falle Global Full ding 1 144A	030	1,930 //	13/01/2023		
TOTAL DE BO	NOS				1.481.223	0,34
(coste USD 1.					1.481.223	0,34
TOTAL DE OT (coste USD 1.4	ROS VALORES MOBILIARIOS 474.801)				1.481.223	0,34
Certificados	de depósito – 2,10 %					
Australia						
1.557.000	National Australia Bank Ltd.(c)	USD	0,230 %	24/05/2022	1.557.211	0,36
Estados Unide	os					
3.754.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp.	USD	0,170 %	01/02/2022	3.754.315	0,86
	Sumitomo Mitsui Trust Holdings, Inc.	USD	0,160 %	24/01/2022	3.800.307	0,88
	• .				7.554.622	1,74
TOTAL DE CE	RTIFICADOS DE DEPÓSITO					
(coste USD 9.	111.000)				9.111.833	2,10
Efectos com	erciales - 3,07 %					
Canadá						
3.000.000	Bank Of Nova Scotia <sup>(c)</sup>	USD	0,230 %	11/05/2022	3.000.540	0,69
1.500.000	Toronto Dominion Bank	USD	0,000 %	26/04/2022	1.498.689	0,35
					4.499.229	1,04
Estados Unide	os					
	Barclays Capital, Inc.	USD	0,000 %	24/01/2022	2.499.572	0,58
	Enel Finance America LLC	USD	0,000 %	16/02/2022	2.998.564	0,69
	Honeywell International, Inc.	USD		20/05/2022	1.327.016	0,30
	) Waste Management, Inc.	USD		02/09/2022	1.994.679	0,46
			<del></del>		8.819.831	2,03
	ECTOS COMERCIALES				12 210 060	2.07
VALOR DE ME	ERCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS				13.319.060	3,07
(coste USD 42	28.180.232)		·		428.636.797	98,77
	garantía de activos hipotecarios a plazo cubiertos – (0,25 %)				/4 GG=	
(1.000.000)	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(h)(i)</sup>	USD	5,000 %	13/12/2051	(1.095.155)	(0,25)
TOTAL DE VA (coste USD (1	LORES HIPOTECARIOS A PLAZO CUBIERTOS .103.281))				(1.095.155)	(0,25)
					,,	(-,)

Contratos de	futuros – 0,03 %				Compromiso		
Número de contratos	Descripción del valor				Valor de mercado en USD	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
	USD						
26	Futuros sobre pagarés del Teso	oro de EE. I	JU. a 10 años 22/03/2022	Larga	3.407.625	55.781	0,01
613	Futuros sobre pagarés del Teso	oro de EE. I	JU. a 2 años 31/03/2022	Larga	134.261.367	338.761	0,08
					137.668.992	394.542	0,09
PLUSVALÍA LA	ATENTE SOBRE CONTRATOS	DE FUTUR	os			394.542	0,09
Número de contratos	Descripción del valor				Compromiso Valor de mercado en USD	Minusvalía latente USD	% del patrimonio
	EUR						
(2)		ública Fede	eral de Alemania a 5 años 08/12/2021	Corta	(308.676)	(1.160)	(0,00)
(470)	USD			0.1	(04.050.000)	(0.40, 500)	(0.05)
	Futuros sobre pagarés del Teso			Corta	(21.053.289)	(213.523)	(0,05)
(24)	Futuros sobre pagares del Teso	oro de EE. (	JU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022	Corta	(3.527.625)	(71.949)	(0,01)
					(24.580.914)	(285.472)	(0,06)
MINUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRATOS	S DE FUTU	ROS			(286.632)	(0,06)
Contratos de	divisas a plazo - 0,05 %						
Divisa	Compra	Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
USD	21.503.860	JPY	2.402.907.956		06/01/2022	146.821	0,04
USD	1.447.378	GBP	1.051.497		21/01/2022	41.417	0,01
USD		AUD	616.051		31/01/2022	14.741	0,00
USD EUR		CAD USD	1.413.831 1.107.120		31/01/2022 10/02/2022	21.307 12.044	0,00 0,00
	ATENTE SOBRE CONTRATOS				10/02/2022	236.330	0,05
Divisa	Compra	Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% del patrimonio
USD	717.841	EUR	636.289		10/02/2022	(7.809)	(0,00)
MINUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRATOS	S DE DIVISA	AS A PLAZO			(7.809)	(0,00)
Contratos de	permutas financieras – (0,0	5 %)					
Importe local neto teórico	A pagar		A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
4.610.	Permutas de tipos de inte 000 Fijo 1,750 %	erés	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2026	6.293	0,00
PLUSVALÍA LA	ATENTE SOBRE PERMUTAS D	E TIPOS D	E INTERÉS			6.293	0,00
	Permutas de incumplimie	North Ameri	, ,	USD	20/06/2025	86.580	0,02
8.750.	Investment Grade 34 Index		I IMIENTO CREDITICIO (CDS)			86.580	0,02
						00.300	0,02
PLUSVALÍA LA	ATENTE SOBRE PERMUTAS D		DE PERMUTAS FINANCIERAS			92.873	0,02
PLUSVALÍA LA	ATENTE SOBRE PERMUTAS D		DE PERMUTAS FINANCIERAS			92.873 Minusvalía	0,02
PLUSVALÍA LA TOTAL DE PLU	ATENTE SOBRE PERMUTAS D		DE PERMUTAS FINANCIERAS  A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento		0,02 % del patrimonio
PLUSVALÍA LA TOTAL DE PLU Importe local neto teórico	ATENTE SOBRE PERMUTAS D ISVALÍA LATENTE SOBRE CO A pagar Permutas de tipos de inte	ONTRATOS erés	A recibir		vencimiento	Minusvalía latente USD	% del patrimonio
PLUSVALÍA LA TOTAL DE PLU Importe local neto teórico 35.350.	ATENTE SOBRE PERMUTAS D  JSVALÍA LATENTE SOBRE CO  A pagar  Permutas de tipos de inte  000 Variable (BBSW a 3 meses	erés s en AUD)	A recibir Fijo 0,190 %	AUD	22/02/2023	Minusvalía latente USD	% del patrimonio
PLUSVALÍA LA TOTAL DE PLU Importe local neto teórico 35.350. 15.940.	A pagar  Permutas de tipos de inte 000 Variable (BBSW a 3 meses 000 Variable (BBSW a 6 meses	erés s en AUD)	<b>A recibir</b> Fijo 0,190 %  Fijo 1,250 %	AUD AUD	22/02/2023 15/12/2026	Minusvalía latente USD (56.931) (174.290)	% del patrimonio (0,01) (0,04)
PLUSVALÍA LA TOTAL DE PLU Importe local neto teórico 35.350. 15.940. 2.760.	ATENTE SOBRE PERMUTAS D  JSVALÍA LATENTE SOBRE CO  A pagar  Permutas de tipos de inte  000 Variable (BBSW a 3 meses	erés s en AUD)	A recibir Fijo 0,190 %	AUD	22/02/2023	Minusvalía latente USD	% del patrimonio

#### Contratos de permutas financieras - (continuación)

Importe local neto teórico	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% del patrimonio
	Permutas de tipos de interés – (conti	nuación)				
17.050.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,250 %	SEK	15/12/2026	(2.996)	(0,00)
4.450.000	Fijo 1,000 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2027	(15.929)	(0,01)
MINUSVALÍA LATE	ENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE	INTERÉS			(293.883)	(0,07)
TOTAL DE MINUS	VALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS I	DE PERMUTAS FINANCIERAS			(293.883)	(0,07)
	ADO DE LAS INVERSIONES					
(coste USD 427.07	76.951)				427.677.063	98,55
OTROS ACTIVOS	Y PASIVOS				6.282.973	1,45
PATRIMONIO					433.960.036	100,00
					Valor de	
TOTAL DE INIVERS	NONES				mercado en	, % del
TOTAL DE INVERS	SIONES				USD	patrimonio
Total inversiones ex	xcluyendo derivados (coste USD 428.180.	232)			428.636.797	98,77
Valor de mercado d	le títulos con garantía hipotecaria a plazo	cubiertos (coste USD (1.103.281))			(1.095.155)	(0,25)
Plusvalía latente so	bre contratos de futuros				394.542	0,09
Minusvalía latente s	sobre contratos de futuros				(286.632)	(0,06)
Plusvalía latente so	bre contratos de divisas a plazo				236.330	0,05
Minusvalía latente s	sobre contratos de divisas a plazo				(7.809)	(0,00)
Plusvalía latente so	obre contratos de permutas financieras				92.873	0,02
Minusvalía latente s	sobre contratos de permutas financieras				(293.883)	(0,07)
Otros activos y pas	ivos				6.282.973	1,45
Patrimonio					433.960.036	100,00

El Comisionista de futuros fue Credit Suisse Securities (USA) LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., JP Morgan Chase Bank N.A., State Street Bank & Trust y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Credit Suisse y Morgan Stanley.

 $La\ exposición\ m\'{a}xima\ a\ cada\ contraparte\ a\ 30\ de\ noviembre\ de\ 2021,\ medida\ como\ porcentaje\ del\ VL,\ es\ del\ 0,09\ \%.$ 

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (d) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (e) Este título tiene un cupón escalonado que pasará al segundo tipo en una fecha determinada del futuro.
- (f) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- $^{(g)}$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,092 %.
- (h) Estos valores representan ventas por confirmar (TBA) cubiertas con posiciones FNMA largas. Estos importes se declaran por separado en el Balance de situación como Valores hipotecarios a plazo cubiertos.
- (i) Los valores TBA (por confirmar) se compran sobre una vez suscrito un compromiso a plazo con un importe de principal aproximado (por lo general +/-2,5 %) y sin fecha definitiva de vencimiento. El importe real del principal y la fecha de vencimiento se determinarán tras la liquidación cuando se asignen los "pools" de hipotecas específicos.

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Valores mobil	ilarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial 3 %					
Australia						
50.000	Westpac Banking Corp.(c)	USD	4,110 %	24/07/2034	54.257	0,02
Bermudas						
	IHS Markit Ltd.	USD	3,625 %	01/05/2024	158.375	0,07
125.000	IHS Markit Ltd.	USD _	4,250 %	01/05/2029	142.161	0,07
					300.536	0,14
Canadá						
	Canadian Pacific Railway Co.	USD	2,450 %	02/12/2031	151.809	0,07
	Enbridge, Inc.	USD	2,500 %	01/08/2033	98.737	0,05
	Suncor Energy, Inc.	USD	2,800 %	15/05/2023	1.360.801	0,64
	Suncor Energy, Inc. Teck Resources Ltd.	USD	3,100 % 3,900 %	15/05/2025 15/07/2030	131.442 53.819	0,06 0,02
50.000	reck Resources Ltd.	- 03D	3,900 %	13/07/2030		
					1.796.608	0,84
Islas Caimán	SA Global Sukuk Ltd.	USD	2,694 %	17/06/2031	1.353.375	0,63
	XLIT Ltd.	USD	4,450 %	31/03/2025	274.342	0,03
200.000	7.2.1.2.0.	-	1,100 %	0.000,2020	1.627.717	0,76
Crossis					1.027.717	0,70
100.000	Bonos internacionales del Estado de Croacia	EUR	1,500 %	17/06/2031	114.582	0,05
Alemania						
200.000	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	USD	2,222 %	18/09/2024	203.410	0,10
150.000	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	USD	2,129 %	24/11/2026	150.447	0,07
255.000	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	USD	3,035 %	28/05/2032	256.971	0,12
					610.828	0,29
Guernsey						
100.000	Amdocs Ltd.	USD	2,538 %	15/06/2030	100.114	0,05
Indonesia	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	HOD	2.250.0/	40/00/0074	400.750	0.00
	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	3,350 %	12/03/2071	189.750	0,09
175.000	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	4,875 %	16/01/2024	187.402	0,09
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	2,450 %	29/10/2026	602.634	0,28
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	3,000 %	29/10/2028	327.928	0,15
250.000	GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.	USD	3,373 %	15/11/2025	270.737	0,13
350.000	Perrigo Finance Unlimited Co.	USD	4,375 %	15/03/2026	370.762	0,17
150.000	STERIS Irish FinCo Unlimited Co.	USD	2,700 %	15/03/2031	152.405	0,07
					1.911.868	0,89
Japón						
	Depósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028	JPY	(0,147 %)	11/04/2022	4.698.759	2,20
	Depósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1033	JPY	(0,158 %)	31/01/2022	6.895.289	3,23
200.000	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	USD _	3,751 %	18/07/2039	227.684	0,10
					11.821.732	5,53
Jersey 400 000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,940 %	30/09/2040	396.500	0,19
Luxemburgo			_,,,,,,			-,,,,
	DH Europe Finance II SARL	USD	2,200 %	15/11/2024	128.774	0,06
100.000	DH Europe Finance II SARL	USD	3,250 %	15/11/2039	108.090	0,05
		_			236.864	0,11
México						
	Mexico City Airport Trust	USD	3,875 %	30/04/2028	205.622	0,10
Países Bajos						
	ABN AMRO Bank NV <sup>(c)</sup>	EUR	4,375 %	Perp.	239.611	0,11
	Lukoil Securities BV	USD	3,875 %	06/05/2030	512.875	0,24
	Prosus NV	USD	3,680 %	21/01/2030	285.730	0,13
200.000	Prosus NV	USD _	3,832 %	08/02/2051	180.656	0,09
					1.218.872	0,57
Panamá 200.000	Bonos internacionales del Estado de Panamá	USD	4,500 %	16/04/2050	214.177	0,10
200.000	Donos internacionales del Estado de Fallanta		4,500 /0	10/04/2000	214.177	0,10

Social Content   Section	Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de patrimonio
1000   Bones internacionales del Estado de Perú   195   3,20 %   2,760 %   3,210 %   3,221 %   3,2017(21)   2,217 %   3,217 %   3,2017(21)   2,217 %   3,217 %   3,2017(21)   2,217 %   3,217 %   3,2017(21)   2,217 %   3,2017(21)   2,217 %   3,2017(21)   2,217 %   3,2017(21)   2,217 %   3,2017(21)   2,217 %   3,2017(21)   2,217 %   3,2017(21)   2,217 %   3,2017(21)   2,217 %   3,2017(21)   2,217 %   3,2017(21)   2,217 %   3,2017(21)   2,217 %   3,2017(21)   2,217 %   3,2017(21)   2,217 %   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,2017(21)   3,20	•	itinuación)					
Catar		Bonos internacionales del Estado de Perú	USD	2 780 %	01/12/2060	8 452	0,01
Catar				·			0,01
Catalar Energy			-	<u> </u>		33.171	0,02
210.000   Cater Energy   USD   3.125 %   1207/2061   210.425 0   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   205.6378   0.00   0.00   205.6378   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00	Catar						
Rumania		Qatar Energy	USD	3,125 %	12/07/2041	210.945	0,10
Romania			USD	3,300 %	12/07/2051	205.375	0,09
Book   Bonos Internacionales del Estado de Rumania   EUR   2,124 %   1007/2031   97,273   0,			-			416.320	0,19
Tought   Property   Tought	Rumanía						
Tespaña	80.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,124 %	16/07/2031	87.273	0,04
España   200.00   Barnco Santander S.A.   USD   2,746 %   28065/2025   207,640   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,0	70.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,000 %	28/01/2032	73.975	0,03
200,000 Banco Santander S.A.   USD   2,746 %   2806/52025   207,640   0.						161.248	0,07
## 40,000 Banco Santander S A.  ## 200,000 Banco Santander S A.  ## 150,000 Telefonica Emisiones S A.  ## 1							
200.00   Banco Santander S.A.   USD   3,306 %   2706/2029   214.188   0.				·			0,10
150.000   Telefonica Emisiones S.A.   USD   4,665 %   06/03/2038   174.300   0.							0,2
Suiza							0,10
Suiza	150.000	releionica Emisiones S.A.	- 030	4,005 %	00/03/2036		
ASS, 000   Credit Suisse Group AG	0					1.037.926	0,48
Section   Sect		Credit Suisse AG	USD	1,250 %	07/08/2026	474.500	0,22
Printate Arabes Unidos   270.000   Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC	250.000	Credit Suisse Group AG	USD	4,550 %	17/04/2026	276.917	0,13
Reino Unido			-			751.417	0,35
Reino Unido	Emiratos Árab	es Unidos					
250.000   Bardays Pic.     USD   4,610 %   150022023   252,013   0,0	270.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC	USD	4,600 %	02/11/2047	315.900	0,15
225.000   Barclays Pic.		(1)					
200.000   Gazprom PJSC Via Gaz Finance Pic.				·			0,12
1.375.000   HSBC Holdings Pic. (a)							0,11
325.000 HSBC Holdings Pic. <sup>(c)</sup> 375.000 Nationwide Building Society 144A <sup>(c)(d)</sup> 375.000 Nationwide		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		·			0,09
375,000   Nationwide Building Society 144A(c)(d)   USD   3,960 %   18/07/2030   415,309   0, 200,000   Natwest Group Pic.(c)   USD   4,269 %   22/03/2025   213,120   0, 250,000   Natwest Group Pic.(c)   USD   USD   3,754 %   01/11/2029   263,125   0, 200,000   NatWest Group Pic.(c)   USD   1,200 %   15/05/2023   202,480   0, 100,000   Royalty Pharma Pic.   USD   1,200 %   02/09/2025   98,428   0, 22/09/2025   98,428   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,480   0, 22/09/2025   202,580   0, 22/09/2025   202,580   0, 22/09/2025   202,580   0, 22/09/2025   202,580   0, 22/09/2025   202,580   0, 22/09/2025   202,580   0, 22/09/2							0,00
200,000   Natwest Group PIc. (©)							0,19
250,000   Natwest Group Plc. (c)   USD   3,754 %   01/11/2029   283.125   0, 0, 00   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.0000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.0000   0.0000   0.0000   0.0				·			0,10
200.000   NatWest Group Ptc.   Col.		·					0,12
Setados Unidos		·		·			0,12
Estados Unidos		·					0,05
450.000 AbbVie, Inc.  175.000 AbbVie, Inc.  1850.000 Air Lease Corp.  1850.000 A			_			3.646.607	1,71
175.000 AbbVie, Inc. 150.000 Air Lease Corp. 150.000 Alexandria Real Estate Equities, Inc. 150.000 Aliy Financial, Inc. 150.000 Aliy Financial, Inc. 150.000 Aliy Financial, Inc. 150.000 Aliy Financial, Inc. 150.000 American Corp. 150.000 American Corp. 150.000 American Corp. 150.000 American Corp. 150.000 American Electric Power Co., Inc. 150.000 American Electric Power Co., Inc. 150.000 American Homes 4 Rent LP 150.000 American International Group, Inc. 150	Estados Unido	os					
150.000   AbbVie, Inc.   USD   4,050 %   21/11/2039   172.246   O,   100.000   AbbVie, Inc.   USD   4,700 %   14/05/2045   124.754   O,   40.000   Adventist Health System   USD   2,952 %   O1/03/2029   42.263   O,   150.000   Air Lease Corp.   USD   2,300 %   O1/02/2025   152.679   O,   125.000   Air Lease Corp.   USD   3,375 %   O1/07/2025   131.377   O,   125.000   Air Lease Corp.   USD   3,375 %   O1/07/2025   131.377   O,   125.000   Air Lease Corp.   USD   3,750 %   O1/06/2026   133.169   O,   150.000   Air Lease Corp.   USD   3,750 %   O1/06/2026   133.169   O,   150.000   Alexandria Real Estate Equities, Inc.   USD   3,800 %   15/04/2026   710.047   O,   75.000   Ally Financial, Inc.   USD   4,800 %   O2/10/2023   75.522   O,   75.000   Ally Financial, Inc.   USD   4,800 %   O5/12/2034   417.241   O,   25.000   Amzero.com, Inc.   USD   3,500 %   15/01/2021   77.538   O,   0,000   Amzerican Campus Communities Operating Partnership LP   USD   3,750 %   15/01/2031   27.202   O,   75.000   Amzerican Electric Power Co., Inc.   USD   2,300 %   O1/03/2030   49.478   O,   40.000   American Express Co.   USD   2,300 %   O1/03/2030   49.478   O,   40.000   American Homes 4 Rent LP   USD   2,500 %   30/07/2024   41.428   O,   25.000   American Homes 4 Rent LP   USD   2,375 %   15/02/2029   29.205   O,   90.000   American International Group, Inc.   USD   4,900 %   15/02/2024   26.681   O,   25.000   American International Group, Inc.   USD   3,375 %   15/06/2024   26.681   O,   25.000   American International Group, Inc.   USD   3,375 %   15/06/2024   26.681   O,   25.000   American International Group, Inc.   USD   3,375 %   15/06/2024   26.681   O,   25.000   American International Group, Inc.   USD   4,200 %   01/04/2026   163.920   O,   25.000   American International Group, Inc.   USD   3,375 %   15/06/2024   26.681   O,   25.000   American International Group, Inc.   USD   3,375 %   15/06/2024   26.681   O,   25.000   American International Group, Inc.   USD   3,375 %   15/06/2024   26.681   O,   25.000   2							0,22
100.000   AbbVie, Inc.		•					0,10
40.000       Adventist Health System       USD       2,952 %       01/03/2029       42.263       0,         150.000       Air Lease Corp.       USD       2,300 %       01/02/2025       152.679       0,         125.000       Air Lease Corp.       USD       3,375 %       01/07/2025       131.377       0,         125.000       Air Lease Corp.       USD       2,875 %       15/01/2026       128.769       0,         125.000       Air Lease Corp.       USD       3,750 %       01/06/2026       133.169       0,         650.000       Alexandria Real Estate Equities, Inc.       USD       3,800 %       15/04/2026       710.047       0,         75.000       Ally Financial, Inc.       USD       1,450 %       02/10/2023       75.522       0,         325.000       Amezon.com, Inc.       USD       4,800 %       05/12/2034       417.241       0,         25.000       American Corp.       USD       3,500 %       15/01/2031       27.202       0,         75.000       American Electric Power Co., Inc.       USD       3,750 %       15/04/2033       77.538       0,         50.000       American Express Co.       USD       3,500 %       15/01/2031       27.202       0,							0,08
150.000       Air Lease Corp.       USD       2,300 %       01/02/2025       152.679       0,         125.000       Air Lease Corp.       USD       3,375 %       01/07/2025       131.377       0,         125.000       Air Lease Corp.       USD       2,875 %       15/01/2026       128.769       0,         125.000       Air Lease Corp.       USD       3,750 %       01/06/2026       133.169       0,         650.000       Alexandria Real Estate Equities, Inc.       USD       3,800 %       15/04/2026       710.047       0,         75.000       Ally Financial, Inc.       USD       1,450 %       02/10/2023       75.522       0,         325.000       Amazon.com, Inc.       USD       4,800 %       05/12/2034       417.241       0,         25.000       American Campus Communities Operating Partnership LP       USD       3,500 %       15/04/2023       77.538       0,         50.000       American Electric Power Co., Inc.       USD       2,300 %       01/03/2030       49.478       0,         40.000       American Express Co.       USD       2,500 %       30/07/2024       41.428       0,         25.000       American Homes 4 Rent LP       USD       2,900 %       15/02/2029<		•					0,06
125.000 Air Lease Corp. 125.000 Alexandria Real Estate Equities, Inc. 125.000 Ally Financial, Inc. 125.000 Ally Financial, Inc. 125.000 Amazon.com, Inc. 125.000 American Corp. 125.000 American Campus Communities Operating Partnership LP 125.000 American Electric Power Corp. 125.000 American Electric Power Co., Inc. 125.000 American Express Co. 125.000 American Express Co. 125.000 American Homes 4 Rent LP 125.000 American Homes 4 Rent LP 125.000 American Homes 4 Rent LP 125.000 American International Group, Inc. 125.000 American International Group, Inc. 125.000 American International Group, Inc. 125.000 American Tower Corp. 125.000 American International Group, Inc. 125.000 American International Group, Inc. 125.000 American Tower Corp. 125.000 Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. 125.000 Anheuser-Busch InBev		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					0,02
125.000       Air Lease Corp.       USD       2,875 %       15/01/2026       128.769       0,         125.000       Air Lease Corp.       USD       3,750 %       01/06/2026       133.169       0,         650.000       Alexandria Real Estate Equities, Inc.       USD       3,800 %       15/04/2026       710.047       0,         75.000       Ally Financial, Inc.       USD       1,450 %       02/10/2023       75.522       0,         325.000       Amazon.com, Inc.       USD       4,800 %       05/12/2034       417.241       0,         25.000       American Campus Communities Operating Partnership LP       USD       3,500 %       15/01/2031       27.202       0,         75.000       American Electric Power Co., Inc.       USD       2,300 %       01/03/2030       49.478       0,         40.000       American Express Co.       USD       2,500 %       30/07/2024       41.428       0,         25.000       American Homes 4 Rent LP       USD       4,900 %       15/02/2029       29.205       0,         90.000       American International Group, Inc.       USD       4,125 %       15/07/2031       89.018       0,         25.000       American International Group, Inc.       USD							
125.000       Air Lease Corp.       USD       3,750 %       01/06/2026       133.169       0,         650.000       Alexandria Real Estate Equities, Inc.       USD       3,800 %       15/04/2026       710.047       0,         75.000       Ally Financial, Inc.       USD       1,450 %       02/10/2023       75.522       0,         325.000       Amazon.com, Inc.       USD       4,800 %       05/12/2034       417.241       0,         25.000       American Campus Communities Operating Partnership LP       USD       3,500 %       15/01/2031       27.202       0,         75.000       American Campus Communities Operating Partnership LP       USD       3,750 %       15/04/2023       77.538       0,         50.000       American Electric Power Co., Inc.       USD       2,300 %       01/03/2030       49.478       0,         40.000       American Express Co.       USD       2,500 %       30/07/2024       41.428       0,         25.000       American Homes 4 Rent LP       USD       4,900 %       15/02/2029       29.205       0,         90.000       American International Group, Inc.       USD       4,125 %       15/07/2031       89.018       0,         250.000       American International Group, Inc		•					0,06
650.000         Alexandria Real Estate Equities, Inc.         USD         3,800 %         15/04/2026         710.047         0,75.000           75.000         Ally Financial, Inc.         USD         1,450 %         02/10/2023         75.522         0,325.000           325.000         Amazon.com, Inc.         USD         4,800 %         05/12/2034         417.241         0,000           25.000         Ameren Corp.         USD         3,500 %         15/01/2031         27.202         0,000           75.000         American Campus Communities Operating Partnership LP         USD         3,750 %         15/04/2023         77.538         0,000           50.000         American Electric Power Co., Inc.         USD         2,300 %         01/03/2030         49.478         0,000           40.000         American Express Co.         USD         2,500 %         30/07/2024         41.428         0,000           25.000         American Homes 4 Rent LP         USD         4,900 %         15/02/2029         29.205         0,000           90.000         American International Group, Inc.         USD         4,125 %         15/07/2021         26.681         0,000           150.000         American International Group, Inc.         USD         4,200 %         01/							0,06
75.000         Ally Financial, Inc.         USD         1,450 %         02/10/2023         75.522         0,           325.000         Amazon.com, Inc.         USD         4,800 %         05/12/2034         417.241         0,           25.000         American Compus Communities Operating Partnership LP         USD         3,500 %         15/01/2031         27.202         0,           75.000         American Campus Communities Operating Partnership LP         USD         3,750 %         15/04/2023         77.538         0,           50.000         American Electric Power Co., Inc.         USD         2,300 %         01/03/2030         49.478         0,           40.000         American Express Co.         USD         2,500 %         30/07/2024         41.428         0,           25.000         American Homes 4 Rent LP         USD         4,900 %         15/02/2029         29.205         0,           90.000         American International Group, Inc.         USD         4,125 %         15/07/2031         89.018         0,           150.000         American International Group, Inc.         USD         3,900 %         01/04/2026         163.920         0,           150.000         American Tower Corp.         USD         3,375 %         15/05/2024 <td></td> <td>·</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td>0,00</td>		·					0,00
325.000 Amazon.com, Inc.		•					0,04
25.000         Ameren Corp.         USD         3,500 %         15/01/2031         27.202         0,75.000           75.000         American Campus Communities Operating Partnership LP         USD         3,750 %         15/04/2023         77.538         0,75.000           50.000         American Electric Power Co., Inc.         USD         2,300 %         01/03/2030         49.478         0,94.478         0,90.000         0.70.000         0.70.000         49.478         0,90.000         0.70.000         0.70.000         49.478         0,90.000         0.70.0000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.0000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.0000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.000         0.70.0000         0.70.0000         0.70.0000         0.70.0000         0.70.0000         0.70.0000         0.70.0000         0.70.0							0,04
75.000         American Campus Communities Operating Partnership LP         USD         3,750 %         15/04/2023         77.538         0,           50.000         American Electric Power Co., Inc.         USD         2,300 %         01/03/2030         49.478         0,           40.000         American Express Co.         USD         2,500 %         30/07/2024         41.428         0,           25.000         American Homes 4 Rent LP         USD         4,900 %         15/02/2029         29.205         0,           90.000         American International Group, Inc.         USD         2,375 %         15/07/2031         89.018         0,           25.000         American International Group, Inc.         USD         4,125 %         15/02/2024         26.681         0,           150.000         American International Group, Inc.         USD         3,900 %         01/04/2026         163.920         0,           200.000         American International Group, Inc.         USD         4,200 %         01/04/2028         226.182         0,           150.000         American Tower Corp.         USD         3,375 %         15/05/2024         157.456         0,           125.000         American Tower Corp.         USD         2,400 %         15/03/2025 </td <td></td> <td>•</td> <td></td> <td>•</td> <td></td> <td></td> <td>0,01</td>		•		•			0,01
50.000       American Electric Power Co., Inc.       USD       2,300 %       01/03/2030       49.478       0,         40.000       American Express Co.       USD       2,500 %       30/07/2024       41.428       0,         25.000       American Homes 4 Rent LP       USD       4,900 %       15/02/2029       29.205       0,         90.000       American Homes 4 Rent LP       USD       2,375 %       15/07/2031       89.018       0,         25.000       American International Group, Inc.       USD       4,125 %       15/02/2024       26.681       0,         150.000       American International Group, Inc.       USD       3,900 %       01/04/2026       163.920       0,         200.000       American International Group, Inc.       USD       4,200 %       01/04/2028       226.182       0,         150.000       American Tower Corp.       USD       3,375 %       15/05/2024       157.456       0,         125.000       American Tower Corp.       USD       2,400 %       15/03/2025       128.390       0,         300.000       Anheuser-Busch Cos., LLC Via Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.       USD       4,900 %       01/02/2046       380.511       0,         75.000       Anheuser-Busch InBev Fina		·					0,04
40.000       American Express Co.       USD       2,500 %       30/07/2024       41.428       0,         25.000       American Homes 4 Rent LP       USD       4,900 %       15/02/2029       29.205       0,         90.000       American Homes 4 Rent LP       USD       2,375 %       15/07/2031       89.018       0,         25.000       American International Group, Inc.       USD       4,125 %       15/02/2024       26.681       0,         150.000       American International Group, Inc.       USD       3,900 %       01/04/2026       163.920       0,         200.000       American International Group, Inc.       USD       4,200 %       01/04/2028       226.182       0,         150.000       American Tower Corp.       USD       3,375 %       15/05/2024       157.456       0,         125.000       American Tower Corp.       USD       2,400 %       15/03/2025       128.390       0,         300.000       Anheuser-Busch Cos., LLC Via Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.       USD       4,900 %       01/02/2046       380.511       0,         75.000       Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.       USD       4,900 %       01/02/2036       90.671       0,         150.000       Anheuser-Busch InBev Fi							0,02
25.000       American Homes 4 Rent LP       USD       4,900 %       15/02/2029       29.205       0,         90.000       American Homes 4 Rent LP       USD       2,375 %       15/07/2031       89.018       0,         25.000       American International Group, Inc.       USD       4,125 %       15/02/2024       26.681       0,         150.000       American International Group, Inc.       USD       3,900 %       01/04/2026       163.920       0,         200.000       American International Group, Inc.       USD       4,200 %       01/04/2028       226.182       0,         150.000       American Tower Corp.       USD       3,375 %       15/05/2024       157.456       0,         125.000       American Tower Corp.       USD       2,400 %       15/03/2025       128.390       0,         300.000       Anheuser-Busch Cos., LLC Via Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.       USD       4,900 %       01/02/2046       380.511       0,         75.000       Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.       USD       4,900 %       01/02/2036       90.671       0,         150.000       Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.       USD       4,900 %       01/02/2046       189.066       0,							0,02
25.000       American International Group, Inc.       USD       4,125 %       15/02/2024       26.681       0,         150.000       American International Group, Inc.       USD       3,900 %       01/04/2026       163.920       0,         200.000       American International Group, Inc.       USD       4,200 %       01/04/2028       226.182       0,         150.000       American Tower Corp.       USD       3,375 %       15/05/2024       157.456       0,         125.000       American Tower Corp.       USD       2,400 %       15/03/2025       128.390       0,         300.000       Anheuser-Busch Cos., LLC Via Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.       USD       4,900 %       01/02/2046       380.511       0,         75.000       Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.       USD       4,900 %       01/02/2036       90.671       0,         150.000       Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.       USD       4,900 %       01/02/2046       189.066       0,	25.000	American Homes 4 Rent LP	USD	4,900 %	15/02/2029	29.205	0,0
150.000     American International Group, Inc.     USD     3,900 %     01/04/2026     163.920     0,       200.000     American International Group, Inc.     USD     4,200 %     01/04/2028     226.182     0,       150.000     American Tower Corp.     USD     3,375 %     15/05/2024     157.456     0,       125.000     American Tower Corp.     USD     2,400 %     15/03/2025     128.390     0,       300.000     Anheuser-Busch Cos., LLC Via Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.     USD     4,900 %     01/02/2046     380.511     0,       75.000     Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.     USD     4,900 %     01/02/2036     90.671     0,       150.000     Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.     USD     4,900 %     01/02/2046     189.066     0,	90.000	American Homes 4 Rent LP	USD	2,375 %	15/07/2031	89.018	0,04
200.000     American International Group, Inc.     USD     4,200 %     01/04/2028     226.182     0,       150.000     American Tower Corp.     USD     3,375 %     15/05/2024     157.456     0,       125.000     American Tower Corp.     USD     2,400 %     15/03/2025     128.390     0,       300.000     Anheuser-Busch Cos., LLC Via Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.     USD     4,900 %     01/02/2046     380.511     0,       75.000     Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.     USD     4,900 %     01/02/2036     90.671     0,       150.000     Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.     USD     4,900 %     01/02/2046     189.066     0,							0,0
150.000     American Tower Corp.     USD     3,375 %     15/05/2024     157.456     0,       125.000     American Tower Corp.     USD     2,400 %     15/03/2025     128.390     0,       300.000     Anheuser-Busch Cos., LLC Via Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.     USD     4,900 %     01/02/2046     380.511     0,       75.000     Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.     USD     4,900 %     01/02/2036     90.671     0,       150.000     Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.     USD     4,900 %     01/02/2046     189.066     0,							0,08
125.000     American Tower Corp.     USD     2,400 %     15/03/2025     128.390     0,       300.000     Anheuser-Busch Cos., LLC Via Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.     USD     4,900 %     01/02/2046     380.511     0,       75.000     Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.     USD     4,700 %     01/02/2036     90.671     0,       150.000     Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.     USD     4,900 %     01/02/2046     189.066     0,		• •					0,1
300.000       Anheuser-Busch Cos., LLC Via Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.       USD       4,900 %       01/02/2046       380.511       0,         75.000       Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.       USD       4,700 %       01/02/2036       90.671       0,         150.000       Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.       USD       4,900 %       01/02/2046       189.066       0,		•					0,07
75.000 Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. USD 4,700 % 01/02/2036 90.671 0, 150.000 Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. USD 4,900 % 01/02/2046 189.066 0,		•					0,06
150.000 Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. USD 4,900 % 01/02/2046 189.066 0,							0,18
							0,04
25.000 Armeuser-busch inbev vvondwide, inc. USD 4,750 % 23/01/2029 29.176 0,							0,09
	∠5.000	ATTITICUSCI-DUSCIT ITIDEV VVOITUWIUE, ITIC.	טפט	4,750 %	23/01/2029	29.176	0,01

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos – (con	<u> </u>		•			
	s – (continuación)					
	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	USD	4,950 %	15/01/2042	31.375	0,01
	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	USD	4,600 %	15/04/2048	245.490	0,11
	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	USD	5,550 %	23/01/2049	657.048	0,31
	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	USD	4,500 %	01/06/2050	92.751	0,04
	Apple, Inc.	USD	2,450 %	04/08/2026	261.255	0,12
	Arch Capital Finance LLC	USD	4,011 %	15/12/2026	305.134	0,14
200.000	Ashtead Capital, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,450 %	12/08/2031	196.686	0,09
475.000	AT&T, Inc.	USD	2,300 %	01/06/2027	484.395	0,23
25.000	AT&T, Inc.	USD	1,650 %	01/02/2028	24.387	0,01
100.000	AT&T, Inc.	USD	2,750 %	01/06/2031	101.765	0,05
408.000	AT&T, Inc.	USD	2,550 %	01/12/2033	395.548	0,19
90.000	AT&T, Inc.	USD	4,900 %	15/08/2037	109.348	0,05
190.000	AT&T, Inc.	USD	4,850 %	01/03/2039	228.627	0,11
100.000	AT&T, Inc.	USD	3,500 %	01/06/2041	103.204	0,05
750.000	AT&T, Inc.	USD	5,150 %	15/11/2046	962.730	0,45
50.000	AT&T, Inc.	USD	5,150 %	15/02/2050	64.319	0,03
	AT&T, Inc.	USD	3,650 %	01/06/2051	78.155	0,04
	AT&T, Inc. – Serie WI	USD	3,500 %	15/09/2053	25.331	0,01
	AutoNation, Inc.	USD	1,950 %	01/08/2028	49.056	0,02
	AutoNation, Inc.	USD	4,750 %	01/06/2030	87.121	0,04
	Avangrid, Inc.	USD	3,200 %	15/04/2025	79.344	0,04
	•	USD				
	Bank of America Corp. (c)		3,864 %	23/07/2024	183.216	0,09
	Bank of America Corp.	USD	4,200 %	26/08/2024	107.370	0,05
	Bank of America Corp.(c)	USD	3,593 %	21/07/2028	134.826	0,06
	Bank of America Corp. (c)	USD	2,884 %	22/10/2030	103.671	0,05
	Bank of America Corp.(c)	USD	2,496 %	13/02/2031	25.075	0,01
	Bank of America Corp. (c)	USD	2,592 %	29/04/2031	126.590	0,06
	Bank of America Corp.(c)	USD	1,898 %	23/07/2031	287.487	0,13
350.000	Bank of America Corp. (c)	USD	1,922 %	24/10/2031	335.023	0,16
330.000	Bank of America Corp. (c)	USD	2,299 %	21/07/2032	324.674	0,15
250.000	Bank of America Corp.(c)	USD	2,482 %	21/09/2036	242.457	0,11
975.000	Bank of America Corp. – Serie L	USD	4,183 %	25/11/2027	1.069.955	0,50
230.000	Banner Health	USD	2,338 %	01/01/2030	233.855	0,11
175.000	BAT Capital Corp.	USD	2,259 %	25/03/2028	171.479	0,08
	BAT Capital Corp.	USD	4,758 %	06/09/2049	26.986	0,01
	Baylor Scott & White Holdings – Serie 2021	USD	1,777 %	15/11/2030	78.043	0,04
	Becton Dickinson and Co.	USD	3,363 %	06/06/2024	59.890	0,03
	Becton Dickinson and Co.	USD	2,823 %	20/05/2030	103.680	0,05
	Berry Global, Inc.	USD	1,570 %	15/01/2026	785.000	0,37
	Boeing Co.	USD	3,450 %	01/11/2028	972.582	0,46
		USD		01/03/2048	25.115	0,40
	Boeing Co.		3,625 %			
	BP Capital Markets America, Inc.	USD	3,224 %	14/04/2024	105.257	0,05
	Bristol-Myers Squibb Co.	USD	3,250 %	01/08/2042	219.486	0,10
	Burlington Northern Santa Fe LLC	USD	4,050 %	15/06/2048	91.257	0,04
	Capital One Financial Corp.	USD	3,300 %	30/10/2024	100.364	0,05
	Carrier Global Corp.	USD	2,493 %	15/02/2027	359.373	0,17
	CenterPoint Energy, Inc. Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications	USD	2,950 %	01/03/2030	52.125	0,02
	Operating Capital	USD	4,908 %	23/07/2025	774.403	0,36
	Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications Operating Capital	USD	3,750 %	15/02/2028	700.635	0,33
50.000	Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications	1100	= 07= A:	04/04/00555	00.0:-	2.25
075 000	Operating Capital	USD	5,375 %	01/04/2038	60.315	0,03
	Cigna Corp.	USD	4,125 %	15/11/2025	301.053	0,14
	Cigna Corp.	USD	3,400 %	15/03/2050	184.583	0,09
	CIT Bank NA <sup>(c)</sup>	USD	2,969 %	27/09/2025	255.242	0,12
	Citigroup, Inc.	USD	4,600 %	09/03/2026	222.162	0,10
	Citigroup, Inc.	USD	3,400 %	01/05/2026	161.466	0,08
350.000	Citigroup, Inc.	USD	4,450 %	29/09/2027	390.351	0,18
625.000	Citigroup, Inc.(c)	USD	3,668 %	24/07/2028	675.281	0,32
100.000	Citigroup, Inc.	USD	4,125 %	25/07/2028	110.321	0,05
	Citigroup, Inc.(c)	USD	2,976 %	05/11/2030	78.089	0,04
	Comcast Corp.	USD	3,700 %	15/04/2024	106.244	0,05
	Comcast Corp.	USD	3,950 %	15/10/2025	109.285	0,05
	Comcast Corp.	USD	3,150 %	01/03/2026	266.822	0,03
	Comcast Corp.	USD	3,300 %	01/02/2027	73.214	0,12
	Comcast Corp.					
		USD	3,150 %	15/02/2028	107.419	0,05
	Comcast Corp.	USD	4,150 %	15/10/2028	227.094	0,11
	Comcast Corp.	USD	4,250 %	15/10/2030	86.635	0,04
	Comcast Corp.	USD	3,750 %	01/04/2040	28.065	0,01
25.000	Comcast Corp.	USD	3,400 %	15/07/2046	26.774	0,01

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos – (con	·					
	os – (continuación)	HCD	4.700.0/	15/10/2010	22.474	0.00
	Company Spirit Health	USD USD	4,700 %	15/10/2048	32.474 195.429	0,02 0,09
	CommonSpirit Health Constellation Brands, Inc.	USD	3,910 % 4,400 %	01/10/2050	110.458	0,09
	Constellation Brands, Inc.	USD	4,400 % 3,700 %	15/11/2025 06/12/2026	54.461	0,03
	Constellation Brands, Inc.	USD	3,600 %	15/02/2028	108.899	0,03
		USD				
	Constellation Brands, Inc. Continental Resources, Inc.	USD	3,150 % 4,500 %	01/08/2029 15/04/2023	79.249 63.097	0,04 0,03
	Crown Castle International Corp.	USD	3,150 %	15/07/2023	258.892	0,03
	Crown Castle International Corp.	USD	4,150 %	01/07/2050	28.564	0,12
	CubeSmart LP	USD	4,000 %	15/11/2025	217.132	0,10
	CubeSmart LP	USD	2,500 %	15/02/2032	224.599	0,10
	CVS Health Corp.	USD	2,625 %	15/08/2024	928.455	0,11
	·	USD		20/07/2025	243.088	0,43
	CVS Health Corp.	USD	3,875 %		61.072	0,11
	CVS Health Corp. CVS Health Corp.	USD	4,780 % 5,125 %	25/03/2038 20/07/2045	32.793	0,03
	•					
	CVS Health Corp.	USD USD	5,050 %	25/03/2048	33.026	0,02 0,07
	CVS Health Corp.	USD	4,250 %	01/04/2050	151.697	
	Dell International LLC Via EMC Corp.		5,450 %	15/06/2023	143.508	0,07
	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	5,850 %	15/07/2025	57.346	0,03
	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	6,200 %	15/07/2030	31.814	0,01
	Dentsply Sirona, Inc.	USD	3,250 %	01/06/2030	79.430	0,04
	Devon Energy Corp.	USD	5,850 %	15/12/2025	814.887	0,38
	Discover Financial Services	USD	3,750 %	04/03/2025	133.390	0,06
	Dollar Tree, Inc.	USD	4,000 %	15/05/2025	215.886	0,10
	Dominion Energy, Inc. <sup>(e)</sup>	USD	3,071 %	15/08/2024	156.732	0,07
	Duke Energy Corp.	USD	3,150 %	15/08/2027	501.624	0,23
	Duke Realty LP	USD	1,750 %	01/07/2030	72.044	0,03
	DuPont de Nemours, Inc.	USD	4,205 %	15/11/2023	79.505	0,04
	DuPont de Nemours, Inc.	USD	4,493 %	15/11/2025	83.116	0,04
	DuPont de Nemours, Inc.	USD	5,419 %	15/11/2048	35.293	0,02
	Elanco Animal Health, Inc.	USD	5,272 %	28/08/2023	53.150	0,02
	Emory University – Serie 2020	USD	2,143 %	01/09/2030	276.817	0,13
	Energy Transfer LP	USD	4,250 %	01/04/2024	52.782	0,02
	Energy Transfer LP	USD	2,900 %	15/05/2025	129.404	0,06
	Energy Transfer LP	USD	5,300 %	15/04/2047	57.980	0,03
	Energy Transfer LP – Serie 5 a	USD	4,200 %	15/09/2023	183.977	0,09
	Energy Transfer Operating LP	USD	5,250 %	15/04/2029	143.089	0,07
	Entergy Corp.	USD	2,950 %	01/09/2026	104.983	0,05
	Exelon Corp.	USD	3,497 %	01/06/2022	227.722	0,11
	Exelon Corp.	USD	4,050 %	15/04/2030	56.305	0,03
75.000	Expedia Group, Inc.	USD	3,600 %	15/12/2023	78.468	0,04
125.000	Expedia Group, Inc.	USD	4,500 %	15/08/2024	134.385	0,06
50.000	Expedia Group, Inc.	USD	4,625 %	01/08/2027	56.005	0,03
100.000	Expedia Group, Inc.	USD	3,800 %	15/02/2028	107.244	0,05
75.000	Expedia Group, Inc.	USD	2,950 %	15/03/2031	75.725	0,04
400.000	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	6,250 %	15/05/2029	535.240	0,25
5.580.000	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	0,875 %	05/08/2030	5.279.796	2,47
75.000	FedEx Corp.	USD	5,250 %	15/05/2050	101.433	0,05
90.000	Fifth Third Bancorp	USD	2,375 %	28/01/2025	92.899	0,04
175.000	FirstEnergy Corp.	USD	2,650 %	01/03/2030	172.354	0,08
75.000	FirstEnergy Corp. – Serie B	USD	2,250 %	01/09/2030	71.498	0,03
	Fiserv, Inc.	USD	2,750 %	01/07/2024	181.548	0,09
125.000	Fiserv, Inc.	USD	3,200 %	01/07/2026	132.217	0,06
75.000	Fiserv, Inc.	USD	4,200 %	01/10/2028	83.982	0,04
75.000	Fox Corp.	USD	4,030 %	25/01/2024	79.604	0,04
25.000	General Electric Co.	USD	2,700 %	09/10/2022	25.446	0,01
	General Electric Co.	USD	3,450 %	01/05/2027	27.338	0,01
	General Electric Co.	USD	3,625 %	01/05/2030	56.722	0,03
	General Electric Co.	USD	5,875 %	14/01/2038	595.467	0,28
	General Electric Co.	USD	4,250 %	01/05/2040	62.020	0,03
	General Motors Co.	USD	5,400 %	02/10/2023	134.859	0,06
	General Motors Co.	USD	4,000 %	01/04/2025	26.863	0,01
	General Motors Financial Co., Inc.	USD	4,300 %	13/07/2025	54.176	0,01
	General Motors Financial Co., Inc.	USD	1,500 %	10/06/2026	393.696	0,03
	General Motors Financial Co., Inc.	USD	5,650 %	17/01/2029	29.794	0,18
	Hewlett Packard Enterprise Co.	USD	4,450 %	02/10/2023	344.376	0,01
	Hewlett Packard Enterprise Co.  Hewlett Packard Enterprise Co.	USD	4,450 % 4,900 %	15/10/2025	250.688	0,16
	•					
	Hewlett Packard Enterprise Co.	USD	6,350 %	15/10/2045	81.242	0,04
	Huntington Rangebargs, Inc.	USD	3,900 %	06/12/2028	56.628 162.558	0,03
	Huntington Bancshares, Inc.	USD	4,000 %	15/05/2025	162.558	0,08
100.000	Huntsman International LLC	USD	2,950 %	15/06/2031	101.625	0,05

				(6)	Valor de mercado en	% del
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	USD	patrimonio
Bonos – (con Estados Unido	tinuacion) s – (continuación)					
	Hyatt Hotels Corp.	USD	1,800 %	01/10/2024	250.440	0,12
	Intercontinental Exchange, Inc.	USD	3,000 %	15/06/2050	100.109	0,05
	Intuit, Inc.	USD	1,350 %	15/07/2027	49.268	0,02
	Invitation Homes Operating Partnership LP Invitation Homes Operating Partnership LP	USD USD	2,300 % 2,000 %	15/11/2028 15/08/2031	149.533 508.785	0,07 0,24
	ITC Holdings Corp.	USD	3,350 %	15/11/2027	187.605	0,09
	JPMorgan Chase & Co.(c)	USD	3,559 %	23/04/2024	51.925	0,02
	JPMorgan Chase & Co. (c)	USD	3,797 %	23/07/2024	52.340	0,02
	JPMorgan Chase & Co. (c)	USD USD	4,023 %	05/12/2024	264.767	0,12
	JPMorgan Chase & Co. <sup>(c)</sup> JPMorgan Chase & Co.	USD	3,960 % 3,625 %	29/01/2027 01/12/2027	217.506 215.256	0,10 0,10
	JPMorgan Chase & Co. <sup>(c)</sup>	USD	4,452 %	05/12/2029	56.887	0,03
25.000	JPMorgan Chase & Co.(c)	USD	4,493 %	24/03/2031	28.900	0,01
	JPMorgan Chase & Co.(c)	USD	2,956 %	13/05/2031	77.623	0,04
	JPMorgan Chase & Co. (c)	USD	3,882 %	24/07/2038	200.417	0,09
	JPMorgan Chase & Co. – Serie HH <sup>(c)</sup> Keurig Dr Pepper, Inc.	USD USD	4,600 % 4,057 %	Perp. 25/05/2023	201.616 1.321.035	0,09 0,62
	Keurig Dr Pepper, Inc.	USD	4,417 %	25/05/2025	54.779	0,02
	Keurig Dr Pepper, Inc.	USD	3,800 %	01/05/2050	28.101	0,01
75.000	Keysight Technologies, Inc.	USD	3,000 %	30/10/2029	78.851	0,04
	Kinder Morgan Energy Partners LP	USD	3,450 %	15/02/2023	205.058	0,10
	Kraft Heinz Foods Co.	USD	3,750 %	01/04/2030	71.067 220.581	0,03
	Lowe's Cos., Inc. Lowe's Cos., Inc.	USD USD	1,700 % 1,700 %	15/09/2028 15/10/2030	166.553	0,10 0,08
	Lowe's Cos., Inc.	USD	3,000 %	15/10/2050	200.882	0,09
	Marathon Petroleum Corp.	USD	4,500 %	01/05/2023	183.599	0,09
50.000	Marathon Petroleum Corp.	USD	3,625 %	15/09/2024	52.898	0,02
	Marsh & McLennan Cos., Inc.	USD	4,375 %	15/03/2029	258.421	0,12
	Martin Marietta Materials, Inc. Masco Corp.	USD USD	3,200 % 1,500 %	15/07/2051	437.393	0,20 0,24
	McDonald's Corp.	USD	4,450 %	15/02/2028 01/09/2048	507.664 31.166	0,24
	McDonald's Corp.	USD	4,200 %	01/04/2050	30.429	0,01
	Micron Technology, Inc.	USD	2,703 %	15/04/2032	176.241	0,08
	Morgan Stanley	USD	4,875 %	01/11/2022	103.837	0,05
	Morgan Stanley <sup>(c)</sup>	USD	3,737 %	24/04/2024	77.939	0,04
	Morgan Stanley Morgan Stanley <sup>(c)</sup>	USD USD	3,700 % 2,720 %	23/10/2024 22/07/2025	427.712 77.583	0,20 0,04
	Morgan Stanley	USD	4,000 %	23/07/2025	27.186	0,04
	Morgan Stanley	USD	3,950 %	23/04/2027	1.044.449	0,49
	Morgan Stanley <sup>(c)</sup>	USD	4,431 %	23/01/2030	57.085	0,03
	Morgan Stanley <sup>(c)</sup>	USD	2,699 %	22/01/2031	333.960	0,16
	Morgan Stanley <sup>(c)</sup>	USD	3,622 %	01/04/2031	109.518	0,05
	Morgan Stanley <sup>(c)</sup> Morgan Stanley <sup>(c)</sup>	USD USD	1,794 % 2,484 %	13/02/2032 16/09/2036	165.776 361.789	0,08 0,17
	Morgan Stanley – Serie F	USD	3,875 %	29/04/2024	53.193	0,03
	MPLX LP	USD	2,650 %	15/08/2030	148.717	0,07
	MPLX LP	USD	4,500 %	15/04/2038	55.982	0,03
	MPLX LP	USD	5,500 %	15/02/2049	63.483	0,03
	Nasdaq, Inc. National Retail Properties, Inc.	USD USD	3,250 % 3,900 %	28/04/2050 15/06/2024	25.802 74.546	0,01 0,03
	National Retail Properties, Inc.	USD	4,000 %	15/11/2025	164.169	0,03
	Nature Conservancy – Serie A	USD	1,304 %	01/07/2028	24.576	0,01
270.000	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	USD	1,900 %	15/06/2028	267.613	0,13
	NiSource, Inc.	USD	3,490 %	15/05/2027	269.517	0,13
	NiSource, Inc.	USD USD	3,600 %	01/05/2030 15/08/2024	27.019	0,01
	Occidental Petroleum Corp. Oracle Corp.	USD	2,900 % 2,875 %	25/03/2031	227.531 563.887	0,11 0,26
	Oracle Corp.	USD	3,600 %	01/04/2040	78.009	0,04
	Oracle Corp.	USD	3,850 %	01/04/2060	104.031	0,05
	Ovintiv Exploration, Inc.	USD	5,625 %	01/07/2024	219.132	0,10
	Pacific Gas and Electric Co.	USD	2,100 %	01/08/2027	72.717	0,03
	Pacific Gas and Electric Co. Pacific Gas and Electric Co.	USD USD	3,000 % 2,500 %	15/06/2028 01/02/2031	276.490 72.016	0,13 0,03
	Pacific Gas and Electric Co.	USD	3,300 %	01/08/2040	23.817	0,03
	Pacific Gas and Electric Co.	USD	3,500 %	01/08/2050	47.697	0,02
	PayPal Holdings, Inc.	USD	1,650 %	01/06/2025	278.462	0,13
	PayPal Holdings, Inc.	USD	2,650 %	01/10/2026	210.666	0,10
	Phillips 66	USD	3,700 %	06/04/2023	103.742	0,05
	Phillips 66 Phillips 66	USD USD	3,850 % 1,300 %	09/04/2025 15/02/2026	26.810 49.164	0,01 0,02
	Plains All American Pipeline LP Via PAA Finance Corp.	USD	3,850 %	15/10/2023	391.534	0,18
	•		•			•

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos – (con	<u> </u>	Divisa	ripo de interes	recha de vencimiento.	030	patrimonio
•	s – (continuación)					
50.000	Plains All American Pipeline LP Via PAA Finance Corp.	USD	3,800 %	15/09/2030	52.533	0,02
	Progress Energy, Inc.	USD	7,000 %	30/10/2031	102.461	0,05
	Realty Income Corp.	USD	4,625 %	01/11/2025	195.186	0,09
	Realty Income Corp.	USD	3,400 %	15/01/2028	53.908	0,03
	Realty Income Corp.	USD	2,850 %	15/12/2032	104.501	0,05
	Republic Services, Inc. Rush Obligated Group – Serie 2020	USD USD	2,500 % 3,922 %	15/08/2024 15/11/2029	129.291 56.110	0,06 0,03
	Sabine Pass Liquefaction LLC	USD	5,625 %	15/04/2023	105.247	0,03
	Sabine Pass Liquefaction LLC	USD	5,625 % 5,625 %	01/03/2025	139.516	0,03
	Sabine Pass Liquefaction LLC	USD	5,000 %	15/03/2027	56.457	0,03
	ServiceNow, Inc.	USD	1,400 %	01/09/2030	679.941	0,32
	Sherwin-Williams Co.	USD	3,450 %	01/06/2027	81.132	0,04
400.000	Sherwin-Williams Co.	USD	2,950 %	15/08/2029	421.472	0,20
25.000	Skyworks Solutions, Inc.	USD	3,000 %	01/06/2031	25.501	0,01
75.000	Southern California Edison Co. – Serie A	USD	4,200 %	01/03/2029	84.330	0,04
250.000	Southern Co.	USD	3,250 %	01/07/2026	264.615	0,12
	Spirit Realty LP	USD	3,400 %	15/01/2030	184.522	0,09
	Stanford Health Care – Serie 2020	USD	3,310 %	15/08/2030	59.546	0,03
	Stanley Black & Decker, Inc.	USD	4,250 %	15/11/2028	548.782	0,26
	Starbucks Corp.	USD	3,800 %	15/08/2025	162.390	0,08
	Steel Dynamics, Inc.	USD	2,400 %	15/06/2025	30.855	0,01
	Steel Dynamics, Inc.	USD USD	1,650 %	15/10/2027	73.313	0,03
	Sysco Corp. Sysco Corp.	USD	4,450 % 6,600 %	15/03/2048 01/04/2050	29.891 39.533	0,01 0,02
	Thermo Fisher Scientific, Inc.	USD	4,100 %	15/08/2047	31.367	0,02
	Time Warner Cable LLC	USD	5,875 %	15/11/2040	31.507	0,01
	T-Mobile USA, Inc.	USD	3,500 %	15/04/2025	159.088	0,07
	T-Mobile USA, Inc.	USD	1,500 %	15/02/2026	99.041	0,05
	T-Mobile USA, Inc.	USD	3,750 %	15/04/2027	80.940	0,04
275.000	T-Mobile USA, Inc.	USD	2,050 %	15/02/2028	271.788	0,13
200.000	T-Mobile USA, Inc.	USD	3,875 %	15/04/2030	217.728	0,10
250.000	T-Mobile USA, Inc.	USD	2,875 %	15/02/2031	243.375	0,11
275.000	T-Mobile USA, Inc.	USD	3,500 %	15/04/2031	284.409	0,13
	T-Mobile USA, Inc.	USD	3,000 %	15/02/2041	47.965	0,02
	Tyson Foods, Inc.	USD	3,900 %	28/09/2023	105.340	0,05
	UDR, Inc.	USD	2,100 %	01/08/2032	48.093	0,02
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	0,250 %	15/05/2024	14.785.370	6,92
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	0,250 %	31/10/2025	4.470.805	2,09
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD USD	0,750 %	31/03/2026 30/11/2026	1.441.636 2.043.798	0,67 0,96
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU. Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	1,250 % 1,250 %	31/03/2028	1.507.523	0,90
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	2,875 %	15/05/2028	318.683	0,15
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	2,875 %	15/08/2028	1.508.712	0,71
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	4,375 %	15/11/2039	1.185.122	0,55
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	2,375 %	15/11/2049	2.798.721	1,31
2.590.000	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	2,000 %	15/02/2050	2.691.981	1,26
1.450.000	Cupones de bonos strip del Tesoro de Estados Unidos	USD	1,784 %	15/02/2038	1.082.708	0,51
2.690.000	Cupones de bonos strip del Tesoro de Estados Unidos	USD	1,823 %	15/08/2038	1.983.027	0,93
	US Bancorp <sup>(c)</sup>	USD	3,700 %	Perp.	270.022	0,13
	Valero Energy Corp.	USD	2,700 %	15/04/2023	154.140	0,07
	Ventas Realty LP	USD	3,500 %	01/02/2025	159.066	0,07
	Verizon Communications, Inc.	USD	2,100 %	22/03/2028	2.185.581	1,02
	Verizon Communications, Inc.	USD	2,550 %	21/03/2031	227.576	0,11
	Verizon Communications, Inc.	USD	5,250 %	16/03/2037	558.191	0,26
	Verizon Communications, Inc. Verizon Communications, Inc.	USD USD	4,812 %	15/03/2039	282.692	0,13 0,04
	VMware, Inc.	USD	2,987 % 1,800 %	30/10/2056 15/08/2028	77.000 73.108	0,04
	VMware, Inc.	USD	2,200 %	15/08/2031	243.745	0,03
	Walt Disney Co.	USD	4,000 %	01/10/2023	609.506	0,11
	Waste Management, Inc.	USD	1,150 %	15/03/2028	429.867	0,20
	Wells Fargo & Co.	USD	3,750 %	24/01/2024	84.530	0,04
	Wells Fargo & Co.	USD	3,000 %	23/10/2026	316.851	0,15
300.000	Wells Fargo & Co.	USD	4,300 %	22/07/2027	334.347	0,16
	Wells Fargo & Co.(c)	USD	5,013 %	04/04/2051	173.189	0,08
	Western Midstream Operating LP	USD	4,350 %	01/02/2025	104.125	0,05
	Western Midstream Operating LP	USD	3,950 %	01/06/2025	52.125	0,02
	Western Midstream Operating LP	USD	5,450 %	01/04/2044	29.250	0,01
	Williams Cos., Inc.	USD	3,600 %	15/03/2022	130.394	0,06
	Williams Cos., Inc.	USD	4,000 %	15/09/2025	189.553	0,09
	Willis North America, Inc.	USD	2,950 %	15/09/2029	51.704	0,02
ან.000	WP Carey, Inc.	USD	4,600 %	01/04/2024	37.442	0,02

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
Estados Unido	os – (continuación)					
	WP Carey, Inc.	USD	4,000 %	01/02/2025	37.602	0,02
	WP Carey, Inc.	USD	3,850 %	15/07/2029	55.451	0,03
50.000	WP Carey, Inc.	USD _	2,400 %	01/02/2031	49.611 97.810.649	0,02 45,77
Uruguay						
TOTAL DE BOI	Bonos internacionales del Estado de Uruguay  NOS	USD	4,375 %	23/01/2031	34.421	0,02
(coste USD 12	3.874.621)				125.007.688	58,50
Tenencias	Descripción del valor				Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Fondos de inv	versión – 7,36 %					
Irlanda						
15.723.195	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de a distribución $\mathbf{X})^{(0 9)}$	icciones de			15.723.195	7,36
TOTAL DE FON (coste USD 15.	NDOS DE INVERSIÓN .723.195)				15.723.195	7,36
TOTAL DE VAL	ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOI	LSA DE				
(coste USD 13					140.730.883	65,86
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Valores mobil	liarios negociados en otro mercado regulado					
Bonos - 6,60	%					
Bermudas						
200.000	Bacardi Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,300 %	15/05/2048	270.652	0,13
Islas Caimán 175.000	Avolon Holdings Funding Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,250 %	15/04/2026	187.142	0,09
Francia	7. Total Holdings Fallaning 2.td. 1177.		1,200 70	10/0 112020		
	BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,500 %	01/03/2023	258.625	0,12
	BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,375 %	09/01/2025	211.270	0,10
	BNP Paribas S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,323 %	13/01/2027	366.405	0,17
250.000	BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,000 %	12/09/2023	263.287	0,13
250.000	BPCE S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD _	2,277 %	20/01/2032	240.858	0,11
Hong Kong					1.340.445	0,63
	AIA Group Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,900 %	06/04/2028	222.628	0,10
Países Bajos						
525.000	Enel Finance International NV 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,875 %	12/07/2028	515.660	0,24
300.000	ING Groep NV 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,400 %	01/07/2026	298.200	0,14
	JDE Peet's NV 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,375 %	15/01/2027	195.028	0,09
300.000	Lundin Energy Finance BV 144A <sup>(d)</sup>	USD _	2,000 %	15/07/2026	299.202	0,14
					1.308.090	0,61
Supranacional			2 402 2	04/05/0000	20.65-	
	NXP BV Via NXP Funding LLC Via NXP USA, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,400 %	01/05/2030	80.265	0,04
175.000	NXP BV Via NXP Funding LLC Via NXP USA, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD _	2,500 %	11/05/2031	175.704	0,08
0					255.969	0,12
<b>Suiza</b> 250.000	Credit Suisse Group AG 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	4,194 %	01/04/2031	275.377	0,13
Reino Unido 200.000	Weir Group Plc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,200 %	13/05/2026	197.750	0,09
Estados Unido			2,200 /0	15, 55, 2520		
	7-Eleven, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,300 %	10/02/2028	620.061	0,29
	Alliant Energy Finance LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,750 %	15/06/2023	78.070	0,04
	Aviation Capital Group LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,950 %	30/01/2026	123.424	0,06
	Baxter International, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,272 %	01/12/2028	226.807	0,11
	Baxter International, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,539 %	01/02/2032	227.522	0,11
	Bay Area Toll Authority	USD	1,633 %	01/04/2028	50.144	0,02
375.000	Bayer US Finance II LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,875 %	15/12/2023	395.025	0,18

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
	os – (continuación)					
	Broadcom, Inc. 144A(d)	USD	3,137 %	15/11/2035	1.114.200	0,52
	Broadcom, Inc. 144A <sup>(d)</sup> California Statewide Communities Development Authority	USD USD	3,500 % 1,877 %	15/02/2041 01/02/2031	125.204 29.778	0,06 0,01
	City & County of Denver Co. Airport System Revenue	USD	2,137 %	15/11/2029	667.862	0,31
	City of Houston TX Airport System Revenue	USD	2,235 %	01/07/2029	638.493	0,30
	City of Los Angeles Department of Airports	USD	1,513 %	15/05/2029	720.662	0,34
	City of New York NY "D"	USD	1,396 %	01/08/2027	646.413	0,30
	City of San Francisco CA Public Utilities Commission Water Revenue "B"	USD	6,000 %	01/11/2040	277.743	0,13
	City of Tucson AZ	USD	1,932 %	01/07/2031	49.522	0,02
	CoStar Group, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Ecolab, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD	2,800 % 2,750 %	15/07/2030 18/08/2055	152.821 40.135	0,07 0,02
	Glencore Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,625 %	29/04/2024	191.298	0,02
	Glencore Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,625 %	23/09/2031	364.777	0,17
	Great-West Lifeco Finance 2018 LP 144A(d)	USD	4,047 %	17/05/2028	56.711	0,03
150.000	International Flavors & Fragrances, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,832 %	15/10/2027	148.153	0,07
	International Flavors & Fragrances, Inc. 144A(d)	USD	2,300 %	01/11/2030	271.007	0,13
	Metropolitan Transportation Authority	USD	5,989 %	15/11/2030	31.371	0,01
	Metropolitan Transportation Authority	USD	5,175 %	15/11/2049	279.172	0,13
	Municipal Improvement Corporation of Los Angeles	USD	1,831 %	01/11/2029	24.867	0,01
	Municipal Improvement Corporation of Los Angeles "A"  Municipal Improvement Corporation of Los Angeles "A"	USD USD	1,648 % 2,074 %	01/11/2028 01/11/2030	49.630 156.550	0,02 0,07
	Netflix, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,875 %	15/06/2030	231.125	0,11
	New Jersey Turnpike Authority	USD	1,483 %	01/01/2028	4.933	0,00
	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue		3,590 %	01/08/2027	72.068	0,03
	New York Life Insurance Co. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,750 %	15/05/2050	231.586	0,11
300.000	Penske Truck Leasing Co. LP Via PTL Finance Corp. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,250 %	17/01/2023	311.628	0,15
130.000	Port Authority of New York & New Jersey	USD	1,086 %	01/07/2023	131.197	0,06
	Port Authority of New York & New Jersey	USD	4,810 %	15/10/2065	180.637	0,08
	Port of Oakland	USD	1,949 %	01/05/2028	25.341	0,01
	San Francisco Municipal Transportation Agency	USD	1,302 %	01/03/2028	34.393	0,02
	San Jose Financing Authority	USD	1,862 %	01/06/2030	24.863	0,01
	State Board of Administration Finance Corp. State of California	USD USD	2,154 % 7,500 %	01/07/2030 01/04/2034	282.189 186.577	0,13 0,09
	State of California	USD	7,625 %	01/03/2040	75.546	0,03
	State of Illinois	USD	6,630 %	01/02/2035	86.972	0,04
	State of Illinois	USD	7,350 %	01/07/2035	307.369	0,14
35.000	State of Maryland Department of Transportation	USD	1,303 %	01/08/2028	34.173	0,02
75.000	Vistra Operations Co., LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,550 %	15/07/2024	77.950	0,04
					10.055.969	4,70
TOTAL DE BO (coste USD 13					14.114.022	6,60
_	con garantía de activos emitidos o garantizados por agencias -	- 29,16	%			
Estados Unido		LICD	0.540.0/	45/05/2024	E 440	0.00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD USD	0,510 %	15/05/2024 01/03/2027	5.449 7.959	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	7,500 % 6,500 %	15/12/2028	99.427	0,00 0,05
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/08/2033	1.228	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/12/2034	5.032	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/12/2034	8.344	0,00
39	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/11/2035	42	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/12/2035	6.446	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/02/2037	6.159	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/06/2039	1.385	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/06/2039	14.840 396.906	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD USD	4,500 % 4,500 %	01/08/2048 01/11/2048	122.374	0,19 0,06
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/11/2048	1.812.211	0,06
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/02/2049	157.774	0,03
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/08/2049	669.821	0,31
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/09/2049	792.203	0,37
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	2,500 %	01/09/2051	1.020.063	0,48
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	2,500 %	01/09/2051	1.019.714	0,48
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,700 %	25/01/2034	90.634	0,04
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,092 %	25/06/2050	24.622	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup> Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD USD	2,850 % 5,500 %	25/10/2050 01/09/2023	57.490 504	0,03 0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,500 % 5,500 %	01/09/2023	273	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,500 %	01/10/2023	567	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	7,000 %	01/03/2031	3.918	0,00

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Obligaciones	con garantía de activos emitidos o garantizados por a	gencias – (conti	nuación)			
	s – (continuación)	• ,				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	7,000 %	25/07/2042	44.446	0,02
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	7,000 %	25/10/2042	7.910	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA) Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD USD	3,000 %	01/01/2043	9.620	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 % 3,000 %	01/01/2043 01/03/2043	19.386 11.121	0,01 0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/03/2043	85.043	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/03/2043	28.024	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/04/2043	11.249	0,01
22.500	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/04/2043	24.051	0,01
19.158	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/04/2043	20.478	0,01
13.141	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/04/2043	14.047	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/04/2043	105.474	0,05
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/05/2043	13.220	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/05/2043	52.235	0,02
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/05/2043 01/06/2047	57.919 91.710	0,03
	Federal National Mortgage Association (FNMA) Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD USD	4,000 % 4,000 %	01/01/2048	281.149	0,04 0,13
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	01/02/2048	210.220	0,10
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	01/02/2048	198.256	0,09
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	01/02/2048	321.651	0,15
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	01/03/2048	243.317	0,11
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/08/2048	603.846	0,28
128.433	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/11/2048	138.484	0,07
364.503	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/11/2048	406.417	0,19
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/03/2049	37.109	0,02
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/06/2049	6.054	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/12/2049	788.509	0,37
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	2,500 %	01/09/2051	1.022.245	0,48
	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(h)</sup> Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD USD	2,000 % 3,000 %	13/12/2051 13/12/2051	5.013.125 4.158.594	2,35 1,95
	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	4,000 %	13/12/2051	1.065.742	0,50
	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	4,500 %	13/12/2051	1.075.039	0,50
	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	2,000 %	13/01/2052	2.001.344	0,94
	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	4,500 %	14/01/2052	1.075.664	0,50
1.545	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	7,500 %	15/12/2028	1.739	0,00
537	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	7,500 %	15/09/2029	563	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	7,500 %	15/12/2029	5.519	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,500 %	15/11/2032	1.378	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,500 %	15/11/2032	2.611	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,500 %	15/01/2033	1.911	0,00
		USD USD	5,500 % 5,500 %	15/02/2033 15/03/2033	4.444 2.920	0,00 0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,500 %	15/03/2033	2.347	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,500 %	15/07/2033	2.821	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,500 %	15/07/2033	2.101	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,500 %	15/08/2033	1.595	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,500 %	15/09/2033	1.275	0,00
1.653	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,500 %	15/04/2034	1.837	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,500 %	15/05/2034	1.281	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,500 %	15/09/2034	17.360	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,500 %	15/09/2034	3.332	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,500 %	15/12/2034	22.193	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,500 %	15/01/2035	15.069	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA) Government National Mortgage Association (GNMA)	USD USD	5,000 % 5,000 %	15/03/2038 15/05/2041	6.077 113.598	0,00 0,05
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/01/2045	439.118	0,03
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/06/2045	210.750	0,10
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/07/2045	359.704	0,17
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/10/2045	143.741	0,07
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/04/2047	286.385	0,13
345.431	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/12/2047	364.360	0,17
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/02/2048	213.847	0,10
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/07/2048	115.120	0,05
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/08/2048	189.903	0,09
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/08/2048	119.585	0,06
	Government National Mortgage Association (GNMA) Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 % 5,000 %	20/09/2048	894.840	0,42
	Government National Mortgage Association (GNMA)  Government National Mortgage Association (GNMA)	USD USD	5,000 % 5,000 %	20/10/2048 20/11/2048	202.086 396.073	0,10 0,19
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/11/2048	111.337	0,19
		000	0,000 /0	20/12/2070	111.007	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/01/2049	143.845	0,07

enencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de patrimonio
-	con garantía de activos emitidos o garantizados por agencias - s – (continuación)	- (conti	nuación)			
198.411	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/03/2049	211.059	0,10
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/03/2049	378.257	0,18
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/05/2049	242.409	0,11
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/08/2049	342.314	0,16
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/10/2049	3.117.175	1,46
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/10/2049	395.060	0,19
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/12/2049	357.643	0,13
	* ,	USD	•			0,12
	Government National Mortgage Association (GNMA)		3,000 %	20/01/2050	262.274	
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/02/2051	776.983	0,36
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/04/2051	7.272.453	3,40
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/04/2051	1.046.365	0,49
	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	3,500 %	19/11/2050	1.046.680	0,49
6.000.000	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	2,500 %	20/12/2051	6.181.477	2,89
1.000.000	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	3,000 %	20/12/2051	1.036.651	0,49
1.000.000	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	3,500 %	20/12/2051	1.044.727	0,49
3.000.000	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	4,500 %	20/12/2051	3.180.404	1,49
5.000.000	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	3,000 %	20/01/2052	5.175.248	2,42
					62.307.787	29,16
OTAL DE OBL	LIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZA	DOS PO	OR AGENCIAS		62.307.787	29,16
	con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agenci	as - 8.2	23 %		62.307.767	29,10
slas Caimán	5. S.	,-	· ·•			
	AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(c)(d)	USD	1,424 %	15/01/2033	300.258	0,14
	AGL CLO 5 Ltd. 2020-5A "A1R" 144A(c)(d)	USD	1,292 %	20/07/2034	550.363	0,26
	Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,182 %	18/04/2034	374.379	0,18
	Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A A 144A (c)(d)	USD	3,032 %	18/04/2034	248.411	0,10
	•	USD			500.150	
	ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(c)(d)		1,492 %	16/01/2033		0,23
	ICG US CLO Ltd. 2017-1A "ARR" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,306 %	28/07/2034	2.401.987	1,12
	ICG US CLO Ltd. 2017-1A "DRR" 144A(c)(d)	USD	3,686 %	28/07/2034	1.490.397	0,70
	Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,412 %	20/01/2032	350.493	0,16
	Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(c)(d)	USD	1,432 %	20/04/2033	500.443	0,23
	Marble Point CLO XXII Ltd. 2021-2A "A" 144A(c)(d)	USD	1,324 %	25/07/2034	2.103.144	0,99
500.000	MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,189 %	16/07/2036	499.991	0,23
1.000.000	Trinitas CLO VI Ltd. 2017-6A "ARR" 144A(c)(d)	USD	1,434 %	25/01/2034	1.002.233	0,47
4.000.000	Venture 28A CLO Ltd. 2017-28AA "A1R" 144A(c)(d)	USD	1,210 %	20/10/2034	4.002.000	1,87
375.000	Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(c)(d)	USD	1,462 %	20/01/2034	375.315	0,18
					14.699.564	6,88
Reino Unido	Harben Finance 2017-1X Plc. "A"(c)	GBP	0,914 %	20/08/2056	111.660	0,05
		GBP				
299.002	Stratton Mortgage Funding 2019-1 Plc. "A"(c)	GBP -	1,250 %	25/05/2051	401.969	0,19
stados Unido	•				513.629	0,24
	Bank 2017-BNK6 "A4"	USD	3,254 %	15/07/2060	158.878	0,08
	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-P1 "A5"	USD	3,717 %	15/09/2048	376.348	0,18
	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01 "1M2" 144A(c)(d)	USD	1,600 %	25/10/2041	114.773	0,05
	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 2003-AR9 "2A2"(C)	USD	2,190 %	25/03/2033	10.463	0,01
	DBJPM 17-C6 Mortgage Trust "D" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,227 %	10/06/2050	93.558	0,04
	GMACM Home Equity Loan Trust 2007-HE3 "2A1"(c)	USD	7,000 %	25/09/2037	51.095	0,02
	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-16 "2A1A"(c)	USD	0,569 %	19/01/2036	25.502	0,01
	Impac CMB Trust Series 2004-10 "2A"(c)	USD	0,732 %	25/03/2035	22.523	0,01
18.178	Impac CMB Trust Series 2004-8 "1A"(c)	USD	0,812 %	25/10/2034	17.950	0,01
150.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 "B"(c)	USD	4,677 %	15/10/2048	161.242	0,08
	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C34 "D" 144A(d)	USD	2,700 %	15/11/2052	220.541	0,10
	PHEAA Student Loan Trust 2016-1A "A" 144A(c)(d)	USD	1,242 %	25/09/2065	441.584	0,21
	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-LC25 "D" 144A(c)(d)	USD	3,198 %	15/12/2059	218.647	0,10
	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C38 "D" 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,000 %	15/07/2050	90.428	0,04
	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C42 "D" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	2,800 %	15/12/2050	270.804	0,13
	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C42 D 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,800 % 3,250 %	15/01/2060	93.621	0,13
100.000	Trans. 2.35 Commorcial mongage Trust 2017-TOT D 1777/	_	3,200 /0	15/01/2000	2.367.957	1,11
OTAL DE OBL	LIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS NO EMITIDOS NI GARAN	TIZADO	S POR AGENCIAS			1,11
coste USD 17.					17.581.150	8,23

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Otros valores	mobiliarios					
Bonos - 0,06 %	%					
Estados Unido	os					
125.000	Glencore Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,625 %	27/04/2026	123.159	0,06
TOTAL DE BO					123.159	0,06
TOTAL DE OTI	ROS VALORES MOBILIARIOS 4.885)				123.159	0,06
•	erciales – 4,84 %					
Estados Unido	os					
	AT&T, Inc.	USD	0,000 %	14/02/2022	699.687	0,33
	Centerpoint Energy, Inc. (c)	USD	0,000 %	08/12/2021	349.990	0,16
	Danaher Corp.	USD	0,000 %	07/12/2021	2.499.939	1,17
	Dominion Resources, Inc.(c)	USD	0,000 %	07/12/2021	1.899.954	0,89
	Enel Finance America LLC	USD	0,000 %	16/02/2022	999.521	0,47
	Entergy Corp.(c)	USD	0,000 %	12/01/2022	899.787	0,42
	Fidelity National Information Services, Inc.	USD	0,000 %	05/01/2022	699.893	0,33
	Suncor Energy, Inc.(c)	USD	0,000 %	03/12/2021	1.099.989	0,51
1.200.000	VW CR, Inc. <sup>(c)</sup>	USD	0,000 %	06/01/2022	1.199.815	0,56
TOTAL DE EFE	ECTOS COMERCIALES				10.348.575	4,84
(coste USD 10	.348.491)  ERCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS				10.348.575	4,84
(coste USD 24					245.205.576	114,75
	garantía de activos hipotecarios a plazo cubiertos – (4,40 %)					
,	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(h)(i)	USD	4,000 %	14/01/2052	(1.065.742)	(0,50)
. ,	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA(h)(i)	USD	4,000 %	13/12/2051	(1.065.742)	(0,50)
	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)(j)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)(j)</sup>	USD USD	3,000 % 3,500 %	20/12/2051 20/12/2051	(6.219.907) (1.044.727)	(2,91) (0,49)
(1.000.000)	COVERNMENT National Mongage Association (CNMA) TEA	OOD	3,300 70	20/12/2031	(9.396.118)	(4,40)
TOTAL DE VAL	ORES HIPOTECARIOS A PLAZO CUBIERTOS 408.1831)				(9.396.118)	(4,40)
· · · ·	futuros - 0,26 %				(0.000.110)	(1,10)
				Valor de mercado		
Número de contratos	Descripción del valor			de la asignación en USD	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
	USD					••••
46	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022		Larga	7.450.562	180.400	0,08
	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022		Larga	6.291.000	79.595	0,04
	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022		Larga	3.285.352	9.690	0,00
	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022		Larga	5.841.375	59.143	0,03
69	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/	2022	Larga	13.782.750	407.895	0,19
			_	36.651.039	736.723	0,34
PLUSVALÍA LA	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS				736.723	0,34
				Valor de mercado		
Número de contratos	Descripción del valor			de la asignación en USD	Minusvalía latente en USD	% del
	EUR					
(1)	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años					
	08/12/2021		Corta	(154.338)	(580)	(0,00)
(1)	JPY Futuros sobre bonos del Estado de Japón a 10 años 13/12/2021		Corta	(1.350.000)	(178)	(0,00)
	USD			( 111 /05/	(10)	(-,)
(58)	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10	años	_			
	22/03/2022		Corta	(8.525.094)	(173.877)	(0,08)
MINUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS				(174.635)	(0,08)

Divisa	Compra Divisa	Venta	Fecha de	Plusve e vencimiento	alía latente en USD	% de patrimonio
USD	122.005 EUR	102.802		15/12/2021	4.980	0,00
USD	682.628 GBP	495.639		21/01/2022	19.907	0,00
USD	60.607 AUD	81.840		31/01/2022	1.958	0,00
PLUSVALÍA LATE	ENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVIS	SAS A PLAZO			26.845	0,01
				Minusv	alía latente en	% de
Divisa	Compra Divisa	Venta	Fecha de	e vencimiento	USD	patrimonio
USD	6.858.745 JPY	776.406.469		31/01/2022	(43.382)	(0,02
USD	449.316 EUR	397.548		10/02/2022	(4.063)	(0,00
USD	4.593.737 JPY	529.145.203		11/04/2022	(113.794)	(0,05
MINUSVALÍA LAT	TENTE SOBRE CONTRATOS DE DIV	SAS A PLAZO			(161.239)	(0,07
Opciones – (0,02	2 %)					
				Plusvalía/ (minusvalía) latente	Valor de mercado en	% de
Tenencias	Descripción del valor			USD	USD	patrimoni
	Opciones adquiridas					
2.620.000	GBP Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,28	(4.162)	843	0,0
	Call Swaption del SONIA a 12 meses		Precio de ejercicio 0,30	(5.504)	1.172	0,0
	Call Swaption del SONIA a 12 meses		Precio de ejercicio 0,42	(5.030)	1.624	0,0
2.810.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,46	(4.465)	1.682	0,0
3.250.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 11/10/2022	Precio de ejercicio 0,92	(1.106)	7.764	0,0
2.570.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 13/10/2022	Precio de ejercicio 0,93	(1.038)	6.299	0,0
3.060.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 15/11/2022	Precio de ejercicio 0,52	(4.856)	2.333	0,0
2.780.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,54	(4.223)	2.316	0,0
				(30.384)	24.033	0,0
TOTAL DE OPCIO (coste USD 54.41)	DNES ADQUIRIDAS 7)				24.033	0,0
	Opciones suscritas					
(270,000)	GBP Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,36	1.352	(3.647)	(0,00
	Call Swaption del SONIA a 12 meses		Precio de ejercicio 0,40	1.405	(5.196)	(0,00
	Call Swaption del SONIA a 12 meses		Precio de ejercicio 0,38	1.750	(4.979)	(0,00
	Call Swaption del SONIA a 12 meses		Precio de ejercicio 0,42	1.146	(4.842)	(0,00
	Call Swaption del SONIA a 12 meses		Precio de ejercicio 1,04	(10.273)	(19.098)	(0,01
	Call Swaption del SONIA a 12 meses		Precio de ejercicio 0,99	(6.335)	(13.993)	(0,01
(320.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 15/11/2022	Precio de ejercicio 0,55	(704)	(7.981)	(0,01
(280.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,60	(1.304)	(7.679)	(0,00
				(12.963)	(67.415)	(0,03
TOTAL DE OPCIO	ONES SUSCRITAS 52))				(67.415)	(0,03
TOTAL DE OPCIO						
(coste USD (35))					(43.382)	(0,02
Contratos de pe Importe	ermutas financieras – (0,03 %)					
				Plusv	alía latente en	% de
teórico	A pagar	A recibir	Divisa Fech	a de vencimiento	USD	patrimonio
						0.00
local neto	Permutas de tipos de interés	Variable (CDOR a 2 massa on CAR)	CAD	15/12/2026	3 360	
2.470.000	Permutas de tipos de interés Fijo 1,750 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2026	3.360	
2.470.000 1.750.000	Permutas de tipos de interés Fijo 1,750 % Fijo 1,680 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	22/08/2028	23.697	0,00
2.470.000 1.750.000 1.300.000	Permutas de tipos de interés Fijo 1,750 % Fijo 1,680 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,500 %	CAD CAD	22/08/2028 14/10/2031	23.697 9.836	0,0
2.470.000 1.750.000 1.300.000 1.830.000	Permutas de tipos de interés Fijo 1,750 % Fijo 1,680 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,500 % Fijo 2,250 %	CAD CAD CAD	22/08/2028 14/10/2031 15/12/2051	23.697 9.836 27.411	0,0 0,0 0,0
2.470.000 1.750.000 1.300.000 1.830.000 190.000	Permutas de tipos de interés Fijo 1,750 % Fijo 1,680 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,500 % Fijo 2,250 % Fijo 2,180 %	CAD CAD CAD CAD	22/08/2028 14/10/2031 15/12/2051 22/08/2052	23.697 9.836 27.411 94	0,0 0,0 0,0 0,0
2.470.000 1.750.000 1.300.000 1.830.000 190.000 1.910.000	Permutas de tipos de interés Fijo 1,750 % Fijo 1,680 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en CHF	Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,500 % Fijo 2,250 % Fijo 2,180 % Fijo 0,000 %	CAD CAD CAD CAD CHF	22/08/2028 14/10/2031 15/12/2051 22/08/2052 16/03/2032	23.697 9.836 27.411 94 20.474	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
2.470.000 1.750.000 1.300.000 1.830.000 190.000 1.910.000 21.010.000	Permutas de tipos de interés Fijo 1,750 % Fijo 1,680 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en CHF Variable (STIBOR a 3 meses en SEK	Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,500 % Fijo 2,250 % Fijo 2,250 % Fijo 2,180 % Fijo 0,000 % Fijo 0,500 %	CAD CAD CAD CAD CHF SEK	22/08/2028 14/10/2031 15/12/2051 22/08/2052 16/03/2032 16/03/2024	23.697 9.836 27.411 94 20.474 5.273	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
2.470.000 1.750.000 1.300.000 1.830.000 190.000 1.910.000 21.010.000 12.850.000	Permutas de tipos de interés Fijo 1,750 % Fijo 1,680 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en CHF Variable (STIBOR a 3 meses en SEK Variable (STIBOR a 3 meses en SEK	Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,500 % Fijo 2,250 % Fijo 2,180 % Fijo 0,000 % Fijo 0,500 % Fijo 0,750 %	CAD CAD CAD CAD CHF SEK SEK	22/08/2028 14/10/2031 15/12/2051 22/08/2052 16/03/2032 16/03/2024 15/12/2031	23.697 9.836 27.411 94 20.474 5.273 5.043	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
2.470.000 1.750.000 1.300.000 1.830.000 190.000 1.910.000 21.010.000 12.850.000 2.840.000	Permutas de tipos de interés Fijo 1,750 % Fijo 1,680 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (CDOR a 12 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en CHF Variable (STIBOR a 3 meses en SEK Variable (STIBOR a 3 meses en SEK Fijo 1,000 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,500 % Fijo 2,250 % Fijo 2,180 % Fijo 0,000 % Fijo 0,500 % Fijo 0,750 % Fijo 1,000 %	CAD CAD CAD CAD CHF SEK SEK USD	22/08/2028 14/10/2031 15/12/2051 22/08/2052 16/03/2032 16/03/2024 15/12/2031 25/07/2024	23.697 9.836 27.411 94 20.474 5.273 5.043	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
2.470.000 1.750.000 1.300.000 1.830.000 1.910.000 21.010.000 21.850.000 2.840.000 1.400.000	Permutas de tipos de interés Fijo 1,750 % Fijo 1,680 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Variable (LIBOR a 12 meses en CHF Variable (STIBOR a 3 meses en SEK Variable (STIBOR a 3 meses en SEK	Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 2,500 % Fijo 2,250 % Fijo 2,180 % Fijo 0,000 % Fijo 0,500 % Fijo 0,750 %	CAD CAD CAD CAD CHF SEK SEK	22/08/2028 14/10/2031 15/12/2051 22/08/2052 16/03/2032 16/03/2024 15/12/2031	23.697 9.836 27.411 94 20.474 5.273 5.043	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0

Permutas de inflación   350.000   Fijo 2,250 %   Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)   EUR   15/10/20	ento USE	% c
2.25.0.00 Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 28 Version   1 Index)   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/20   2006/2		<u> </u>
America investment Grade 28 Version   Fijo 1,000 %		
1		
220.000 Variable (Bonos internacionales del Estado del Indonesia) Fijo 1,000 % USD 2006/20 10.900.000 Variable (Prudential Financial, Inc.) Fijo 1,000 % USD 2006/20 10.900.000 Variable (Prudential Financial, Inc.) Fijo 1,000 % USD 2006/20 12.900.000 Variable (General Electric Co.) Fijo 1,000 % USD 2006/20 12.900.000 Variable (General Electric Co.) Fijo 1,000 % USD 2006/20 12.900.000 Variable (Bonos internacionales del Estado saudi) Fijo 1,000 % USD 2006/20 11.900 % USD 2006/20 11.900 % USD 2006/20 12.900 Variable (Bonos internacionales del Estado saudi) Fijo 3,000 % USD 18/11/20 15.000 Variable (The Markit CMBX North America Bibes Hands) Fijo 3,000 % USD 18/11/20 20.000 Variable (The Markit CMBX North America Bibes Hands) Fijo 3,000 % USD 18/11/20 20.000 Variable (The Markit CMBX North America Bibes Hands) Fijo 3,000 % USD 17/10/20 20.000 Variable (The Markit CMBX North America Bibes Hands) Fijo 3,000 % USD 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20 17/10/20	2022 1.039	0,0
10,000   Variable (Prudential Financial, Inc.)   Fijo 1,000 %   USD   2006/20		
109.00.000 Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 34 index)   300.000 Variable (General Electric Co.)   11.28.00.000 Variable (General Electric Co.)   11.28.00.000 Variable (General Electric Co.)   11.28.00.000 Variable (Bonos internacionales del Estado saud)   12.28.00.000 Variable (Bonos internacionales del Estado saud)   12.28.00.000 Variable (The Markit CMBX North America BBH -11 Index)   150.000 Variable (The Markit CMBX North America BBH -11 Index)   150.000 Variable (The Markit CMBX North America BBH -11 Index)   150.000 Variable (The Markit CMBX North America BBH -1 Index)   150.000 Variable (The Markit CMBX North America BBH -1 Index)   150.000 Variable (The Markit CMBX North America BBH -1 Index)   150.000 Variable (The Markit CMBX North America BBH -1 Index)   150.000 Variable (The Markit CMBX North America BBH -1 Index)   150.000 Variable (The Markit CMBX North America BBH -1 Index)   150.000 Variable (The Markit CMBX North America BBH -1 Index)   150.000 Variable (The Markit CMBX North America BBH -1 Index)   150.000 Variable (The Markit CMBX North America BBH -1 Index)   150.000 Variable (The Markit CMBX North America BBH -1 Index)   150.000 Variable (The Markit CMBX North America BBH -1 Index)   150.000 Variable (BBW a Index)   150.000		0,0
America investment Grade 34 Index   Fip 1,000 % USD 2006/20   12.800,000 Variable (Chemar Electric Co.) Fip 1,000 % USD 2006/20   12.800,000 Variable (The Markt CDX North America Investment Grade 36 Version   1 Index) Fip 1,000 % USD 2016/20   12.800,000 Variable (The Markt CDX North America BB- 11 Index) Fip 1,000 % USD 2012/20   25.000,00 Variable (The Markt CMBX North America BB- 11 Index) Fip 3,000 % USD 18/11/20   15.000 % USD 17/10/20   15.000 % USD 17/10/20 % USD 17/10/20   15.000 % USD 17/10/20 %	2024 950	0,0
300.000 Variable (Ceneral Electric Co.)	2025 84.376	0,0
12,800,000   Variable (Che Markit CDX North America Investment Grade 36 Version   1 Index)		0,0
1   1   1   1   200   00   00   200620		-,-
1,280,000		
Estado saudi	2026 15.630	0,0
250.000 Variable (The Markit CMBX North America BBB-1 Inforex) Fijo 3,000 % USD 18/11/20 150.000 Variable (The Markit CMBX North America BBB-6 Index) Fijo 3,000 % USD 17/10/20 200.000 Variable (The Markit CMBX North America BBB-6 Index) Fijo 3,000 % USD 17/10/20 150.000 Variable (The Markit CMBX North America BBB-6 Index) Fijo 3,000 % USD 17/10/20 50.000 Variable (The Markit CMBX North America BBB-10 Index) Fijo 3,000 % USD 17/10/20 50.000 Variable (The Markit CMBX North America BBB-10 Index) Fijo 3,000 % USD 17/11/20  PLUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMIENTO CREDITICIO (CDS)  Permutas de inflación 350.000 Fijo 2,250 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) EUR 15/10/20 490.000 Fijo 3,250 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) USD 07/10/20  PLUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE INFLACIÓN  TOTAL DE PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE PERMUTAS FINANCIERAS  Importe teórico  A pagar A recibir Divisa Fecha de vencimient teórico  Variable (LBOR a 12 meses en USD) USD 07/10/20  1.980.000 Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Fijo 1,250 % AUD 22/02/20 1.990.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 1,250 % AUD 15/12/20 1.990.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 1,250 % AUD 15/12/20 1.990.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 1,560 % AUD 15/12/20 1.990.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 1,560 % AUD 15/12/20 1.990.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 1,560 % AUD 15/12/20 1.990.000 Variable (BBSW a 6 meses en GBP) Fijo 4,060 % AUD 15/12/20 1.990.000 Fijo 0,000 % Variable (EURBOR a 6 meses en EUR) EUR) 1.990.000 Fijo 0,000 % Variable (EURBOR a 6 meses en EUR) Fijo 1,260 % AUD 15/12/20 1.990.000 Fijo 0,150 % Variable (EURBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 1.990.000 Fijo 0,200 % Variable (EURBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 1.990.000 Fijo 0,200 % Variable (EURBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 1.990.000 Fijo 2,000 % Variable (EURBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 1.990.000 Fijo 1,550 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 1.990.000 Fijo 2,000 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 1.990.	2026 92	0,0
America BBB- 11 Index)	.020	0,
America BBB- 11 Index) Fijo 3,000 % USD 17/10/20 200.000 Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index) Fijo 3,000 % USD 17/10/20 150.000 Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index) Fijo 3,000 % USD 17/10/20 50.000 Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index) Fijo 3,000 % USD 17/11/20 PLUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMIENTO CREDITICIO (CDS)  Pormutas de inflación 350.000 Fijo 2,250 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) EUR 15/10/20 490.000 Fijo 3,250 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) USD 07/10/20 PLUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE INFLACIÓN  TOTAL DE PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE PERMUTAS FINANCIERAS  Importe teórico local neto A pagar Arcibir Divisa Fecha de vencimier  Permutas de tipos de interés  14.860.000 Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Fijo 0,190 % AUD 22/02/20 8.570.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 1,250 % AUD 15/12/20 2.470.000 Variable (CDOR a 3 meses en AUD) Fijo 1,560 % AUD 15/12/20 2.470.000 Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 1,560 % CAD 22/08/20 3.400.00 Fijo 2,000 % Variable (CDOR a 3 meses en EUR) GBP 15/12/20 3.400.00 Fijo 0,000 % Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) GBP 15/12/20 3.400.00 Fijo 0,500 % Variable (EURIBOR a 12 meses en GBP) GBP 15/12/20 3.400.00 Fijo 0,500 % Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR 15/12/20 3.400.00 Fijo 0,500 % Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR 15/12/20 3.400.00 Fijo 0,500 % Variable (EURIBOR a 6 meses en CAD) Fijo 1,500 % CBP 15/12/20 3.400.00 Fijo 0,500 % Variable (EURIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/20 3.4500.00 Fijo 0,500 % Variable (EURIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/20 3.4500.00 Fijo 0,500 % Variable (EURIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/20 3.4500.00 Fijo 0,500 % Variable (EURIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/20 3.4500.00 Fijo 0,500 % Variable (EURIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/20 3.4500.00 Fijo 0,500 % Variable (EURIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/20 3.4500.00 Fijo 0,500 % Variable (EURIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/20 3.4500.00 Fijo 0,500 % Variable (EURIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/20 3.4500.00 F	2054 60.945	0,0
200.000 Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index) Fijo 3,000 %  150.000 Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index) Fijo 3,000 %  50.000 Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index) Fijo 3,000 %  17/10/20  50.000 Variable (The Markit CMBX North America BBB- 10 Index) Fijo 3,000 %  PUSD 17/10/20  PUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMIENTO CREDITICIO (CDS)  Permutas de inflación 350.000 Fijo 2,250 %  Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) EUR 15/10/20  490.000 Fijo 3,250 %  Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) USD 07/10/20  PLUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE INFLACIÓN  TOTAL DE PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE PERMUTAS FINANCIERAS  Importe teórico  Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Fijo 0,190 %  14 800.000 Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Fijo 1,250 %  14 800.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 2,000 %  2 470.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 2,000 %  1 800.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 2,000 %  1 800.000 Fijo 0,200 %  1 8160.000 Fijo 0,200 %  1 970.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 2,000 %  1 980.000 Fijo 0,200 %  1 970.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 2,000 %  1 970.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 2,000 %  1 970.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 2,000 %  1 970.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 2,000 %  1 970.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 2,000 %  1 970.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 2,000 %  1 970.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 2,000 %  1 970.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 2,000 %  1 970.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 2,000 %  1 970.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 2,000 %  1 970.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 2,000 %  1 970.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 2,000 %  1 970.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 2,000 %  1 970.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 2,000 %  1 970.000 Variable (BBSW a 7 meses en AUD) Fijo 2,000 %  1 970.000 Variable (BBSW a 7 meses en BBSW Fijo 2,000 %  1 970.000 Variable (BBSW a 7 meses		
America BBB- 8 Index  Fijo 3,000 %	2054 14.410	0,0
150.000 Variable (The Markit CMBX North America BBB-8 Index)   Fijo 3,000 %	2057 26.358	0,0
America BBB- 8 Index  Fijo 3,000 % USD 17/10/20	20.550	0,0
America BBB-10 Index  Fijo 3,000 % USD 17/11/20   PLUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMIENTO CREDITICIO (CDS)   Permutas de inflación   350,000 Fijo 3,250 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) USD 07/10/20   490,000 Fijo 3,250 % Variable (LIBOR a 12 meses en USD) USD 07/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20   15/10/20	2057 2.469	0,0
Permutas de inflación   350,000 Fijo 2,250 %   Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)   EUR   15/10/20		
Permutas de inflación   350.000   Fijo 2,250 %   Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)   EUR   15/10/20   490.000   Fijo 3,250 %   Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)   USD   07/10/20	2059 8.872	0,0
350.000   Fijo 2,250 %   Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)   EUR   15/10/20   490.000   Fijo 3,250 %   Variable (LIBOR a 12 meses en USD)   USD   07/10/20	220.003	0,
Ago.000   Fijo 3,250 %   Variable (LIBOR a 12 meses en USD)   USD   07/10/20		
PLUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE INFLACIÓN   TOTAL DE PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE PERMUTAS FINANCIERAS   Importe teórico local neto   A pagar   A recibir   Divisa   Fecha de vencimier	2023 196	0,0
Importe teórico   Importe   Importe teórico   Importe   Im	2022 5.671	0,0
Importe teórico   Incal neto   A pagar   A recibir   Divisa   Fecha de vencimier	5.867	0,0
teórico local neto         A pagar         A recibir         Divisa         Fecha de vencimient           14.860.000         Variable (BBSW a 3 meses en AUD)         Fijo 0,190 %         AUD         22/02/20           8.570.000         Variable (BBSW a 6 meses en AUD)         Fijo 1,250 %         AUD         15/12/20           1.990.000         Variable (BBSW a 6 meses en AUD)         Fijo 2,000 %         AUD         15/12/20           2.470.000         Variable (CDOR a 3 meses en CAD)         Fijo 1,560 %         CAD         22/08/20           1.860.000         Fijo 2,000 %         Variable (CDOR a 3 meses en CAD)         CAD         15/12/20           340.000         Fijo 0,000 %         Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR         15/12/20           360.000         Fijo 0,250 %         Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR         15/12/20           1.960.000         Fijo 0,500 %         Variable (SONIA a 1 mes en GBP)         GBP         15/12/20           2.550.000         Fijo 0,750 %         Variable (SONIA a 1 mes en GBP)         GBP         15/12/20           2.550.000         Fijo 0,000 %         Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)         NOK         16/03/20           1.9970.000         Fijo 2,130 %         Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)         NOK         16/03/20	363.243	0,
teórico local neto         A pagar         A recibir         Divisa         Fecha de vencimient           14.860.000         Variable (BBSW a 3 meses en AUD)         Fijo 0,190 %         AUD         22/02/20           8.570.000         Variable (BBSW a 6 meses en AUD)         Fijo 1,250 %         AUD         15/12/20           1.990.000         Variable (BBSW a 6 meses en AUD)         Fijo 2,000 %         AUD         15/12/20           2.470.000         Variable (CDOR a 3 meses en CAD)         Fijo 1,560 %         CAD         22/08/20           1.860.000         Fijo 2,000 %         Variable (CDOR a 3 meses en CAD)         CAD         15/12/20           340.000         Fijo 0,000 %         Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR         15/12/20           360.000         Fijo 0,250 %         Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR         15/12/20           1.960.000         Fijo 0,500 %         Variable (SONIA a 1 mes en GBP)         GBP         15/12/20           2.550.000         Fijo 0,750 %         Variable (SONIA a 1 mes en GBP)         GBP         15/12/20           2.550.000         Fijo 0,000 %         Variable (IBOR a 12 meses en NOK)         NOK         16/03/20           1.9970.000         Fijo 2,130 %         Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)         NOK         16/03/20		
New Part	Minusvalía latente er	% c
Permutas de tipos de interés  14.860.000		patrimon
14.860.000 Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Fijo 0,190 % AUD 15/12/20 8.570.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 1,250 % AUD 15/12/20 1.990.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 1,250 % AUD 15/12/20 2.470.000 Variable (CDOR a 3 meses en AUD) Fijo 1,560 % CAD 22/08/20 1.860.000 Fijo 2,000 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 1,560 % CAD 22/08/20 1.860.000 Fijo 0,000 % Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR 15/12/20 340.000 Fijo 0,000 % Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR 15/12/20 EUR)		
8.570.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 1,250 % AUD 15/12/20 1.990.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 2,000 % AUD 15/12/20 2.470.000 Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 1,560 % CAD 22/08/20 1.860.000 Fijo 2,000 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) CAD 15/12/20 340.000 Fijo 0,000 % Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR 15/12/20 EUR)	2023 (25.525	
1.990.000 Variable (BBSW a 6 meses en AUD) Fijo 2,000 % AUD 15/12/20 2.470.000 Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 1,560 % CAD 22/08/20 1.860.000 Fijo 2,000 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) CAD 15/12/20 340.000 Fijo 0,000 % Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR 15/12/20 EUR) 360.000 Fijo 0,250 % Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR 15/12/20 EUR) 1.960.000 Fijo 0,500 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) GBP 15/12/20 2.550.000 Fijo 0,750 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) GBP 15/12/20 225.710.000 Fijo 0,750 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) GBP 15/12/20 225.710.000 Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en JPY) JPY 15/12/20 10.980.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 10.970.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 1.340.000 Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 1,250 % NZD 15/12/20 1.060.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 1.060.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 1.060.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 1.340.000 Variable (NZDBB a 3 meses en SEK) Fijo 1,250 % NZD 15/12/20 1.060.000 Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) NZD 15/12/20 1.060.000 Fijo 2,000 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 1.700.000 Fijo 1,630 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 NATORNO Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 NATORNO Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 NATORNO Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 NATORNO Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 NATORNO Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 NATORNO Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 NATORNO Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 NATORNO Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 NATORNO Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 NATORNO Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 NATORNO Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 NATORNO F	,	(0.0
2.470.000 Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 1,560 % CAD 22/08/20 1.860.000 Fijo 2,000 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) CAD 15/12/20 340.000 Fijo 0,000 % Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR 15/12/20 360.000 Fijo 0,250 % Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR 15/12/20 1.960.000 Fijo 0,500 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) GBP 15/12/20 2.550.000 Fijo 0,750 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) GBP 15/12/20 2.25.710.000 Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 4,060 % GBP 15/12/20 10.980.000 Fijo 2,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) GBP 15/12/20 10.980.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 10.970.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/20 2.500.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 1.340.000 Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 1,250 % NZD 15/12/20 1.880.000 Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) NZD 15/12/20 1.9180.000 Variable (NZDBB a 3 meses en SEK) Fijo 0,250 % SEK 15/12/20 1.470.000 Fijo 0,050 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 2.350.000 Fijo 1,630 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 1.700.000 Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 1.700.000 Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 1.700.000 Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 1.700.000 Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 1.700.000 Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20  MINUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTERÉS  Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  75.000 Variable (Boeing Co.) Fijo 1,000 % USD 20/06/20		(0,0)
1.860.000 Fijo 2,000 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD) CAD 15/12/20 340.000 Fijo 0,000 % Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR 15/12/20 360.000 Fijo 0,250 % Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR 15/12/20 1.960.000 Fijo 0,500 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) GBP 15/12/20 2.550.000 Fijo 0,750 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) GBP 15/12/20 225.710.000 Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 4,060 % GBP 15/12/20 225.710.000 Fijo 2,000 % Variable (LIBOR a 1 mese en GBP) GBP 15/12/20 10.980.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 10.970.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/20 2.500.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/20 1.340.000 Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 1,250 % NZD 15/12/20 9.180.000 Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Fijo 0,250 % SEK 15/12/20 9.180.000 Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Fijo 0,250 % SEK 15/12/20 9.180.000 Fijo 2,055 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 1.770.000 Fijo 1,630 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 870.000 Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 MINUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTERÉS  Permutas de incumplimiento crediticio (CDS) 75.000 Variable (Boeing Co.) Fijo 1,000 % USD 20/06/20	2031 (26 001	(0,0
340.000 Fijo 0,000 % Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR EUR)  360.000 Fijo 0,250 % Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR EUR)  1.960.000 Fijo 0,500 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) GBP 15/12/20 (SONIA B 12 meses en NOK) NOK 16/03/20 (SONIA B 12 meses en NOK) NOK 16/03/20 (SONIA B 12 meses en NOK) NOK 16/03/20 (SONIA B 14/05/20 (SONIA B 12 meses en NOK) NOK 16/03/20 (SONIA B 14/05/20 (SONIA B 1 meses en NOK) NOK 16/03/20 (SONIA B 14/05/20 (SONIA B 1 meses en NOK) NOK 15/12/20 (SONIA	,	(0,0 (0,0
EUR)  360.000 Fijo 0,250 %	2025 (21.353	(0,0 (0,0 (0,0
EUR)  1.960.000 Fijo 0,500 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) GBP 15/12/20 2.550.000 Fijo 0,750 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) GBP 15/12/20 2.55710.000 Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 4,060 % GBP 15/12/20 225.710.000 Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en JPY) JPY 15/12/20 10.980.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 10.970.000 Fijo 2,130 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/20 2.500.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/20 1.340.000 Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 1,250 % NZD 15/12/20 1.060.000 Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) NZD 15/12/20 9.180.000 Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Fijo 0,250 % SEK 15/12/20 1.470.000 Fijo 0,250 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 2.350.000 Fijo 1,000 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 1.700.000 Fijo 1,630 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 870.000 Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 MINUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTERÉS  Permutas de incumplimiento crediticio (CDS) 75.000 Variable (Boeing Co.) Fijo 1,000 % USD 20/06/20	2025 (21.353 2031 (22.108	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0
1.960.000       Fijo 0,500 %       Variable (SONIA a 1 mes en GBP)       GBP       15/12/20         100.000       Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)       Fijo 4,060 %       GBP       15/12/20         2.550.000       Fijo 0,750 %       Variable (SONIA a 1 mes en GBP)       GBP       15/12/20         225.710.000       Fijo 0,000 %       Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)       JPY       15/12/20         10.980.000       Fijo 2,000 %       Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)       NOK       16/03/20         10.970.000       Fijo 2,130 %       Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)       NOK       11/05/20         2.500.000       Fijo 2,000 %       Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)       NOK       16/03/20         1.340.000       Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)       Fijo 1,250 %       NZD       15/12/20         1.060.000       Fijo 2,000 %       Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)       NZD       15/12/20         9.180.000       Variable (STBOR a 3 meses en SEK)       Fijo 0,250 %       SEK       15/12/20         9.180.000       Fijo 1,000 %       Variable (SOFR a 1 mes en USD)       USD       16/03/20         2.350.000       Fijo 1,630 %       Variable (SOFR a 1 mes en USD)       USD       16/03/20         MINUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPO	2025 (21.353 2031 (22.108	(0,0 (0,0 (0,0
100.000 Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 4,060 % GBP 15/12/20 2.550.000 Fijo 0,750 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) GBP 15/12/20 225.710.000 Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en JPY) JPY 15/12/20 10.980.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 10.970.000 Fijo 2,130 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/20 2.500.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/20 1.340.000 Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 1,250 % NZD 15/12/20 1.060.000 Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) NZD 15/12/20 9.180.000 Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Fijo 0,250 % SEK 15/12/20 1.470.000 Fijo 0,250 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 2.350.000 Fijo 1,000 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 1.700.000 Fijo 1,630 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 NZD	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0
2.550.000 Fijo 0,750 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) GBP 15/12/20 225.710.000 Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en JPY) JPY 15/12/20 10.980.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 10.970.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/20 2.500.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/20 1.340.000 Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 1,250 % NZD 15/12/20 1.060.000 Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) NZD 15/12/20 9.180.000 Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Fijo 0,250 % SEK 15/12/20 1.470.000 Fijo 0,050 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 2.350.000 Fijo 1,000 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 1.700.000 Fijo 1,630 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 22/09/20 870.000 Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 MINUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTERÉS  Permutas de incumplimiento crediticio (CDS) 75.000 Variable (Boeing Co.) Fijo 1,000 % USD 20/06/20	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151 2051 (7.480	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
225.710.000 Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en JPY) JPY 15/12/20 10.980.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 10.970.000 Fijo 2,130 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/20 2.500.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 1.340.000 Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 1,250 % NZD 15/12/20 1.060.000 Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) NZD 15/12/20 9.180.000 Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Fijo 0,250 % SEK 15/12/20 1.470.000 Fijo 0,250 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 2.350.000 Fijo 1,000 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 1.700.000 Fijo 1,630 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 22/09/20 870.000 Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 MINUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTERÉS  Permutas de incumplimiento crediticio (CDS) 75.000 Variable (Boeing Co.) Fijo 1,000 % USD 20/06/20	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151 2051 (7.480 2026 (7.237	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
10.980.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 10.970.000 Fijo 2,130 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/20 2.500.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 1.340.000 Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 1,250 % NZD 15/12/20 1.060.000 Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) NZD 15/12/20 9.180.000 Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Fijo 0,250 % SEK 15/12/20 1.470.000 Fijo 0,250 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 2.350.000 Fijo 1,000 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 1.700.000 Fijo 1,630 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 22/09/20 870.000 Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 Nariable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151 2051 (7.480 2026 (7.237 2028 (10.222	(0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0)
10.970.000 Fijo 2,130 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 11/05/20   2.500.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20   1.340.000 Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 1,250 % NZD 15/12/20   1.060.000 Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) NZD 15/12/20   9.180.000 Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Fijo 0,250 % SEK 15/12/20   1.470.000 Fijo 0,250 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20   2.350.000 Fijo 1,000 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20   1.700.000 Fijo 1,630 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 22/09/20   870.000 Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20   MINUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTERÉS   Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)   75.000 Variable (Boeing Co.) Fijo 1,000 % USD 20/06/20	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151 2051 (7.480 2026 (7.237 2028 (10.222 2031 (14.642	(0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0)
2.500.000 Fijo 2,000 % Variable (NIBOR a 6 meses en NOK) NOK 16/03/20 1.340.000 Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) Fijo 1,250 % NZD 15/12/20 1.060.000 Fijo 2,000 % Variable (NZDBB a 3 meses en NZD) NZD 15/12/20 9.180.000 Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Fijo 0,250 % SEK 15/12/20 1.470.000 Fijo 0,250 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 2.350.000 Fijo 1,000 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 1.700.000 Fijo 1,630 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 22/09/20 870.000 Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 MINUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTERÉS  Permutas de incumplimiento crediticio (CDS) 75.000 Variable (Boeing Co.) Fijo 1,000 % USD 20/06/20	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151 2051 (7.480 2026 (7.237 2028 (10.222 2031 (14.642 2031 (3.343	(0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0)
1.340.000       Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)       Fijo 1,250 %       NZD       15/12/20         1.060.000       Fijo 2,000 %       Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)       NZD       15/12/20         9.180.000       Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)       Fijo 0,250 %       SEK       15/12/20         1.470.000       Fijo 0,250 %       Variable (SOFR a 1 mes en USD)       USD       16/03/20         2.350.000       Fijo 1,000 %       Variable (SOFR a 1 mes en USD)       USD       16/03/20         1.700.000       Fijo 1,630 %       Variable (SOFR a 1 mes en USD)       USD       22/09/20         870.000       Fijo 1,750 %       Variable (SOFR a 1 mes en USD)       USD       16/03/20         MINUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTERÉS         Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)         75.000       Variable (Boeing Co.)       Fijo 1,000 %       USD       20/06/20	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151 2051 (7.480 2026 (7.237 2028 (10.222 2031 (14.642 2031 (3.343 2027 (13.616	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
1.060.000       Fijo 2,000 %       Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)       NZD       15/12/20         9.180.000       Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)       Fijo 0,250 %       SEK       15/12/20         1.470.000       Fijo 0,250 %       Variable (SOFR a 1 mes en USD)       USD       16/03/20         2.350.000       Fijo 1,000 %       Variable (SOFR a 1 mes en USD)       USD       16/03/20         1.700.000       Fijo 1,630 %       Variable (SOFR a 1 mes en USD)       USD       22/09/20         870.000       Fijo 1,750 %       Variable (SOFR a 1 mes en USD)       USD       16/03/20         MINUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTERÉS         Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)         75.000       Variable (Boeing Co.)       Fijo 1,000 %       USD       20/06/20	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151) 2051 (7.480) 2026 (7.237 2028 (10.222 2031 (14.642 2031 (3.343 2027 (13.616 2031 (11.336	(0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0)
9.180.000 Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Fijo 0,250 % SEK 15/12/20 1.470.000 Fijo 0,250 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 2.350.000 Fijo 1,000 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 1.700.000 Fijo 1,630 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 22/09/20 870.000 Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20  MINUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTERÉS  Permutas de incumplimiento crediticio (CDS) 75.000 Variable (Boeing Co.) Fijo 1,000 % USD 20/06/20	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151) 2051 (7.480) 2026 (7.237 2028 (10.222 2031 (14.642) 2031 (3.343) 2027 (13.616) 2031 (11.336) 2032 (5.178)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
1.470.000       Fijo 0,250 %       Variable (SOFR a 1 mes en USD)       USD       16/03/20         2.350.000       Fijo 1,000 %       Variable (SOFR a 1 mes en USD)       USD       16/03/20         1.700.000       Fijo 1,630 %       Variable (SOFR a 1 mes en USD)       USD       22/09/20         870.000       Fijo 1,750 %       Variable (SOFR a 1 mes en USD)       USD       16/03/20         MINUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTERÉS         Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)         75.000       Variable (Boeing Co.)       Fijo 1,000 %       USD       20/06/20	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151) 2051 (7.480) 2026 (7.237 2028 (10.222 2031 (14.642 2031 (3.343) 2027 (13.616 2031 (11.336) 2032 (5.178 2022 (1.663)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
2.350.000 Fijo 1,000 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20 1.700.000 Fijo 1,630 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 22/09/20 870.000 Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20  MINUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTERÉS  Permutas de incumplimiento crediticio (CDS) 75.000 Variable (Boeing Co.) Fijo 1,000 % USD 20/06/20	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151 2051 (7.480 2026 (7.237 2028 (10.222 2031 (3.343 2027 (13.616 2031 (11.336 2031 (11.336 2032 (5.178 2022 (1.663 2031 (3.550	(0.0 (0.0 (0.0 (0.0 (0.0 (0.0 (0.0 (0.0
1.700.000       Fijo 1,630 %       Variable (SOFR a 1 mes en USD)       USD       22/09/20         870.000       Fijo 1,750 %       Variable (SOFR a 1 mes en USD)       USD       16/03/20         MINUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTERÉS         Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)         75.000       Variable (Boeing Co.)       Fijo 1,000 %       USD       20/06/20	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151) 2051 (7.480) 2026 (7.237 2028 (10.222 2031 (14.642) 2031 (3.343) 2027 (13.616) 2031 (11.336) 2032 (5.178) 2032 (1.663) 2031 (3.550) 2026 (1.613)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
870.000 Fijo 1,750 % Variable (SOFR a 1 mes en USD) USD 16/03/20  MINUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTERÉS  Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  75.000 Variable (Boeing Co.) Fijo 1,000 % USD 20/06/20	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151) 2051 (7.480) 2026 (7.237 2028 (10.222 2031 (14.642 2031 (3.343 2027 (13.616 2031 (11.336 2032 (5.178 2022 (1.663 2031 (3.550 2024 (6.066	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
MINUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTERÉS  Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  75.000 Variable (Boeing Co.) Fijo 1,000 % USD 20/06/20	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151) 2051 (7.480) 2026 (7.237 2028 (10.222 2031 (14.642 2031 (3.343 2027 (13.616 2031 (11.336 2032 (5.178 2022 (1.663 2031 (3.550 2031 (3.550 2031 (3.616) 2031 (3.616) 2032 (4.616) 2031 (3.616) 2032 (4.616) 2032 (4.616) 2032 (4.616) 2032 (4.616) 2032 (6.616) 2032 (6.	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
Permutas de incumplimiento crediticio (CDS) 75.000 Variable (Boeing Co.) Fijo 1,000 % USD 20/06/20	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151) 2051 (7.480) 2026 (7.237 2028 (10.222 2031 (14.642) 2031 (14.642) 2032 (13.616) 2032 (5.178 2032 (1.663) 2032 (1.663) 2034 (1.663) 2036 (1.613) 2036 (17.352)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
75.000 Variable (Boeing Co.) Fijo 1,000 % USD 20/06/20	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151) 2051 (7.480) 2026 (7.237 2028 (10.222 2031 (14.642) 2031 (14.642) 2032 (13.616) 2032 (5.178 2032 (1.663) 2032 (1.663) 2034 (1.663) 2036 (1.613) 2036 (17.352)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151) 2051 (7.480) 2026 (7.237 2028 (10.222 2031 (14.642) 2031 (14.642) 2032 (13.616) 2032 (5.178 2032 (1.663) 2032 (1.663) 2034 (1.663) 2036 (1.613) 2036 (17.352)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151) 2051 (7.480) 2026 (7.237 2028 (10.222 2031 (14.642) 2031 (3.343) 2027 (13.616) 2031 (11.336) 2032 (5.178) 2032 (1.663) 2032 (1.663) 2034 (6.066) 2034 (6.066) 2024 (6.066) 2027 (8.412) 2036 (17.352) 2052 (15.836)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
650.000 Variable (Nordstrom, Inc.) Fijo 1,000 % USD 20/06/20	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151) 2051 (7.480) 2026 (7.237 2028 (10.222 2031 (14.642) 2031 (3.343) 2027 (13.616) 2031 (11.336) 2032 (5.178) 2032 (1.663) 2022 (1.663) 2024 (6.066) 2024 (6.066) 2027 (8.412) 2027 (8.412) 2026 (1.613) 2027 (8.412) 2026 (1.633) 2027 (8.412) 2027 (8.414) 2027 (8.414) 2027 (8.414) 2027 (8.414) 2027 (8.414) 2027 (8.414) 2027 (8.414) 2027 (15.836) 2028 (15.836) 2029 (15.836)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
1.350.000 Variable (Bonos internacionales del	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151) 2051 (7.480) 2026 (7.237 2028 (10.222 2031 (14.642 2031 (13.343 2027 (13.616 2032 (5.178 2032 (5.178 2032 (1.663 2031 (1.633 2022 (1.663 2031 (1.550 2031 (1.633 2022 (1.663 2031 (1.633 2022 (1.663 2031 (3.550 2031 (1.633 2022 (1.663 2031 (1.633 2024 (6.066 2027 (8.412 2036 (17.352 2036 (17.352 2052 (15.836) (317.448)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
Estado de Chile) Fijo 1,000 % USD 20/06/20	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151) 2051 (7.480) 20226 (7.237) 2028 (10.222 20331 (14.642) 2031 (3.343) 2027 (13.616) 2031 (11.336) 2032 (5.178) 2032 (5.178) 2032 (6.663) 2024 (6.066) 2027 (8.412) 2036 (17.352) 2036 (17.352) 2037 (317.448) 2028 (317.448)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
1.050.000 Variable (Bonos internacionales del Estado de Indonesia) Fijo 1,000 % USD 20/12/20	2025 (21.353 2031 (22.108 2031 (1.151) 2051 (7.480) 20226 (7.237) 2028 (10.222 20331 (14.642) 2031 (3.343) 2027 (13.616) 2031 (11.336) 2032 (5.178) 2032 (5.178) 2032 (6.663) 2024 (6.066) 2027 (8.412) 2036 (17.352) 2036 (17.352) 2037 (317.448) 2028 (317.448)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0

#### Contratos de permutas financieras - (continuación)

Importe teórico					Minusvalía latente en	% del
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	USD	patrimonio
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS) – (continuación)					
1 200 000	Variable (Bonos internacionales del	Fijo 1,000 %				
1.290.000	Estado de México)	1 10 1,000 %	USD	20/12/2026	(14.432)	(0,01)
450.000	Variable (Bonos extranjeros rusos -	Fijo 1,000 %				
	Eurobono)		USD	20/12/2026	(6.519)	(0,00)
MINUSVALÍA LA	TENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUM	IPLIMIENTO CREDITICIO (CDS)			(50.426)	(0,02)
	Permutas de inflación					
290.000	Fijo 1,920 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/11/2031	(543)	(0,00)
840.000	Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)	Fijo 4,170 %	GBP	15/11/2028	(64.426)	(0,03)
MINUSVALÍA LA	TENTE SOBRE PERMUTAS DE INFLA	CIÓN			(64.969)	(0,03)
TOTAL DE MINU:	SVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATO	OS DE PERMUTAS FINANCIERAS			(432.843)	(0,20)
VALOR DE MERO	CADO DE LAS INVERSIONES					.,,,
(coste USD 233.8					236.124.170	110,50
OTROS ACTIVOS	S Y PASIVOS				(22.441.822)	(10,50)
PATRIMONIO					213.682.348	100,00
					Valor de mercado en	% del
TOTAL DE INVER	RSIONES				USD	patrimonio
Total inversiones	excluyendo derivados (coste USD 243.2	40.578)			245.205.576	114,75
Valor de mercado	de títulos con garantía hipotecaria a pla	zo cubiertos (coste USD (9.408.183))			(9.396.118)	(4,40)
Plusvalía latente s	sobre contratos de futuros				736.723	0,34
Minusvalía latente	e sobre contratos de futuros				(174.635)	(0,08)
Plusvalía latente s	sobre contratos de divisas a plazo				26.845	0,01
Minusvalía latente	e sobre contratos de divisas a plazo				(161.239)	(0,07)
Valor de mercado	de opciones compradas (coste USD 54	.417)			24.033	0,01
Valor de mercado	de opciones suscritas (coste USD (54.4	152))			(67.415)	(0,03)
Plusvalía latente s	sobre contratos de permutas financieras				363.243	0,17
Minusvalía latente	e sobre contratos de permutas financiera	as			(432.843)	(0,20)
Otros activos y pa	sivos				(22.441.822)	(10,50)
Patrimonio	-			-	213.682.348	100,00

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron BNP Paribas S.A., Deutsche Bank AG, JP Morgan Chase Bank N.A. y State Street Bank & Trust.

Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Citibank N.A., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc. y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Citibank N.A., Credit Suisse, JP Morgan Securities Inc. y Merrill Lynch International.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,34 %.

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (d) 144A. La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (e) Este título tiene un cupón escalonado que pasará al segundo tipo en una fecha determinada del futuro.
- (f) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- $^{\rm (g)}\,$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.
- (h) Los valores TBA (por confirmar) se compran sobre una vez suscrito un compromiso a plazo con un importe de principal aproximado (por lo general +/-2,5 %) y sin fecha definitiva de vencimiento. El importe real del principal y la fecha de vencimiento se determinarán tras la liquidación cuando se asignen los "pools" de hipotecas específicos.
- (i) Estos valores representan ventas por confirmar (TBA) cubiertas con posiciones FNMA largas. Estos importes se declaran por separado en el Balance de situación como Valores hipotecarios a plazo cubiertos.
- (i) Estos valores representan ventas por confirmar (TBA) cubiertas con posiciones GNMA largas. Estos importes se declaran por separado en el Balance de situación como Valores hipotecarios a plazo cubiertos.

					Valor de mercado	% del
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	en USD	patrimonio
Bonos - 31,00		cial				
Estados Unidos 74 000 000	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,043 %	20/01/2022	73.995.632	25,26
	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,048 %	17/03/2022	12.498.068	4,27
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	1,250 %	30/11/2026	4.299.022	1,47
					90.792.722	31,00
(coste USD 90.7					90.792.722	31,00
Tenencias	Descripción del valor				Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Fondos de inve	ersión – 1,07 %					
Irlanda 3.141.582	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de	acciones de distrib	ución X) <sup>(c)(d)</sup>		3.141.582	1,07
TOTAL DE FONI	DOS DE INVERSIÓN 1.582)				3.141.582	1,07
·	DRES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOI	LSA DE VALORES	OFICIAL		93.934.304	32,07
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del
	arios negociados en otro mercado regulado	Dividu	Tipo de interes	T cond de venemiento		- patrimonio
	en garantía de activos emitidos o garantizados por agenc	cias – 104,50 %				
Estados Unidos		,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,				
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/09/2023	45.525	0,02
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/02/2024	16.127	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/04/2025	46.816	0,02
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(e)</sup>	USD	3,342 %	25/05/2025	251.150	0,09
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD USD	5,500 %	01/10/2026	18.105	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	7,000 % 4,500 %	15/07/2027 01/11/2029	30.713 11.857	0,01 0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(e)</sup>	USD	2,592 %	25/03/2030	726.629	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	7,000 %	15/09/2030	93.588	0,03
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	6,500 %	15/07/2031	87.453	0,03
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	6,500 %	15/08/2031	170.607	0,06
40.702	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(e)</sup>	USD	2,000 %	01/08/2033	42.686	0,02
88.256	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(e)</sup>	USD	2,625 %	01/07/2034	92.931	0,03
250	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/08/2035	277	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/09/2035	1.203	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/09/2035	14.742	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/12/2035	67.678	0,02
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/12/2035	126.873 186.283	0,04
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD USD	5,000 % 5,000 %	01/07/2036 01/01/2037	111.701	0,06 0,04
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/01/2038	5.083	0,04
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/09/2038	8.731	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/02/2039	2.696	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/02/2039	421	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/02/2039	1.576	0,00
1.635	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/03/2039	1.818	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/04/2039	113.977	0,04
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/05/2039	3.207	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/05/2039	5.412	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD USD	4,500 %	01/05/2039	1.130	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 % 4,500 %	01/05/2039 01/05/2039	211 321	0,00 0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/05/2039	977	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/06/2039	3.704	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/06/2039	14.133	0,01
18.242	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/06/2039	20.283	0,01
2.219	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/07/2039	2.502	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/09/2039	1.442	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	01/06/2040	7.509	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/06/2040	1.944	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	01/02/2041	36.130	0,01
22.303	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	01/02/2041	24.569	0,01

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	on garantía de activos emitidos o garantizados por agenci					
Estados Unidos	- (continuación)					
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/02/2041	37.232	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/04/2041	1.400 961	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 % 4,500 %	01/05/2041 01/05/2041	2.060	0,00 0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/05/2041	33.722	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/06/2041	1.618	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/06/2041	3.269	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/08/2041	3.007	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/08/2041	12.197	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD USD	4,500 % 4,000 %	01/09/2041 01/11/2041	16.991 4.921	0,01 0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/03/2042	10.663	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/03/2042	1.874	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/06/2042	145.985	0,05
257.294	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/06/2042	283.254	0,10
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(e)</sup>	USD	6,461 %	15/06/2042	58.317	0,02
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/08/2042	23.936	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/08/2042	27.303	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD USD	3,000 % 3,500 %	01/08/2042 01/08/2042	12.495 63.190	0,00 0,02
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/10/2042	26.641	0,02
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/10/2042	35.048	0,01
75.724	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/10/2042	81.586	0,03
47.897	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/10/2042	51.605	0,02
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/11/2042	45.940	0,02
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/11/2042	154.893	0,05
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/11/2042 01/11/2042	5.761 20.648	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 % 3,000 %	01/11/2042	389.830	0,01 0,13
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/11/2042	105.288	0,04
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/12/2042	43.296	0,02
36.610	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/12/2042	39.060	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/12/2042	28.188	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/12/2042	159.398	0,05
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/12/2042	9.688	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD USD	3,000 % 3,000 %	01/12/2042 01/12/2042	28.276 24.777	0,01 0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/12/2042	42.198	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/12/2042	22.059	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/12/2042	15.237	0,01
17.239	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/01/2043	18.392	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/01/2043	37.095	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/01/2043	12.044	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD USD	3,500 % 4,000 %	01/08/2043 01/08/2043	826.094 352.751	0,28 0,12
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	01/01/2044	361.189	0,12
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(e)</sup>	USD	5,961 %	15/03/2044	66.908	0,02
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/06/2044	388.456	0,13
55.506	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	15/10/2044	8.791	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/02/2045	13.129	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/02/2045	13.939	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/03/2045	46.517	0,02
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD USD	3,500 % 3,500 %	01/08/2045 01/09/2045	10.880 12.453	0,00 0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/11/2045	29.357	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/01/2046	2.586.599	0,88
151.810	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/03/2046	163.585	0,06
397.110	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/03/2046	424.206	0,15
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/05/2046	397.284	0,14
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/05/2046	91.340	0,03
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(e)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,911 % 3,500 %	15/05/2046	93.333	0,03
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD USD	3,500 % 3,500 %	01/06/2046 01/06/2046	998.457 406.240	0,34 0,14
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/07/2046	164.206	0,14
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/10/2046	28.566	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/12/2046	39.309	0,01
655.939	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	01/02/2047	710.098	0,24
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/05/2047	7.800.057	2,66
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/06/2047	2.106.545	0,72
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	01/06/2047	9.618	0,00
78.719	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/12/2047	84.628	0,03

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
-	on garantía de activos emitidos o garantizados por agencia – (continuación)	as – (continua	nción)			
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	01/04/2048	162.235	0,05
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	01/06/2048	828.328	0,28
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/06/2048	487.368	0,17
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	01/07/2048	689.199	0,24
369.654	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/10/2048	386.204	0,13
416.709	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/11/2048	436.183	0,15
545.084	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/11/2048	585.694	0,20
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	01/01/2049	1.441.687	0,49
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/07/2049	251.755	0,09
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,500 %	01/08/2049	344.898	0,12
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/09/2049	2.376.607	0,81
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/02/2050	18.156	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 % 4,500 %	01/03/2050 01/06/2050	2.079.599 42.575	0,71 0,02
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	25/06/2050	185.343	0,02
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	25/07/2050	150.357	0,05
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	2,000 %	25/09/2050	409.390	0,14
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	25/09/2050	37.316	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(f)</sup>	USD	4,000 %	15/12/2050	276.589	0,09
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(e)(g)</sup>	USD	1,700 %	25/01/2034	100.705	0,03
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(e)(g)</sup>	USD	2,850 %	25/10/2050	167.809	0,06
5.361	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/05/2023	5.862	0,00
9.299	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/05/2023	10.168	0,00
20.424	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/09/2023	22.331	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/12/2023	35.672	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/04/2024	21.101	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/07/2027	22.441	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(e)	USD	4,342 %	25/04/2029	173.953	0,06
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	8,500 %	25/06/2030	98.448	0,03
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	2,500 %	01/07/2030 01/06/2033	163.353	0,06
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(e)</sup>	USD USD	2,305 %	01/12/2033	87.497 29.650	0,03
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(e)</sup> Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	2,004 % 5,500 %	25/07/2035	664.160	0,01 0,23
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/07/2036	218.150	0,23
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/12/2036	19.180	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/03/2039	2.230	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/05/2039	2.664	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/05/2039	9.329	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/05/2039	11.424	0,00
17.900	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/06/2039	19.865	0,01
6.113	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	01/08/2039	6.731	0,00
13.532	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/08/2039	15.014	0,01
7.113	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/08/2039	7.910	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	01/09/2039	2.834	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/09/2039	8.232	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/10/2039	12.484	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/02/2040	14.779	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/03/2040	5.276	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD USD	4,500 %	01/04/2040 01/04/2040	3.716 70.045	0,00 0,02
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 % 4,500 %	01/06/2040	12.968	0,02
	Federal National Mortgage Association (FNMA) Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(e)</sup>	USD	4,958 %	25/10/2040	78.057	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/12/2040	6.781	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/01/2041	62.751	0,02
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/04/2041	12.119	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/04/2041	8.192	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/06/2041	39.497	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	25/06/2041	370.016	0,13
25.579	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/07/2041	28.150	0,01
76.207	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/08/2041	83.868	0,03
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/08/2041	18.911	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/09/2041	114.721	0,04
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/09/2041	20.918	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/10/2041	41.979	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/10/2041	80.374	0,03
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	25/10/2041	394.788	0,14
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/11/2041	89.811	0,03
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/12/2041	59.241	0,02
	Federal National Mortgage Association (FNMA) Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD USD	3,500 % 3,500 %	01/01/2042	29.254 13.504	0,01 0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 % 4,500 %	01/01/2042 01/01/2042	13.504 21.058	0,01
19.004	r odora: National Mortgage Association (FINNA)	03D	+,500 /0	0 1/0 1/2042	21.030	0,01

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	on garantía de activos emitidos o garantizados por agen – (continuación)	ncias – (continua	ación)			
33.476	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/01/2042	37.102	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(e)	USD	5,858 %	25/02/2042	37.404	0,01
289.335	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	01/03/2042	317.706	0,11
6.561	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/03/2042	7.257	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	01/04/2042	70.541	0,02
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/04/2042	329.286	0,11
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/04/2042	5.138	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/05/2042	4.362	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/07/2042	45.513	0,02
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/07/2042	29.650	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(e)	USD	6,578 %	25/07/2042	27.023	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	7,000 %	25/07/2042	222.228	0,08
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/09/2042	100.268	0,03
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/09/2042	11.561	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/09/2042	22.920	0,01
		USD	3,500 %	01/10/2042	70.085	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)					
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/10/2042	6.437	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	7,000 %	25/10/2042	47.463	0,02
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/11/2042	12.848	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/12/2042	9.943	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/12/2042	12.630	0,00
11.678	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/12/2042	12.461	0,00
17.255	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/12/2042	18.412	0,01
29.307	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/12/2042	31.641	0,01
22.688	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/01/2043	24.210	0,01
17.308	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/01/2043	18.468	0,01
45.722	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/01/2043	48.788	0,02
13.633	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/01/2043	14.547	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/01/2043	13.247	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/01/2043	6.637	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/02/2043	31.047	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/02/2043	21.206	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/02/2043	158.780	0,05
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/02/2043	93.922	0,03
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/03/2043	106.284	0,03
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/03/2043	11.708	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/03/2043	11.127	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/03/2043	92.010	0,03
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/03/2043	118.056	0,04
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/03/2043	13.617	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/03/2043	17.763	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/04/2043	28.309	0,01
11.542	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/04/2043	12.338	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/04/2043	16.899	0,01
56.626	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/04/2043	60.529	0,02
48.213	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/04/2043	51.537	0,02
212.236	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/04/2043	228.566	0,08
47.458	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/05/2043	50.730	0,02
118.202	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/05/2043	126.351	0,04
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/05/2043	49.199	0,02
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/05/2043	18.938	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/05/2043	14.685	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/05/2043	35.837	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/06/2043	22.724	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/06/2043	15.454	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/06/2043	190.914	0,07
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/06/2043	158.181	0,05
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/07/2043	13.975	0,03
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/07/2043	164.846	0,06
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/07/2043	160.490	0,06
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/07/2043	193.049	0,07
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/07/2043	40.495	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/07/2043	51.135	0,02
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/07/2043	16.435	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/07/2043	348.244	0,12
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/08/2043	7.143	0,00
133.258	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/08/2043	143.930	0,05
2.212	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/09/2043	2.486	0,00
19.435	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/03/2044	21.447	0,01
2.050.163	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	25/04/2044	2.160.677	0,74
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/08/2044	9.004	0,00
	, ,					•

Elizabed Unidos - Continuación   Fatebase Unidos - Fatebase Unid	Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	
. 6,078 Fordern National Merglage Association (FMAN) USD 3,000 % 0.11990244 7,7 54 0.001 163,37 Februar National Merglage Association (FMAN) USD 3,000 % 0.11020244 17,576 0.01 163,37 Februar National Merglage Association (FMAN) USD 3,000 % 0.11020245 14,28 0.02 12,337 Februar National Merglage Association (FMAN) USD 3,000 % 0.11030245 14,28 0.02 12,331 Februar National Merglage Association (FMAN) USD 3,000 % 0.11030245 14,28 0.02 12,331 Februar National Merglage Association (FMAN) USD 3,000 % 0.11030245 14,28 0.02 12,331 Februar National Merglage Association (FMAN) USD 3,000 % 0.11030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01 1030245 12,330 0.01								
16.37   Federa National Morgings Association (PMAM)		•	USD	3,500 %	01/09/2044	7.154	0,00	
1422   Federin Materian Mortgape Association (FMAM)	29.013	B Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/10/2044	31.742	0,01	
4.122 Federian National Konfiguies Association (FNAMs) 1.233 Federian National Konfiguies Association (FNAMs) 1.304 Federian National Konfiguies Association (FNAMs) 1.2131 Federian National Konfiguies Association (FNAMs) 1.223 Federian National Konfiguies Association (FNAMs) 1.224 Federian National Konfiguies Association (FNAMs) 1.225 Federian National Konfiguies Association (FNAMs) 1.225 Federian National Konfiguies Association (FNAMs) 1.226 Federian National Konfiguies Association (FNAMs) 1.226 Federian National Konfiguies Association (FNAMs) 1.226 Federian National Konfiguies Association (FNAMs) 1.227 Federian National Konfiguies Association (FNAMs) 1.227 Federian National Konfiguies Association (FNAMs) 1.228 Federian National Konfiguies Association (FNAMs) 1.229 Federian National Konfiguies Association (FNAMs) 1.220		* ,						
12.33   Federal National Mortgage Association (FNNA)								
38.904   Federal National Mortgage Association (FINA)								
21.131 Federal National Mortgage Association (FNNA) 22.141 Federal National Mortgage Association (FNNA) 3.500 % 0.10562045 10.158 0.00 9.671 Federal National Mortgage Association (FNNA) 3.500 % 0.10562045 10.158 0.00 9.671 Federal National Mortgage Association (FNNA) 3.500 % 0.10562045 10.158 0.00 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 3.500 % 0.10762045 10.158 0.00 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 4.500 % 0.10762045 10.158 0.00 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 4.500 % 0.10762045 10.159 0.01 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 4.500 % 0.10762045 10.159 0.01 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 4.500 % 0.10762045 10.159 0.01 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 4.500 % 0.10762045 10.159 0.01 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 4.500 % 0.10762045 10.159 0.01 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 4.500 % 0.10762045 10.159 0.01 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 4.500 % 0.10762046 10.159 0.01 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 4.500 % 0.10762046 10.159 0.01 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 4.500 % 0.10762046 10.159 0.01 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 4.500 % 0.10762046 10.159 0.01 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 4.500 % 0.10762046 10.159 0.01 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 4.500 % 0.10762046 10.159 0.01 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 4.500 % 0.10762046 10.159 0.01 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 4.500 % 0.10762046 10.159 0.01 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 4.500 % 0.10762046 10.159 0.01 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 4.500 % 0.10762046 10.159 0.01 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 4.500 % 0.10762046 10.159 0.01 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 4.500 % 0.10762046 10.159 0.01 9.771 Federal National Mortgage Association (FNNA) 4.500 % 0.10762046 10.159 0.01 9.771 Federal National Mo		. , ,						
2.4 16 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.821 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.821 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.921 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.922 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.922 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.923 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.923 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.924 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.925 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.925 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.925 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.926 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.926 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.926 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.927 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.927 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.927 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.928 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.928 Federal National Mortgage Association (FNMA) 8.929								
9.821 Federal National Mortgage Association (FINAA) 1950 Federal National Mortgage Association (FINAA) 1951 Federal National Mortgage Association (FINAA) 1951 Federal National Mortgage Association (FINAA) 1953 Federal National Mortgage Association (FINAA) 1953 Federal National Mortgage Association (FINAA) 1955 Federal National Mortgage Association (FINAA) 1956 Federal National Mortgage Association (FINAA) 1958 Federal National Mortgage Association (FINAA) 1958 Federal National Mortgage Association (FINAA) 1959 Federal National Mortgage Association (FINAA) 1959 Federal National Mortgage Association (FINAA) 1959 Federal National Mortgage Association (FINAA) 1979 Solve Fed								
BEST-572   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD								
1.95.01.587 Federal National Mortgage Association (FNMA) 1.95.01.597 Federal National Mortgage Association (FNMA) 1.95.01.595 Federal National Mortgage Association (								
19.561   Federal National Mortgage Association (FNMA)								
13.285 Federal National Mortagae Association (FNMA)				3,500 %				
B88.51   Federal National Mortgage Association (FNMA)	17.456	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/07/2045	18.750	0,01	
837.502   Federal National Murtigage Association (FNMA)	13.285	5 Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/08/2045	14.519	0,01	
178.604   Federan National Murtigage Association (FNMA)	269.831	Federal National Mortgage Association (FNMA)		4,000 %	01/11/2045	293.066		
77.646 Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/32/2046         8.3 080         0.03           27.758 Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,500 %         01/04/2046         28.428         0.01           810 2025 Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,500 %         01/04/2046         28.428         0.01           9.937 Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,500 %         01/06/2046         58.431         0.22           9.937 Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/06/2046         511.923         0.18           15.68 19 Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/07/2046         110.334         0.04           14.985 Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/07/2046         160.438         0.06           14.490 Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/08/2044         160.438         0.05           14.490 Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/08/2044         162.448         0.05           14.528 Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/08/2044		. , ,						
7.77.94 Federal National Mortgage Association (FNNA) 20.09 Federal National Mortgage Association (FNNA) 40.00 St. 01042046 84.24 0.03 610.205 Federal National Mortgage Association (FNNA) 40.00 St. 01062046 654.31 0.22 469.201 Federal National Mortgage Association (FNNA) 40.00 St. 01062046 106.42 0.04 10.9053 Federal National Mortgage Association (FNNA) 40.00 St. 01062046 106.42 0.04 10.9053 Federal National Mortgage Association (FNNA) 40.00 St. 01062046 106.42 0.04 10.9053 Federal National Mortgage Association (FNNA) 40.00 St. 01072046 106.43 0.04 119.825 Federal National Mortgage Association (FNNA) 40.00 St. 01072046 106.43 0.06 119.825 Federal National Mortgage Association (FNNA) 40.00 St. 01072046 106.43 0.06 119.825 Federal National Mortgage Association (FNNA) 40.00 St. 01082046 122.48 0.05 119.825 Federal National Mortgage Association (FNNA) 40.00 St. 01082046 122.48 0.05 119.825 Federal National Mortgage Association (FNNA) 40.00 St. 01082046 122.48 0.05 119.825 Federal National Mortgage Association (FNNA) 40.00 St. 01082046 122.48 0.05 119.825 Federal National Mortgage Association (FNNA) 40.00 St. 01082046 122.48 0.05 119.825 Federal National Mortgage Association (FNNA) 40.00 St. 01082046 122.48 0.05 119.825 Federal National Mortgage Association (FNNA) 40.00 St. 01082046 122.48 0.05 119.825 Federal National Mortgage Association (FNNA) 40.00 St. 01092046 106.50 St. 01092046 106.								
26.059 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.500 % 0104/2046 28.428 0.01 469.261 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.500 % 01069/2046 511923 0.18 409.978 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.500 % 01069/2046 511923 0.18 409.978 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.000 % 0107/2046 110.394 0.04 110.953 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.000 % 0107/2046 110.394 0.04 110.953 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.000 % 0107/2046 140.396 114.950 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.000 % 0107/2046 459.253 0.16 114.950 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.000 % 0108/2046 25.2486 0.05 114.950 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.000 % 0108/2046 26.844 0.01 117.23 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.000 % 0108/2046 26.844 0.01 117.23 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.000 % 0108/2046 26.844 0.01 116.68 51 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.000 % 0110/2046 15.653 0.01 116.68 51 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.000 % 0110/2046 15.653 0.01 116.68 51 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.000 % 0110/2046 15.653 0.01 116.68 51 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.000 % 0110/2046 15.653 0.01 116.68 51 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.000 % 0110/2046 15.653 0.01 116.68 51 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.000 % 01110/2046 15.653 0.01 116.18 52 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.000 % 01110/2046 15.653 0.01 116.18 52 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.000 % 01110/2046 11.644 0.01 116.48 528 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.000 % 01110/2046 11.644 0.01 116.49 52 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.000 % 01110/2046 11.644 0.01 116.59 Federal National Mortgage Association (FNNA) 105D 3.000 % 01110/2046 11.644 0.01 116.500 % 01110/2046 11.644 0.01 116.500 % 01110/2046 11.644 0.01 116.500 % 01110/204								
610.205   Federal National Mortgage Association (FNNA)   USD   3.500 %   0105/2046   654.731   0.22								
499,261   Federal National Mortgage Association (FMMA)   USD   3,500 %   01/08/2046   108.492   0,04								
9.978 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 3,000 % 01/06/2046 108.492 0,04 109.85 619 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 3,000 % 01/07/2046 166.436 0,06 149.826 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 3,000 % 01/07/2046 166.436 0,06 149.826 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 3,000 % 01/07/2046 152.486 0,05 149.896 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 3,000 % 01/08/2046 152.486 0,05 149.896 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 3,000 % 01/08/2046 65.073 0,02 14.363 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 3,000 % 01/08/2046 65.073 0,02 14.363 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 3,000 % 01/10/2046 15.063 0,01 166.881 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 3,000 % 01/10/2046 15.063 0,01 166.881 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 3,000 % 01/10/2046 175.880 0,06 18.08.37 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 4,000 % 01/10/2046 36.629 0,01 14.946 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 4,000 % 01/10/2046 36.629 0,01 14.946 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 4,000 % 01/10/2046 36.629 0,01 14.946 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 3,000 % 01/10/2046 16.434 0,01 14.945 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 3,000 % 01/11/2046 16.634 14.750 0,05 12.01.88 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 3,000 % 01/11/2046 12.752 0,00 14.53525 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 3,000 % 01/11/2046 12.752 0,00 14.53525 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 3,000 % 01/11/2046 12.752 0,00 14.53525 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 3,000 % 01/11/2046 12.752 0,00 14.53525 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 3,000 % 01/11/2046 88.084 0,03 8.586 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 3,000 % 01/11/2046 88.084 0,03 8.586 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 3,000 % 01/11/2046 88.084 0,03 8.586 Federal National Mortgage Association (FMMA) USD 4,000 % 01/10/2046 88.084 0,03 8.586 Federal		. , ,						
104.953   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/07/2046   103.34   0,04   119.826   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/07/2046   456.253   0,16   0,05   144.996   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/08/2046   26.644   0,01   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0,00   0								
158.619   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/07/2046   456.253   0,16								
4419.826   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3.000 %   01/07/2046   152.486   0.05		* ,						
24.697 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/08/2046 26.674 0.0.0 14.363 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/10/2046 15.653 0.01 166.881 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/10/2046 15.653 0.01 168.881 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/10/2046 195.574 0.07 33.815 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/10/2046 195.574 0.07 14.946 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/10/2046 16.434 0.01 14.946 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/10/2046 16.434 0.01 134.528 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/11/2046 16.434 0.01 134.528 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/11/2046 126.313 0.04 12.186 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/11/2046 126.313 0.04 12.187 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/11/2046 127.52 0.00 143.932 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/11/2046 127.52 0.00 143.932 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/11/2046 88.971 0.17 533.925 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/11/2046 88.971 0.17 533.925 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/11/2046 88.971 0.17 533.925 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/11/2046 88.971 0.17 540.276 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/11/2046 88.974 0.03 84.520 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/11/2046 89.084 0.03 84.520 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/11/2046 89.084 0.03 15.195 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/10/2046 14.404 0.01 16.275 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/10/2046 9.004 18.196 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/10/2046 9.004 18.197 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/10/2046 9.004 18.197 Federal National Mortgage Association (FN			USD					
61.723   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/10/2046   65.073   0,02     14.385   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/10/2046   175.890   0,06     180.837   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/10/2046   36.629   0,01     14.946   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/10/2046   36.629   0,01     14.946   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/10/2046   36.629   0,01     14.946   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/10/2046   141.750   0,05     12.154   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/11/2046   141.750   0,05     12.154   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/11/2046   126.331   0,04     12.154   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/11/2046   126.331   0,04     12.154   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/11/2046   489.971   0,17     15.3325   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/11/2046   489.971   0,17     15.3325   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/12/2046   565.529   0,0     14.5250   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/12/2046   96.438   0,03     15.195   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/12/2046   96.438   0,03     16.195   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/12/2046   96.438   0,03     16.195   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/12/2046   96.438   0,03     16.195   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/10/2047   16.497   0,01     16.2572   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/10/2047   191.2468   0,03     16.2572   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/10/2047   191.2468   0,03     16.2572   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %	144.996	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/08/2046	152.486	0,05	
14.383   Federal National Mortgage Association (FNMA)	24.697	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	01/08/2046	26.644	0,01	
166.88  Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/10/2046 175.890 0,06    180.837 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/10/2046 36.629 0.01    14.946 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/10/2046 36.629 0.01    14.946 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/10/2046 18-16.43    0.01    134.528    Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/11/2046 141.750 0.05    120.166    Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/11/2046 122.313 0.04    12.154 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/11/2046 122.313 0.04    12.154 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/11/2046 182.752 0.00    13.252 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/11/2046 188.971 0.17    15.93925 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/12/2046 98.438 0.03    15.955 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/12/2046 98.438 0.03    15.955 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/12/2046 98.438 0.03    15.955 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/12/2046 98.438 0.03    15.955 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/12/2046 99.043 0.03    15.955 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/12/2046 99.043 0.03    15.955 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/02/2047 18.497 0.01    15.2572 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/02/2047 18.497 0.01    15.2572 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/02/2047 176.444 0.06    15.2572 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/02/2047 176.444 0.06    15.2572 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/02/2047 176.444 0.06    15.2572 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/02/2047 176.444 0.06    15.2572 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/03/2047 113.262 0.04    15.2438 Federal National Mortg	61.723	B Federal National Mortgage Association (FNMA)		3,000 %	01/09/2046	65.073		
180.837   Federal National Mortgage Association (FNMA)								
33.815   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4.000 %   01/10/2046   16.434   0.01		. , ,						
14.946   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3.000 %   01/10/2046   16.434   0.01								
134.528 Federal National Mortgage Association (FNMA) 120.186 Federal National Mortgage Association (FNMA) 12.154 Federal National Mortgage Association (FNMA) 12.154 Federal National Mortgage Association (FNMA) 12.154 Federal National Mortgage Association (FNMA) 12.55.925 Federal National Mortgage Association (FNMA) 12.50 3,000 % 01/11/2046 12/752 0,00 1463.952 Federal National Mortgage Association (FNMA) 12.50 3,000 % 01/11/2046 585.959 0,20 14.526 Federal National Mortgage Association (FNMA) 12.50 3,000 % 01/11/2046 585.959 0,20 14.526 Federal National Mortgage Association (FNMA) 12.50 3,000 % 01/11/2046 96.438 0,03 14.526 Federal National Mortgage Association (FNMA) 12.50 3,000 % 01/11/2046 96.438 0,03 15.159 Federal National Mortgage Association (FNMA) 15.272 Federal National Mortgage Association (FNMA) 15.272 Federal National Mortgage Association (FNMA) 15.273 Federal National Mortgage Association (FNMA) 15.274 Federal National Mortgage Association (FNMA) 15.2772 Federal National Mortgage Association (FNMA) 15.2773 Federal National Mortgage Association (FNMA) 15.2774 Federal National Mortgage Association (FNMA) 15.2775 Federal National Mortgage Association (FNMA) 15.2776 Federal N								
120.188   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/11/2046   126.313   0,04   126.514   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/11/2046   127.52   0,00   463.952   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/11/2046   488.971   0,17   553.925   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/12/2046   984.38   0,03   12.2046   984.38   0,03   84.520   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/12/2046   984.38   0,03   86.586   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,000 %   01/12/2046   91.748   0,03   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.00 %   0.								
12.154   Federal National Mortgage Association (FNMA)		. , ,						
463.952. Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/11/2046 488.971 0,17 553.925 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/12/2046 99.438 0,03 84.520 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/12/2046 99.6.438 0,03 86.586 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/12/2046 89.084 0,03 86.586 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/12/2046 89.084 0,03 15.195 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,000 % 01/12/2046 89.084 0,03 15.195 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/02/2047 16.497 0,01 46.0278 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/02/2047 16.497 0,01 162.572 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/03/2047 41.409 0,01 162.572 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/04/2047 176.444 0,06 12.023 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/06/2047 176.444 0,06 843.739 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/06/2047 130.49 0,00 843.739 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/07/2047 912.466 0.31 27.720 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/07/2047 912.466 0.31 102.493 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/07/2047 912.466 0.31 102.493 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5,000 % 01/07/2047 912.466 0.31 102.493 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5,000 % 01/07/2047 912.466 0.31 102.493 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5,000 % 01/07/2047 912.466 0.31 102.493 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 6,058 % 25/01/2047 67.648 0,02 27.601 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/07/2048 12.934 0,01 407.778 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/07/2048 54.026 0,02 1.52.845 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/06/2048 1.7244 0.01 11.729.44 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/06/2048 1.7244 0.01 11.729.44 Feder								
553.925   Federal National Mortgage Association (FNMA)								
84.520         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/12/2046         89.084         0,03           86.586         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/12/2046         91.748         0,03           540.278         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/02/2047         595.073         0,20           38.143         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/03/2047         41.409         0,01           162.572         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/04/2047         116.444         0,06           12.023         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/04/2047         176.444         0,06           43.739         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/07/2047         912.466         0,31           27.720         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/09/2047         30.064         0,01           102.493         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/11/2047         42.513         0,02			USD		01/12/2046	585.929	0,20	
86.566         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,000 %         01/12/2046         91.748         0,03           15.195         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/02/2047         16.497         0,01           540.278         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/03/2047         41.409         0,01           162.572         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/03/2047         41.409         0,01           12.023         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/07/2047         13.049         0,00           843.739         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/07/2047         912.466         0,31           102.493         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/07/2047         912.466         0,31           39.199         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         5,000 %         01/11/2047         42.513         0,02           27 601         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         6,058 %         25/11/2047         67.648         0,02	91.262	Prederal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/12/2046	96.438	0,03	
15.195 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/02/2047 16.497 0,01 540.278 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/02/2047 595.073 0,20 38.143 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/03/2047 41.409 0,01 162.572 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/04/2047 176.444 0,06 12.023 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/04/2047 13.049 0,00 43.739 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/06/2047 13.049 0,00 43.739 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/07/2047 912.466 0,31 27.720 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/09/2047 30.064 0,01 102.493 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5,000 % 01/09/2047 30.064 0,01 102.493 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/09/2047 113.262 0,04 39.199 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/09/2047 113.262 0,04 39.199 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/11/2047 42.513 0,02 27.601 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/11/2047 42.513 0,02 27.601 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/10/2048 29.934 0,01 407.778 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 6,058 % 25/01/2048 69.256 0,02 1.085,786 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 6,058 % 25/01/2048 69.256 0,02 1.085,786 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/02/2048 1.174,034 0,40 49.854 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,500 % 01/06/2048 1.218.054 0,42 15.917 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,500 % 01/06/2048 1.218.054 0,42 15.917 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/06/2048 123.348 0,04 114.781 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5,000 % 01/06/2048 123.348 0,04 14.801 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5,000 % 01/06/2048 16.303 0,01 130.2046 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5,000 % 01/07/2048 36.063 0,01 141.72048 14.80	84.520	Federal National Mortgage Association (FNMA)		3,000 %	01/12/2046	89.084		
540.278         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/02/2047         595.073         0,20           38.143         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/03/2047         41.409         0,01           12.023         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/06/2047         13.049         0,00           843.739         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/07/2047         912.466         0,31           27.720         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/09/2047         30.064         0,01           102.493         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/09/2047         113.262         0,04           39.199         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         6,058 %         25/11/2047         67.648         0,02           27.601         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         6,058 %         25/01/2048         69.256         0,02           1.085.796         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/02/2048         1.174.034         0,40 <tr< td=""><td>86.586</td><td>Federal National Mortgage Association (FNMA)</td><td></td><td>3,000 %</td><td>01/12/2046</td><td>91.748</td><td></td></tr<>	86.586	Federal National Mortgage Association (FNMA)		3,000 %	01/12/2046	91.748		
38.143   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/03/2047   41.409   0,01     162.572   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/04/2047   176.444   0,06     12.023   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/06/2047   13.049   0,00     843.739   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/07/2047   912.466   0,31     27.720   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/09/2047   30.064   0,01     102.493   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   5,000 %   01/09/2047   30.064   0,01     102.493   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   5,000 %   01/09/2047   113.262   0,04     39.199   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/11/2047   42.513   0,02     39.1643   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/11/2047   42.513   0,02     27.601   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/01/2048   29.934   0,01     407.778   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/02/2048   69.256   0,02     1.085.796   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/02/2048   1.74.034   0,40     49.854   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/02/2048   54.026   0,02     1.152.845   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/06/2048   1.218.054   0,42     1.59.17   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/06/2048   1.218.054   0,42     1.59.17   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/06/2048   1.218.054   0,42     1.59.17   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/06/2048   1.218.054   0,42     1.59.17   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/06/2048   1.23.348   0,04     14.801   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/10/2048   36.063   0,01     33.559   Federal National Mortgage Association (FNMA								
162.572         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/04/2047         176.444         0,06           12.023         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/06/2047         912.466         0,31           27.720         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/09/2047         30.064         0,01           102.493         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         5,000 %         01/09/2047         113.262         0,04           39.199         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         5,000 %         01/11/2047         42.513         0,02           391.643         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         6,058 %         25/11/2047         67.648         0,02           27.601         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         6,058 %         25/11/2048         29.934         0,01           407.778         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         6,058 %         25/01/2048         69.256         0,02           1.085.796         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/02/2048         1.174.034         0,40 <t< td=""><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></t<>								
12.023   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/06/2047   13.049   0,00								
843.739         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/07/2047         912.466         0,31           27.720         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/09/2047         30.064         0,01           102.493         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         5,000 %         01/09/2047         42.513         0,02           391.99         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/11/2047         42.513         0,02           391.643         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         6,058 %         25/11/2047         67.648         0,02           27.601         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         6,058 %         25/01/2048         69.256         0,02           1.085.796         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/02/2048         1.174.034         0,40           4.9.854         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/06/2048         1.218.064         0,42           1.5.917         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/06/2048         1.23.348         0,04								
27.720         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/09/2047         30.064         0,01           102.493         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         5,000 %         01/10/2047         113.262         0,04           39.199         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/11/2047         67.648         0,02           391.643         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         6,058 %         25/11/2047         67.648         0,02           27.601         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/01/2048         29.934         0,01           407.778         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         6,058 %         25/01/2048         69.256         0,02           1.085.796         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/02/2048         54.026         0,02           1.152.845         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,500 %         01/06/2048         12.18.054         0,42           1.5.917         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/06/2048         12.348         0,04      <								
102.493   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   5,000 %   01/09/2047   113.262   0,04   39.199   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/11/2047   42.513   0,02   391.643   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   6,058 %   25/11/2047   67.648   0,02   27.601   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/01/2048   29.934   0,01   407.778   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/01/2048   69.256   0,02   1.085.796   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/02/2048   1.174.034   0,40   49.854   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/02/2048   1.174.034   0,40   49.854   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/02/2048   54.026   0,02   1.152.845   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   3,500 %   01/06/2048   1.218.054   0,42   15.917   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/06/2048   1.218.054   0,42   15.917   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,000 %   01/06/2048   123.348   0,04   14.781   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/06/2048   123.348   0,04   14.801   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/06/2048   16.303   0,01   33.559   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/07/2048   36.063   0,01   30.2346   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/07/2048   448.063   0,06   448.13   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/11/2048   572.540   0,20   1,302.346   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/07/2049   37.192   0,01   669.172   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/07/2049   37.192   0,01   669.172   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/07/2049   37.944   0,13   518.938   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   4,500 %   01/07/2049   36.736								
39.199 Federal National Mortgage Association (FNMA)  391.643 Federal National Mortgage Association (FNMA)(e)  391.643 Federal National Mortgage Association (FNMA)(e)  407.778 Federal National Mortgage Association (FNMA)(e)  407.778 Federal National Mortgage Association (FNMA)(e)  407.778 Federal National Mortgage Association (FNMA)(e)  408.54 Federal National Mortgage Association (FNMA)  49.854 Federal National Mortgage Association (FNMA)  49.854 Federal National Mortgage Association (FNMA)  49.854 Federal National Mortgage Association (FNMA)  49.855 Federal National Mortgage Association (FNMA)  49.854 Federal National Mortgage Association (FNMA)  49.855 Federal National Mortgage Association (FNMA)  49.855 Federal National Mortgage Association (FNMA)  49.856 Federal National Mortgage Association (FNMA)  49.857 Federal National Mortgage Association (FNMA)  49.858 Federal National Mortgage Association (FNMA)  49.859 Federal National Mortgage Association (FNMA)  49.850 W  40.00 W		. , ,						
391.643 Federal National Mortgage Association (FNMA) (e) USD 6,058 % 25/11/2047 67.648 0,02 27.601 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/01/2048 29.934 0,01 407.778 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 6,058 % 25/01/2048 69.256 0,02 1.085.796 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/02/2048 1.174.034 0,40 49.854 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/02/2048 54.026 0,02 1.152.845 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,500 % 01/06/2048 1.218.054 0,42 15.917 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/06/2048 1.218.054 0,42 15.917 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/06/2048 1.23.348 0,04 14.801 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/06/2048 123.348 0,04 14.801 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5,000 % 01/06/2048 16.303 0,01 33.559 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5,000 % 01/06/2048 16.303 0,01 541.625 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/07/2048 36.063 0,01 1.302.346 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,500 % 01/11/2048 572.540 0,20 1.302.346 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5,000 % 01/11/2048 1.452.106 0,50 418.113 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5,000 % 01/11/2048 1.452.106 0,50 469.172 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/11/2049 37.192 0,01 669.172 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/01/2049 721.232 0,25 350.832 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/07/2049 558.049 0,19 34.076 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/07/2049 558.049 0,19 34.076 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/07/2049 558.049 0,19 548.038 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/07/2049 558.049 0,19 548.038 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/07/2049 558.049 0,19 558.049 0,19 558.049 0,19 558.049 0,19 558.049 0,19 558.049 0,10 0/07/2049 558.049								
407.778         Federal National Mortgage Association (FNMA)(e)         USD         6,058 %         25/01/2048         69.256         0,02           1.085.796         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/02/2048         1.174.034         0,40           49.854         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/02/2048         54.026         0,02           1.152.845         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,500 %         01/06/2048         1.218.054         0,42           15.917         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/06/2048         17.244         0,01           114.781         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/06/2048         123.348         0,04           14.801         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         5,000 %         01/06/2048         16.303         0,01           33.559         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/07/2048         36.063         0,01           541.625         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         5,000 %         01/11/2048         1.452.106         0,50 <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>								
1.085.796       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %       01/02/2048       1.174.034       0,40         49.854       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %       01/02/2048       54.026       0,02         1.152.845       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,500 %       01/06/2048       1.218.054       0,42         15.917       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %       01/06/2048       17.244       0,01         114.781       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/06/2048       123.348       0,04         14.801       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       5,000 %       01/06/2048       16.303       0,01         33.559       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/07/2048       36.063       0,01         541.625       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,500 %       01/11/2048       1.452.106       0,50         418.113       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/11/2048       1.452.106       0,50         469.172       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD	27.601	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	01/01/2048	29.934	0,01	
49.854 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/02/2048 54.026 0,02 1.152.845 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,500 % 01/06/2048 1.218.054 0,42 15.917 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/06/2048 1.23.48 0,04 114.781 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/06/2048 123.348 0,04 14.801 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5,000 % 01/06/2048 16.303 0,01 33.559 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5,000 % 01/06/2048 36.063 0,01 541.625 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,500 % 01/07/2048 36.063 0,01 541.625 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,500 % 01/11/2048 572.540 0,20 1.302.346 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5,000 % 01/11/2048 1452.106 0,50 1418.113 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5,000 % 01/11/2048 1452.106 0,50 1669.172 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/12/2048 449.063 0,16 34.659 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/01/2049 37.192 0,01 669.172 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/01/2049 721.232 0,25 350.832 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/05/2049 375.944 0,13 518.938 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/07/2049 558.049 0,19 34.076 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/07/2049 558.049 0,19 34.076 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/07/2049 558.049 0,19	407.778	B Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(e)</sup>	USD	6,058 %	25/01/2048	69.256	0,02	
1.152.845         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,500 %         01/06/2048         1.218.054         0,42           15.917         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/06/2048         17.244         0,01           114.781         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/06/2048         123.348         0,04           14.801         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         5,000 %         01/06/2048         16.303         0,01           33.559         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/07/2048         36.063         0,01           541.625         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,500 %         01/11/2048         572.540         0,20           1.302.346         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         5,000 %         01/11/2048         1.452.106         0,50           418.113         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/12/2048         449.063         0,16           34.659         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/04/2049         37.192         0,01	1.085.796	Federal National Mortgage Association (FNMA)		4,000 %	01/02/2048	1.174.034		
15.917 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/06/2048 17.244 0,01 114.781 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/06/2048 123.348 0,04 14.801 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5,000 % 01/06/2048 16.303 0,01 33.559 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/07/2048 36.063 0,01 541.625 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,500 % 01/11/2048 572.540 0,20 1.302.346 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5,000 % 01/11/2048 1.452.106 0,50 418.113 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5,000 % 01/11/2048 1.452.106 0,50 418.113 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/12/2048 449.063 0,16 34.659 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/01/2049 37.192 0,01 669.172 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/04/2049 721.232 0,25 350.832 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/05/2049 375.944 0,13 518.938 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,500 % 01/07/2049 558.049 0,19 34.076 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/07/2049 558.049 0,19 34.076 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/07/2049 36.736 0,01								
114.781         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/06/2048         123.348         0,04           14.801         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         5,000 %         01/06/2048         16.303         0,01           33.559         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/07/2048         36.063         0,01           541.625         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,500 %         01/11/2048         572.540         0,20           1.302.346         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         5,000 %         01/11/2048         1.452.106         0,50           418.113         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/12/2048         449.063         0,16           34.659         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/01/2049         37.192         0,01           669.172         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/04/2049         721.232         0,25           350.832         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/05/2049         375.944         0,13		0 0 , ,						
14.801       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       5,000 %       01/06/2048       16.303       0,01         33.559       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/07/2048       36.063       0,01         541.625       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,500 %       01/11/2048       572.540       0,20         1.302.346       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       5,000 %       01/11/2048       1.452.106       0,50         418.113       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/12/2048       449.063       0,16         34.659       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/01/2049       37.192       0,01         669.172       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/04/2049       721.232       0,25         350.832       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %       01/05/2049       375.944       0,13         518.938       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,500 %       01/07/2049       558.049       0,19         34.076       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD <td< td=""><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></td<>								
33.559 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/07/2048 36.063 0,01 541.625 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,500 % 01/11/2048 572.540 0,20 1.302.346 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 5,000 % 01/11/2048 1.452.106 0,50 418.113 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/12/2048 449.063 0,16 34.659 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/12/2049 37.192 0,01 669.172 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/04/2049 721.232 0,25 350.832 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,000 % 01/05/2049 375.944 0,13 518.938 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 3,500 % 01/07/2049 558.049 0,19 34.076 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/07/2049 36.736 0,01		0 0 , ,						
541.625         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,500 %         01/11/2048         572.540         0,20           1.302.346         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         5,000 %         01/11/2048         1.452.106         0,50           418.113         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/12/2048         449.063         0,16           34.659         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/01/2049         37.192         0,01           669.172         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/04/2049         721.232         0,25           350.832         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,000 %         01/05/2049         375.944         0,13           518.938         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         3,500 %         01/07/2049         558.049         0,19           34.076         Federal National Mortgage Association (FNMA)         USD         4,500 %         01/07/2049         36.736         0,01		. , ,						
1.302.346       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       5,000 %       01/11/2048       1.452.106       0,50         418.113       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/12/2048       449.063       0,16         34.659       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/01/2049       37.192       0,01         669.172       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/04/2049       721.232       0,25         350.832       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %       01/05/2049       375.944       0,13         518.938       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,500 %       01/07/2049       558.049       0,19         34.076       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/07/2049       36.736       0,01		. , ,						
418.113       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/12/2048       449.063       0,16         34.659       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/01/2049       37,192       0,01         669.172       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/04/2049       721.232       0,25         350.832       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %       01/05/2049       375.944       0,13         518.938       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,500 %       01/07/2049       558.049       0,19         34.076       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/07/2049       36.736       0,01								
34.659       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/01/2049       37.192       0,01         669.172       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/04/2049       721.232       0,25         350.832       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %       01/05/2049       375.944       0,13         518.938       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,500 %       01/07/2049       558.049       0,19         34.076       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/07/2049       36.736       0,01								
669.172       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/04/2049       721.232       0,25         350.832       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %       01/05/2049       375.944       0,13         518.938       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,500 %       01/07/2049       558.049       0,19         34.076       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/07/2049       36.736       0,01		0 0 ,						
350.832       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,000 %       01/05/2049       375.944       0,13         518.938       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,500 %       01/07/2049       558.049       0,19         34.076       Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/07/2049       36.736       0,01		* ,						
518.938 Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       3,500 %       01/07/2049       558.049       0,19         34.076 Federal National Mortgage Association (FNMA)       USD       4,500 %       01/07/2049       36.736       0,01								
	518.938	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/07/2049	558.049	0,19	
271.624 Federal National Mortgage Association (FNMA) USD 4,500 % 01/01/2050 291.648 0,10								
	271.624	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/01/2050	291.648	0,10	

enencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	V Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	alor de mercado en USD	% de patrimonio
-	con garantía de activos emitidos o garantizados por ag	encias – (continua	ación)			
	s – (continuación)					
	2 Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/02/2050	120.991	0,0
	2 Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/02/2050	641.707	0,22
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	25/07/2050	49.901	0,02
	2 Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 % 4,000 %	01/08/2050 25/09/2050	37.996 34.219	0,0° 0,0°
	Federal National Mortgage Association (FNMA)     Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/06/2051	1.433.133	0,0
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	2,500 %	01/07/2051	1.696.702	0,48
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	2,500 %	01/07/2051	3.023.022	1,03
	B Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	2,500 %	01/07/2051	1.676.879	0,57
	B Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	2,500 %	01/07/2051	1.700.336	0,58
1.359.404	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	01/07/2056	1.478.006	0,5
2.026.817	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	01/07/2056	2.248.344	0,77
2.218.033	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,500 %	01/10/2056	2.399.238	0,82
3.000.000	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	1,500 %	13/12/2051	2.907.651	0,99
54.000.000	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	2,000 %	13/12/2051	54.141.753	18,48
9.000.000	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	2,500 %	13/12/2051	9.251.719	3,16
4.000.000	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	3,500 %	13/12/2051	4.208.906	1,44
	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	4,000 %	13/12/2051	2.131.484	0,73
	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	2,000 %	13/01/2052	25.016.796	8,54
	Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	1,875 %	20/06/2023	2.479	0,00
	2 Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	1,625 %	20/07/2023	1.421	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	1,625 %	20/08/2023	1.353	0,00
	3 Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	1,625 %	20/09/2023	3.201	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	2,000 %	20/03/2024	1.304	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	1,875 %	20/04/2024	8.106	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	1,875 %	20/04/2024	4.031	0,00
	7 Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	1,875 %	20/05/2024	1.685	0,0
	7 Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	1,875 %	20/06/2024	3.651	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	1,875 %	20/06/2024	8.370	0,0
	7 Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	2,000 %	20/06/2024	2.940	0,0
	2 Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	1,625 %	20/07/2024	3.955	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	2,000 %	20/07/2024	4.836	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	1,625 %	20/08/2024	7.679	0,00
	2 Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	2,000 %	20/08/2024	4.445	0,00
	5 Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	1,625 %	20/09/2024	1.458	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	1,625 %	20/09/2024	2.384	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD USD	2,125 %	20/11/2024 20/12/2024	4.882	0,0
	5 Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	2,125 % 2,500 %	20/12/2024	1.708 4.081	0,00
	2 Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD		20/01/2025	3.360	0,0
2.048	5 Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup> 8 Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	2,000 % 2,000 %	20/02/2025	2.083	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	2,000 %	20/05/2025	8.477	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	7,000 %	15/07/2025	13.770	0,0
7.910	, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,	USD	2,000 %	20/07/2025	8.034	0,00
	5 Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	2,000 %	20/02/2026	3.440	0,00
	5 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	7,000 %	15/04/2026	816	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	1,625 %	20/07/2026	175	0,00
	6 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	7,000 %	15/10/2026	1.320	0,00
	B Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	2,000 %	20/01/2027	5.479	0,0
	7 Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	2,000 %	20/01/2027	3.534	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	2,000 %	20/02/2027	3.454	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	1,875 %	20/04/2027	13.890	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	1,875 %	20/04/2027	16.076	0,0
	7 Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	1,875 %	20/05/2027	3.080	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	1,875 %	20/06/2027	4.998	0,0
1.491	Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	2,125 %	20/11/2027	1.517	0,0
4.737	Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	2,125 %	20/12/2027	4.824	0,0
10.254	Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	2,000 %	20/01/2028	10.473	0,0
1.599	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	7,000 %	15/02/2028	1.606	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	2,000 %	20/02/2028	3.428	0,0
3.466	Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	2,000 %	20/03/2028	3.541	0,0
18.072	2 Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	1,625 %	20/07/2029	18.479	0,0
7.435	5 Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	1,625 %	20/08/2029	7.603	0,0
1.895	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	1,625 %	20/09/2029	1.938	0,0
5.872	2 Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	2,125 %	20/10/2029	5.999	0,0
3.532	2 Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	2,125 %	20/10/2029	3.613	0,0
4.941	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	2,125 %	20/11/2029	5.064	0,0
8.641	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	2,125 %	20/11/2029	8.833	0,0
	2 Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	2,125 %	20/12/2029	2.144	0,0
	Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	2,125 %	20/12/2029	393	0,0
	'					

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Val Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	lor de mercado en USD	% del patrimonio
-	con garantía de activos emitidos o garantizados por agen	cias – (continua	ación)			
	s – (continuación)		0.000.0/	00/00/000	4 000	
	9 Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD USD	2,000 %	20/02/2030	1.220	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	2,000 % 1,875 %	20/03/2030 20/04/2030	9.250 2.272	0,00 0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	1,875 %	20/04/2030	7.825	0,00
	5 Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	1,875 %	20/05/2030	14.754	0,00
	6 Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	1,875 %	20/05/2030	1.347	0,00
	5 Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	2,000 %	20/05/2030	13.971	0,01
	7 Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	1,875 %	20/06/2030	3.633	0,00
24.18		USD	2,000 %	20/07/2030	24.914	0,01
5.46	1 Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	2,000 %	20/09/2030	5.634	0,00
9.25	6 Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	2,125 %	20/10/2030	9.502	0,00
1.29	8 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	7,000 %	15/06/2031	1.340	0,00
2.55	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	7,000 %	15/07/2031	3.004	0,00
2.72		USD	7,000 %	15/11/2031	2.831	0,00
	8 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/01/2032	242	0,00
	8 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/02/2032	508	0,00
	3 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/02/2032	503	0,00
71		USD USD	6,500 %	15/08/2034 15/02/2036	821 829	0,00
70 1 57		USD	6,500 %		1.833	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)     Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 % 6.500 %	15/02/2036 15/02/2036	1.033	0,00 0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)     Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/02/2036	695	0,00
	5 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/03/2036	1.458	0,00
1.41		USD	6,500 %	15/04/2036	1.655	0,00
1.19	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	6,500 %	15/04/2036	1.405	0,00
	1 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/04/2036	433	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/04/2036	877	0,00
1.60		USD	6,500 %	15/04/2036	1.823	0,00
1.32	1 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/05/2036	1.533	0,00
1.63	1 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/05/2036	1.901	0,00
1.52	5 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/05/2036	1.788	0,00
1.27	3 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/05/2036	1.484	0,00
	6 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/05/2036	1.148	0,00
	6 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/05/2036	992	0,00
	3 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/05/2036	400	0,00
1.07	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	6,500 %	15/05/2036	1.263	0,00
1.04		USD	6,500 %	15/05/2036	1.230	0,00
48	0 0 , ,	USD	6,500 %	15/06/2036	563	0,00
2.88		USD	6,500 %	15/06/2036	3.375	0,00
1.00	6 Government National Mortgage Association (GNMA) 9 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 % 6,500 %	15/06/2036 15/06/2036	596 1.172	0,00 0,00
99	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	6,500 %	15/07/2036	1.172	0,00
5.12	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	6,500 %	15/07/2036	6.009	0,00
5.40		USD	6,500 %	15/07/2036	6.244	0,00
8.38		USD	6,500 %	15/07/2036	9.816	0,00
	5 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/07/2036	4.131	0,00
	5 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/07/2036	1.931	0,00
1.01	6 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/07/2036	1.175	0,00
1.14		USD	6,500 %	15/07/2036	1.272	0,00
80	8 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/08/2036	947	0,00
62	7 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/08/2036	694	0,00
2.03	6 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/08/2036	2.376	0,00
1.31	7 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/08/2036	1.546	0,00
1.05	4 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/08/2036	1.235	0,00
64	4 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/08/2036	753	0,00
32	8 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/08/2036	363	0,00
70	9 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/08/2036	823	0,00
	4 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/08/2036	676	0,00
	3 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/08/2036	2.843	0,00
53	0 0 , ,	USD	6,500 %	15/08/2036	588	0,00
	1 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/08/2036	3.516	0,00
	0 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/08/2036	1.032	0,00
1.32		USD	6,500 %	15/08/2036	1.554	0,00
	5 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/08/2036	2.060	0,00
	2 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/08/2036	1.190	0,00
19		USD	6,500 %	15/08/2036	227	0,00
	4 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/08/2036	6.182	0,00
	9 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/08/2036	696	0,00
1.35	Government National Mortgage Association (GNMA)     Government National Mortgage Association (GNMA)	USD USD	6,500 % 6,500 %	15/08/2036 15/08/2036	1.584 971	0,00 0,00
			6,500 %			
40	2 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/09/2036	471	0,00

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Obligaciones o	con garantía de activos emitidos o garantizados por agei	ncias – (continua	ación)			
Estados Unidos	- (continuación)					
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/09/2036	1.964	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/09/2036	1.118	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/09/2036	996	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/09/2036	265	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/09/2036	5.340	0,00
5.908	* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *	USD	6,500 %	15/09/2036	6.919	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/09/2036 15/09/2036	10.988	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA) Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 % 6,500 %	15/09/2036	3.045 1.265	0,00 0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/09/2036	769	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/09/2036	1.760	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/09/2036	14.064	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/09/2036	485	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/09/2036	2.142	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/09/2036	3.477	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/09/2036	3.722	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/09/2036	2.112	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/09/2036	670	0,00
1.820	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/09/2036	2.050	0,00
832	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/10/2036	961	0,00
726	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/10/2036	805	0,00
949	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/10/2036	1.113	0,00
1.165	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/10/2036	1.368	0,00
671	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/10/2036	787	0,00
2.246	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/10/2036	2.624	0,00
1.167	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/10/2036	1.367	0,00
2.008	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/10/2036	2.348	0,00
2.349	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/10/2036	2.806	0,00
659	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/10/2036	773	0,00
4.045	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/10/2036	4.713	0,00
3.267	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/10/2036	3.689	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/10/2036	2.297	0,00
2.155	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/10/2036	2.527	0,00
1.346	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/11/2036	1.492	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/11/2036	1.662	0,00
1.066	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/11/2036	1.243	0,00
6.000	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/11/2036	6.978	0,00
789	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/11/2036	900	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/11/2036	12.073	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/11/2036	3.310	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/11/2036	5.190	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/11/2036	4.968	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/11/2036	653	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/11/2036	1.413	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/12/2036	6.947	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/12/2036	4.867	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/12/2036	4.578	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/12/2036	1.349	0,00
2.153	, ,	USD	6,500 %	15/01/2037	2.518	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD USD	6,500 %	15/01/2037	4.170	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)		6,500 %	15/01/2037	457	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/03/2037 15/04/2037	2.302	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA) Government National Mortgage Association (GNMA)	USD USD	6,500 % 6,500 %	15/04/2037	828 4.127	0,00 0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/05/2037	1.149	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/08/2037	1.297	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/09/2037	8.171	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/09/2037	510	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/10/2037	10.722	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/11/2037	2.161	0,00
811	. , ,	USD	6,500 %	15/11/2037	898	0,00
798	. , ,	USD	6,500 %	15/11/2037	929	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/11/2037	3.218	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,500 %	15/01/2039	70.509	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/01/2039	616	0,02
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,500 %	15/02/2039	1.607	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/01/2040	134.993	0,05
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/02/2041	3.930	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/10/2041	950	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/11/2041	6.153	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	15/02/2042	101.130	0,04
	3 3 ( ,					

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
-	con garantía de activos emitidos o garantizados	por agencias – (continua	ición)			_
	s – (continuación)	LIOD	4 000 0/	00/04/0040	2 222	
	7 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/04/2042	3.280	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD USD	4,000 % 3,500 %	20/10/2042 15/11/2042	2.060	0,00 0,02
	<ul> <li>Government National Mortgage Association (GNMA)</li> <li>Government National Mortgage Association (GNMA)</li> </ul>	USD	4,500 %	20/12/2042	57.103 2.162	0,02
	2 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/08/2043	32.170	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)     Government National Mortgage Association (GNMA)		5,860 %	20/08/2043	47.951	0,02
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/03/2044	3.087	0,00
	5 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/05/2044	3.765	0,00
	1 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/07/2044	144.927	0,05
681.470	Government National Mortgage Association (GNMA)	e) USD	5,509 %	20/08/2044	112.031	0,04
240.639	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/11/2044	260.346	0,09
12.905	5 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/04/2045	569	0,00
14.765	5 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/05/2045	884	0,00
36.548	3 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/05/2045	39.540	0,01
	2 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/06/2045	2.390	0,00
	3 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/06/2045	41.183	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/07/2045	63.305	0,02
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/08/2045	199.655	0,07
	2 Government National Mortgage Association (GNMA)		6,159 %	20/08/2045	29.727	0,01
	2 Government National Mortgage Association (GNMA)		6,159 %	20/09/2045	40.228	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/03/2046	453.974	0,16
	2 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/06/2046	1.130.542	0,39
	7 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/08/2046	472.194	0,16
	7 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD USD	3,500 % 3,500 %	20/09/2046 20/10/2046	1.296.212 441.209	0,44 0,15
	<ul> <li>Government National Mortgage Association (GNMA)</li> <li>Government National Mortgage Association (GNMA)</li> </ul>	USD	3,500 %	20/12/2046	583.740	0,15
	3 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/01/2047	558.704	0,20
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/02/2047	602.518	0,13
	O Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/03/2047	9.163	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/03/2047	318.814	0,11
	B Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/04/2047	2.274.745	0,78
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/05/2047	15.483	0,01
	2 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/05/2047	1.039.030	0,36
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/06/2047	293.383	0,10
372.488	3 Government National Mortgage Association (GNMA)	e) USD	5,569 %	20/07/2047	52.571	0,02
20.785	5 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/08/2047	21.926	0,01
33.492	2 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/08/2047	36.117	0,01
4.972	2 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/09/2047	5.261	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/10/2047	8.654	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/11/2047	571.538	0,20
	7 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/12/2047	1.101.173	0,38
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/01/2048	991.050	0,34
	7 Government National Mortgage Association (GNMA)		5,609 %	20/01/2048	77.945	0,03
	6 Government National Mortgage Association (GNMA) 9 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD USD	4,500 %	20/05/2048 20/06/2048	211.697 79.412	0,07
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,109 % 4,000 %	20/07/2048	1.109.268	0,03 0,38
	6 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/07/2048	376.541	0,38
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/07/2048	112.237	0,04
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/09/2048	1.924.255	0,66
	7 Government National Mortgage Association (GNMA)		6,109 %	20/09/2048	115.091	0,04
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/10/2048	1.205.962	0,41
	Government National Mortgage Association (GNMA)	A. Committee of the com	6,059 %	20/10/2048	53.865	0,02
	2 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/11/2048	598.448	0,20
965.419	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/12/2048	1.040.247	0,36
45.300	O Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/01/2049	47.793	0,02
	1 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/01/2049	933.442	0,32
3.561.797	, ,	USD	5,000 %	20/01/2049	3.824.131	1,31
	2 Government National Mortgage Association (GNMA)		5,959 %	20/01/2049	48.186	0,02
	3 Government National Mortgage Association (GNMA)		3,699 %	20/02/2049	39.020	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/02/2049	1.079.441	0,37
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/02/2049	1.725.104	0,59
	O Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/03/2049	695.316	0,24
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/03/2049	512.735	0,18
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/03/2049	1.382.443	0,47
	<ul> <li>Government National Mortgage Association (GNMA)</li> <li>Government National Mortgage Association (GNMA)</li> </ul>	USD USD	4,000 %	20/04/2049	648.206 727.228	0,22
	7 Government National Mortgage Association (GNMA)		4,000 % 3,179 %	20/05/2049 20/06/2049	45.155	0,25 0,02
	Government National Mortgage Association (GNMA)     Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/06/2049	1.035.138	0,02
	Government National Mortgage Association (GNMA)     Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 % 5,000 %	20/06/2049	9.036	0,00
	3 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/07/2049	2.574.386	0,00
	· · · · · · · · · · · · · · ·	300	0,000 /0	20/01/2040	2.51 7.000	5,50
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/08/2049	1.038.938	0,36

enencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
-	con garantía de activos emitidos o garantizados por agencias – ( -– (continuación)	continua	ción)			
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/08/2049	333.741	0,11
331.326	Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	6,009 %	20/08/2049	51.744	0,02
1.397.715	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/09/2049	1.463.335	0,50
3.566.194	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/10/2049	324.609	0,11
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/10/2049	548.976	0,19
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/12/2049	220.411	0,08
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/01/2050	1.045.506	0,36
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/02/2050	1.046.856	0,36
	Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	5,959 %	20/02/2050	247.827	0,09
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/03/2050	1.675.158	0,57
	Government National Mortgage Association (GNMA)(e)	USD	5,959 %	20/04/2050 20/06/2050	334.425 149.101	0,11 0,05
	Government National Mortgage Association (GNMA) Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(e)</sup>	USD	4,000 % 6,059 %	20/06/2050	94.383	0,03
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	2,500 %	20/10/2050	115.805	0,04
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	2,500 %	20/10/2050	26.960	0,02
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/01/2051	1.039.915	0,36
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/02/2051	8.313.876	2,84
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/02/2051	1.046.482	0,36
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/04/2051	7.272.766	2,48
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/04/2051	2.092.626	0,71
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/05/2051	7.274.332	2,48
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/05/2051	835.104	0,29
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/07/2051	1.245.141	0,43
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	2,500 %	20/11/2051	1.032.061	0,35
	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	2,000 %	20/12/2051	1.014.740	0,35
	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	2,500 %	20/12/2051	28.846.892	9,85
	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	3,000 %	20/12/2051	10.366.512	3,54
	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	3,500 %	20/12/2051	4.178.909	1,43
	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	3,000 %	20/01/2052	8.280.397	2,83
		USD	3,500 %	21/01/2052	2.087.267	0,71
	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(n)</sup>					- /
	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)</sup>	030_	0,000 //		306.093.128	104,50
2.000.000  OTAL DE OBLI	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO	_				104,50
2.000.000  OTAL DE OBLI  coste USD 302.	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZAD 369.222)	OS POR	AGENCIAS		306.093.128 306.093.128	104,50 <b>104,5</b> 0
2.000.000  OTAL DE OBLI  coste USD 302.	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO	OS POR	AGENCIAS			
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Obligaciones oslas Caimán	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZAD 369.222) con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias	OS POR	AGENCIAS	18/04/2034		104,50
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Obligaciones os slas Caimán 375.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222) con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)	OS POR A	AGENCIAS %	18/04/2034	<b>306.093.128</b> 374.379	<b>104,50</b>
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Obligaciones o slas Caimán 375.000 350.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222) con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g) Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)	OS POR A  S - 12,87  USD  USD	AGENCIAS  %  1,182 % 3,032 %	18/04/2034 18/04/2034	306.093.128 374.379 347.776	0,13 0,12
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Obligaciones c slas Caimán 375.000 350.000 2.084.773	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)	USD USD USD USD	AGENCIAS  1,182 % 3,032 % 1,024 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029	374.379 347.776 2.085.432	0,13 0,12 0,71
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Obligaciones c slas Caimán 375.000 2.084.773 2.000.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(e)(g)	USD USD USD USD USD USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600	0,13 0,12 0,71 0,68
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Obligaciones o slas Caimán 375.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)	USD USD USD USD USD USD USD USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042	0,13 0,12 0,71 0,68 1,09
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  bbligaciones o slas Caimán	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(e)(g)	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2028	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593	0,13 0,12 0,71 0,68 1,09
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Obligaciones o slas Caimán 375.000 3.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222) con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(*)(9) Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(*)(9) Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(*)(9) ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(*)(9) Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(*)(9) Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(*)(9) Ocean Trails CLO 8 144A(*)(9)	OS POR A  S = 12,87  USD  USD  USD  USD  USD  USD  USD  US	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2028 15/07/2034	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421	104,50 0,13 0,12 0,71 0,68 1,09 1,49 0,34
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Obligaciones o slas Caimán 375.000 350.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 2.150.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222) con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g) Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g) Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g) ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(e)(g) Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g) Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(e)(g) Coean Trails CLO 8 144A(e)(g) SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2028 15/07/2034	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947	0,13 0,12 0,71 0,62 1,09 1,48 0,34
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Obligaciones os slas Calmán 375.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 2.150.000 450.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  I CG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(e)(g)  Ocean Trails CLO 8 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  Sound Point CLO XVIII Ltd. 2017-4A "B" 144A(e)(g)	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2028 15/07/2034 15/04/2029 21/01/2031	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846	0,13 0,12 0,71 0,68 1,09 1,49 0,34 0,73
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Obligaciones o slas Caimán 375.000 350.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 2.150.000 450.000 1.773.589	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(e)(g)  Ocean Trails CLO 8 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  Sound Point CLO XVIII Ltd. 2017-4A "B" 144A(e)(g)  Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g)	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2028 15/07/2034 15/04/2029 21/01/2031	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.774.559	0,13 0,12 0,71 0,66 1,09 1,48 0,34 0,73 0,15
2.000.000  OTAL DE OBLI Coste USD 302.  Ibligaciones o slas Calmán 375.000 350.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 2.150.000 450.000 1.773.589 1.000.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(e)(g)  Ocean Trails CLO 8 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  Sound Point CLO XVIII Ltd. 2017-4A "B" 144A(e)(g)  Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g)  Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(e)(g)	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 % 1,462 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2028 15/07/2034 15/04/2029 21/01/2031 15/04/2029 20/01/2034	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.774.559 1.000.839	104,50 0,13 0,12 0,71 0,68 1,09 1,49 0,34 0,73 0,15 0,61 0,61
2.000.000  OTAL DE OBLI Coste USD 302.  Ibligaciones o slas Calmán 375.000 350.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 2.150.000 450.000 1.773.589 1.000.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(e)(g)  Ocean Trails CLO 8 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  Sound Point CLO XVIII Ltd. 2017-4A "B" 144A(e)(g)  Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g)	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2028 15/07/2034 15/04/2029 21/01/2031	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.774.559 1.000.839 1.000.445	104,50 0,13 0,12 0,71 0,68 1,09 1,49 0,34 0,73 0,15 0,61 0,34
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Obligaciones o slas Caimán 375.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 450.000 1.773.589 1.000.000 1.000.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(e)(g)  Ocean Trails CLO 8 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  Sound Point CLO XVIII Ltd. 2017-4A "B" 144A(e)(g)  Tryon Park CLO Ltd. 2021-41A "A1SR" 144A(e)(g)  Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(e)(g)  York CLO 1 Ltd. 2014-1A "APR" 144A(e)(g)	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 % 1,462 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2028 15/07/2034 15/04/2029 21/01/2031 15/04/2029 20/01/2034	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.774.559 1.000.839	104,50 0,13 0,12 0,71 0,68 1,09 1,49 0,34 0,73 0,15 0,61
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Obligaciones o slas Caimán 375.000 350.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 1.773.589 1.000.000 1.000.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  Sound Point CLO XVIII Ltd. 2017-4A "B" 144A(e)(g)  Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g)  Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(e)(g)  York CLO 1 Ltd. 2014-1A "APR" 144A(e)(g)	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 % 1,462 % 1,248 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2028 15/07/2034 15/04/2029 21/01/2031 15/04/2029 20/01/2034 22/10/2029	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.774.559 1.000.839 1.000.445	0,13 0,12 0,71 0,68 1,09 1,48 0,34 0,73 0,15 0,61 0,34
2.000.000  OTAL DE OBLI Coste USD 302.  Ibligaciones o slas Calmán 375.000 350.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 2.150.000 1.773.589 1.000.000 1.000.000 3.000 3.000 3.000 3.000 3.000 3.000 3.000 3.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "B" 144A(e)(g)  Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g)  Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(e)(g)  York CLO 1 Ltd. 2014-1A "APR" 144A(e)(g)	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 % 1,462 % 1,248 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2028 15/07/2034 15/04/2029 21/01/2031 22/10/2029	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.774.559 1.000.839 1.000.445	104,50 0,13 0,12 0,71 0,66 1,09 1,48 0,32 0,73 0,16 0,66 0,34 0,32 0,73
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Ibligaciones o slas Caimán 375.000 350.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 450.000 1.773.589 1.000.000 1.773.589 1.000.000 1.000.000 1.000.000  stados Unidos 340.000 100.000	Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g) Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g) Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g) Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g) Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g) ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(e)(g) Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g) Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(e)(g) Ocean Trails CLO 8 144A(e)(g) SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g) SOUND POINT CLO Ltd. 2013-1A "B" 144A(e)(g) Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g) Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(e)(g) York CLO 1 Ltd. 2014-1A "APR" 144A(e)(g) Bank 2017-BNK8 "D" 144A(g) Bank 2018-BNK14 "D" 144A(g)	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 % 1,462 % 1,248 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2034 15/04/2029 21/01/2031 15/04/2029 20/01/2034 22/10/2029	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.7774.559 1.000.839 1.000.445 19.709.879	104,50 0,13 0,12 0,71 0,68 1,09 1,48 0,32 0,73 0,15 0,66 0,32 0,32 0,73 0,10 0,03
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Obligaciones o slas Caimán 375.000 3.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 450.000 1.773.589 1.000.000 1.773.589 1.000.000 1.000.000 340.000 340.000 780.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias esta de activos no emitidos ni garantizados por agencias esta de activos no emitidos ni garantizados por agencias esta de activos no emitidos ni garantizados por agencias esta de activos no emitidos no emitidos esta de activos no emitidos esta de activos esta de acti	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 % 1,462 % 1,248 %  2,600 % 3,000 % 3,000 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2028 15/07/2034 15/04/2029 21/01/2031 22/10/2029 15/04/2029 15/04/2029	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.774.559 1.000.839 1.000.445 19.709.879	104,50 0,13 0,12 0,7' 0,68 1,08 1,44 0,3' 0,7' 0,15 0,6' 0,3' 0,3' 0,3' 0,3' 0,3' 0,3'
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Obligaciones o slas Caimán 375.000 350.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 450.000 1.773.589 1.000.000 1.000.000  Stados Unidos 340.000 100.000 780.000 2.650.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(e)(g)  Ocean Trails CLO 8 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g)  Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g)  Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(e)(g)  York CLO 1 Ltd. 2014-1A "APR" 144A(e)(g)  Bank 2017-BNK8 "D" 144A(g)  Bank 2018-BNK15 "D" 144A(g)  Bank 2018-BNK15 "D" 144A(g)  BBCMS Mortgage Trust 2018-C2 "A4"	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 % 1,462 % 1,248 %  2,600 % 3,000 % 3,000 % 4,047 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2028 15/07/2034 15/04/2029 21/01/2031 15/04/2029 20/01/2034 22/10/2029	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.774.559 1.000.839 1.000.445 19.709.879	104,50 0,13 0,12 0,7' 0,68 1,08 1,44 0,3' 0,7'3 0,16 0,6'1 0,3' 0,3' 0,3' 0,3' 0,3' 0,3' 0,3' 0,3' 0,3' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,6' 0,
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Ibligaciones o slas Caimán 375.000 3.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 2.150.000 450.000 1.773.589 1.000.000 1.000.000 1.000.000 2.050.000 780.000 2.050.000 700.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g)  Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(e)(g)  York CLO 1 Ltd. 2014-1A "APR" 144A(e)(g)  Bank 2017-BNK8 "D" 144A(g)  Bank 2018-BNK15 "D" 144A(g)  Bank Mortgage Trust 2018-C2 "A4"  Benchmark Mortgage Trust 2018-B6 "D" 144A(e)(g)	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 % 1,462 % 1,248 %  2,600 % 3,000 % 3,000 % 4,047 % 3,261 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2028 15/07/2034 15/04/2029 21/01/2031 15/04/2029 20/01/2034 22/10/2029	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.774.559 1.000.445 19.709.879 301.145 92.378 718.879 2.989.719 667.666	0,13 0,12 0,77 0,66 1,09 1,44 0,34 0,73 0,11 0,66 0,34 0,34 0,73 0,11 0,00 0,21 1,00 0,22 1,00
2.000.000  OTAL DE OBLI Coste USD 302.  Ibligaciones o slas Calmán 375.000 350.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 2.150.000 1.773.589 1.000.000 1.773.589 1.000.000 2.000 340.000 100.000 780.000 2.650.000 700.000 217.709	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Ocean Trails CLO 8 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g)  Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(e)(g)  York CLO 1 Ltd. 2014-1A "APR" 144A(e)(g)  Bank 2017-BNK8 "D" 144A(g)  Bank 2018-BNK14 "D" 144A(g)  Bank 2018-BNK15 "D" 144A(g)  BBCMS Mortgage Trust 2018-C2 "A4"  Benchmark Mortgage Trust 2018-B6 "D" 144A(e)(g)  Brazos Education Loan Authority, Inc. 2012-1 "A1"(e)	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 % 1,462 % 1,248 %  2,600 % 3,000 % 3,000 % 4,047 % 3,261 % 0,792 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2034 15/04/2029 21/01/2031 15/04/2029 20/01/2034 22/10/2029	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.774.559 1.000.839 1.000.445 19.709.879  301.145 92.378 718.879 2.989.719 667.666 218.254	0,13 0,12 0,77 0,66 1,09 1,48 0,3- 0,73 0,16 0,6- 0,3- 0,3- 0,7- 0,10 0,00 0,2- 0,10 0,00 0,2- 0,10 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,0
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Ibligaciones of Slas Calmán 375.000 3.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 2.150.000 1.773.589 1.000.000 1.773.589 1.000.000 780.000 780.000 780.000 205.700.000 717.709 131.111	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(e)(g)  Ocean Trails CLO 8 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A18" 144A(e)(g)  Venture 41 CLO Ltd. 2013-1A "A18" 144A(e)(g)  York CLO 1 Ltd. 2014-1A "APR" 144A(e)(g)  Bank 2017-BNK8 "D" 144A(g)  Bank 2018-BNK14 "D" 144A(g)  BBCMS Mortgage Trust 2018-C2 "A4"  Benchmark Mortgage Trust 2018-BC "D" 144A(e)(g)  Brazos Education Loan Authority, Inc. 2012-1 "A1"(e)  Brazos Higher Education Authority, Inc. 2011-1 "A2"(e)	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 % 1,462 % 1,248 %  2,600 % 3,000 % 4,047 % 3,261 % 0,792 % 0,978 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2034 15/04/2029 21/01/2031 15/04/2029 20/01/2034 22/10/2029 15/11/2050 15/09/2060 15/11/2051 10/10/2051 26/12/2035 25/02/2030	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.774.559 1.000.839 1.000.445 19.709.879  301.145 92.378 718.879 2.989.719 667.666 218.254 131.929	0,13 0,12 0,77 0,68 1,09 1,44 0,33 0,73 0,66 0,34 0,34 0,73 0,10 0,03 0,22 1,00 0,22 1,00 0,22 1,00 0,03
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Obligaciones o slas Caimán 375.000 350.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 450.000 1.773.589 1.000.000 1.773.589 1.000.000 2.650.000 780.000 2.650.000 700.000 217.709 131.111	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias esta de activos no emitidos ni garantizados por agencias esta de activos no emitidos ni garantizados por agencias esta de activos no emitidos ni garantizados por agencias esta de activos no emitidos ni garantizados por agencias esta de activos no emitidos esta de activos no emitidos esta de activos	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 % 1,462 % 1,248 %  2,600 % 3,000 % 3,000 % 4,047 % 3,261 % 0,792 % 0,978 % 4,338 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2034 15/04/2029 21/01/2031 15/04/2029 20/01/2034 22/10/2029 15/11/2050 15/09/2060 15/11/2051 10/10/2051 26/12/2035 25/02/2030 10/11/2049	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.774.559 1.000.839 1.000.445 19.709.879  301.145 92.378 718.879 2.989.719 667.666 218.254 131.929 273.973	0,13 0,13 0,17 0,77 0,68 1,00 1,44 0,34 0,73 0,66 0,33 0,34 0,73 0,11 0,03 0,02 1,00 0,02 0,03
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Obligaciones o slas Caimán 375.000 350.000 2.084.773 2.000.000 2.150.000 450.000 1.773.589 1.000.000 1.000.000 2.650.000 700.000 217.709 131.111 300.000 450.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias de la capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(e)(g)  Ocean Trails CLO 8 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g)  Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(e)(g)  York CLO 1 Ltd. 2014-1A "APR" 144A(e)(g)  Bank 2018-BNK18 "D" 144A(g)  Bank 2018-BNK15 "D" 144A(g)  Benchmark Mortgage Trust 2018-B6 "D" 144A(e)(g)  Brazos Education Loan Authority, Inc. 2012-1 "A1"(e)  Brazos Higher Education Authority, Inc. 2011-1 "A2"(e)  CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-G6 "D" 144A(e)(g)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-GC36 "C"(e)	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 % 1,462 % 1,248 %  2,600 % 3,000 % 3,000 % 4,047 % 3,261 % 0,792 % 0,978 % 4,338 % 4,908 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2028 15/07/2034 15/04/2029 21/01/2031 22/10/2029 20/01/2034 22/10/2029 15/11/2051 15/12/2051 10/10/2051 26/12/2035 25/02/2030 10/11/2049	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.774.559 1.000.839 1.000.445 19.709.879  301.145 92.378 718.879 2.989.719 667.666 218.254 131.929 273.973 465.107	104,56  0,13 0,17 0,77 0,68 1,08 1,44 0,34 0,77 0,11 0,66 0,33 0,34 6,77  0,11 0,00 0,02 1,02 0,07 0,00 0,08 0,06 0,08
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Ibligaciones o slas Caimán 375.000 3.50.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 1.773.589 1.000.000 1.773.589 1.000.000 2.050.000 2.050.000 780.000 2.17.709 131.1111 300.000 450.000 100.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(e)(g)  Ocean Trails CLO 8 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g)  Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(e)(g)  York CLO 1 Ltd. 2014-1A "APR" 144A(e)(g)  Bank 2017-BNK8 "D" 144A(g)  Bank 2018-BNK15 "D" 144A(g)  Brazos Education Loan Authority, Inc. 2012-1 "A1"(e)  Brazos Higher Education Authority, Inc. 2011-1 "A2"(e)  CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C6 "D" 144A(e)(g)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P7 "D" 144A(g)	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 % 1,462 % 1,248 %  2,600 % 3,000 % 4,047 % 3,261 % 0,792 % 0,978 % 4,338 % 4,908 % 3,250 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2028 15/07/2034 15/04/2029 21/01/2031 15/04/2029 20/01/2034 22/10/2029 15/11/2050 15/09/2060 15/11/2051 10/10/2051 26/12/2035 25/02/2030 10/11/2049 10/02/2049	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.774.559 1.000.839 1.000.445 19.709.879  301.145 92.378 718.879 2.989.719 667.666 218.254 131.929 273.973 465.107 80.992	0,13 0,13 0,72 0,66 1,08 1,44 0,34 0,73 0,11 0,66 0,34 0,34 0,73 0,11 0,03 0,22 0,00 0,02 0,00 0,00 0,00 0,01 0,00 0,01
2.000.000  OTAL DE OBLI Coste USD 302.  Ibligaciones o slas Calmán 375.000 350.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 1.773.589 1.000.000 1.773.589 1.000.000 2.650.000 780.000 2.650.000 770.000 217.709 131.111 300.000 450.000 1.000.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias e mais a capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Ocean Trails CLO 8 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g)  Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(e)(g)  York CLO 1 Ltd. 2014-1A "APR" 144A(e)(g)  Bank 2017-BNK8 "D" 144A(g)  Bank 2018-BNK14 "D" 144A(g)  Bank 2018-BNK15 "D" 144A(g)  Brazos Education Loan Authority, Inc. 2012-1 "A1"(e)  Brazos Higher Education Authority, Inc. 2011-1 "A2"(e)  CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-GC 8" D" 144A(e)(g)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-GC36 "C"(e)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(g)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(g)	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 % 1,462 % 1,248 %  2,600 % 3,000 % 3,000 % 4,047 % 3,261 % 0,792 % 0,978 % 4,338 % 4,908 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2034 15/04/2029 21/01/2031 15/04/2029 20/01/2034 22/10/2039 15/11/2061 15/11/2061 10/10/2051 26/12/2035 25/02/2030 10/11/2049 11/02/2049 14/04/2050 15/09/2050	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.774.559 1.000.839 1.000.445 19.709.879  301.145 92.378 718.879 2.989.719 667.666 218.254 131.929 273.973 465.107	0,13 0,13 0,77 0,66 1,09 1,44 0,3- 0,73 0,11 0,66 0,3- 0,3- 0,73 0,11 0,00 0,22 1,02 0,07 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0
2.000.000  OTAL DE OBLI Coste USD 302.  Ibligaciones o slas Calmán 375.000 350.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 1.773.589 1.000.000 1.773.589 1.000.000 2.650.000 780.000 2.650.000 770.000 217.709 131.111 300.000 450.000 1.000.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(e)(g)  Ocean Trails CLO 8 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g)  Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(e)(g)  York CLO 1 Ltd. 2014-1A "APR" 144A(e)(g)  Bank 2017-BNK8 "D" 144A(g)  Bank 2018-BNK15 "D" 144A(g)  Brazos Education Loan Authority, Inc. 2012-1 "A1"(e)  Brazos Higher Education Authority, Inc. 2011-1 "A2"(e)  CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C6 "D" 144A(e)(g)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P7 "D" 144A(g)	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 % 1,462 % 1,248 %  2,600 % 3,000 % 4,047 % 3,261 % 0,792 % 0,978 % 4,338 % 4,908 % 3,250 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2028 15/07/2034 15/04/2029 21/01/2031 15/04/2029 20/01/2034 22/10/2029 15/11/2050 15/09/2060 15/11/2051 10/10/2051 26/12/2035 25/02/2030 10/11/2049 10/02/2049	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.774.559 1.000.839 1.000.445 19.709.879  301.145 92.378 718.879 2.989.719 667.666 218.254 131.929 273.973 465.107 80.992	0,13 0,13 0,77 0,66 1,09 1,44 0,3- 0,73 0,11 0,66 0,3- 0,3- 0,73 0,11 0,00 0,22 1,02 0,07 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  bbligaciones o slas Caimán	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias e mais a capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Ocean Trails CLO 8 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g)  Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(e)(g)  York CLO 1 Ltd. 2014-1A "APR" 144A(e)(g)  Bank 2017-BNK8 "D" 144A(g)  Bank 2018-BNK14 "D" 144A(g)  Bank 2018-BNK15 "D" 144A(g)  Brazos Education Loan Authority, Inc. 2012-1 "A1"(e)  Brazos Higher Education Authority, Inc. 2011-1 "A2"(e)  CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-GC 8" D" 144A(e)(g)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-GC36 "C"(e)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(g)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(g)	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 % 1,462 % 1,248 %  2,600 % 3,000 % 4,047 % 3,261 % 0,792 % 0,978 % 4,338 % 4,938 % 3,250 % 3,000 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2034 15/04/2029 21/01/2031 15/04/2029 20/01/2034 22/10/2039 15/11/2061 15/11/2061 10/10/2051 26/12/2035 25/02/2030 10/11/2049 11/02/2049 14/04/2050 15/09/2050	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.774.559 1.000.839 1.000.445 19.709.879  301.145 92.378 718.879 2.989.719 667.666 218.254 131.929 273.973 465.107 80.992 910.100	0,13 0,17 0,77 0,66 1,09 1,44 0,33 0,73 0,16 0,03 0,34 0,34 0,73 0,10 0,03 0,22 1,02 0,07 0,04 0,08 0,04 0,09 0,08 0,16 0,03 0,16 0,03 0,10 0,03 0,10 0,03 0,10 0,03 0,10 0,03 0,11
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Obligaciones o slas Calmán 375.000 350.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 450.000 1.773.589 1.000.000 773.589 1.000.000 2.6550.000 700.000 700.000 217.709 131.111 300.000 450.000 1.000.000 1.000.000 1.000.000 1.000.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias e de la capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(e)(g)  Ocean Trails CLO 8 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g)  Venture 41 CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g)  York CLO 1 Ltd. 2014-1A "APR" 144A(e)(g)  Bank 2017-BNK8 "D" 144A(g)  Bank 2018-BNK14 "D" 144A(g)  Bank 2018-BNK14 "D" 144A(g)  Brazos Education Loan Authority, Inc. 2011-1 "A2"(e)  CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-G6 "C"(e)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-G6 "C"(e)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P7 "D" 144A(g)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P7 "D" 144A(g)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P7 "D" 144A(g)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(g)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(g)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(g)  COMM 2012-CCRE2 Mortgage Trust 2012-CR2 "A4"	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 % 1,462 % 1,248 %  2,600 % 3,000 % 4,047 % 3,261 % 0,792 % 0,978 % 4,338 % 4,908 % 3,250 % 3,000 % 3,000 % 3,147 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2034 15/04/2029 21/01/2031 15/04/2029 20/01/2034 22/10/2029 15/11/2050 15/09/2060 15/11/2061 15/12/2051 10/10/2051 26/12/2035 25/02/2030 10/11/2049 11/09/2050 15/09/2050 15/09/2050	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.7774.559 1.000.839 1.000.445 19.709.879  301.145 92.378 718.879 2.989.719 667.666 218.254 131.929 273.973 465.107 80.992 910.100 302.475	0,13 0,13 0,17 0,77 0,68 1,00 1,44 0,34 0,77 0,18 0,66 0,34 0,34 0,77 0,11 0,03 0,02 1,00 0,02 0,03 0,03 0,03 0,03 0,03 0,03 0
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Obligaciones o slas Caimán 375.000 3.000,2.084.773 2.000.000 2.084.773 2.000.000 4.353.692 1.000.000 1.773.589 1.000.000 1.773.589 1.000.000 2.650.000 700.000 217.709 131.111 300.000 450.000 1.000.000 1.000.000 1.000.000 1.000.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias e de la capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(e)(g)  Ocean Trails CLO 8 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO XVIII Ltd. 2017-4A "B" 144A(e)(g)  Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g)  Venture 41 CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g)  Vork CLO 1 Ltd. 2014-1A "APR" 144A(e)(g)  Bank 2018-BNK14 "D" 144A(g)  Bank 2018-BNK15 "D" 144A(g)  Brazos Education Loan Authority, Inc. 2011-1 "A1"(e)  Brazos Higher Education Authority, Inc. 2011-1 "A2"(e)  CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-6C "D" 144A(e)(g)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C6 "D" 144A(g)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(g)  COMM 2012-CCRE2 Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(e)(g)  COMM 2012-CCRE2 Mortgage Trust 2012-R01 "1M2" 144A(e)(g)	USD	1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 % 1,462 % 1,248 %  2,600 % 3,000 % 4,047 % 3,261 % 0,792 % 0,978 % 4,338 % 4,908 % 3,250 % 3,000 % 3,147 % 1,600 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2034 15/04/2029 21/01/2031 15/04/2029 20/01/2034 22/10/2029 15/11/2051 15/12/2051 10/10/2051 26/12/2035 25/02/2030 10/11/2049 14/04/2050 15/08/2045 25/10/2041	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.774.559 1.000.839 1.000.445 19.709.879  301.145 92.378 718.879 2.989.719 667.666 218.254 131.929 273.973 465.107 80.992 910.100 302.475 139.942	0,13 0,13 0,17 0,68 1,09 1,44 0,34 0,73 0,15 0,61 0,03 0,34 0,73 0,10 0,03 0,03 0,03 0,03 0,03 0,03 0,0
2.000.000  OTAL DE OBLI coste USD 302.  Ibligaciones o slas Caimán 375.000 350.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 1.773.589 1.000.000 1.773.589 1.000.000 2.0550.000 780.000 2.0550.000 700.000 217.709 131.1111 300.000 450.000 1.000.000 1.000.000 1.000.000 1.000.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias e mais a capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  ICG US CLO Ltd. 2015-2RA "A1" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(e)(g)  Ocean Trails CLO 8 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g)  Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(e)(g)  York CLO 1 Ltd. 2014-1A "APR" 144A(e)(g)  Bank 2017-BNK8 "D" 144A(g)  Bank 2018-BNK15 "D" 144A(g)  Brazos Education Loan Authority, Inc. 2012-1 "A1"(e)  Brazos Higher Education Authority, Inc. 2011-1 "A2"(e)  CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C6 "D" 144A(e)(g)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C636 "C"(e)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(g)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(g)  Conmecticut Avenue Securities Trust 2021-R01 "M42" 144A(e)(g)  ECMC Group Student Loan Trust 2017-1A "A" 144A(e)(g)	USD	AGENCIAS  1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 3,874 % 1,074 % 1,932 % 1,014 % 1,462 % 1,248 %  2,600 % 3,000 % 4,047 % 3,261 % 0,792 % 0,978 % 4,338 % 4,908 % 3,250 % 3,000 % 3,147 % 1,600 % 1,385 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2028 15/07/2034 15/04/2029 21/01/2031 15/04/2029 20/01/2034 22/10/2029 15/11/2051 10/10/2051 10/10/2051 10/10/2051 10/10/2051 10/10/2050 15/11/2049 14/04/2050 15/09/2050 15/09/2050 15/09/2050 15/09/2050 15/09/2050	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.774.559 1.000.839 1.000.445 19.709.879  301.145 92.378 718.879 2.989.719 667.666 218.254 131.929 273.973 465.107 80.992 910.100 302.475 139.942 1.290.242	0,13 0,12 0,77 0,66 1,09 1,48 0,34 0,73 0,11 0,67 0,11 0,03 0,25 1,02 0,03 0,25 1,02 0,03 0,04 0,03 0,11 0,05 0,44 0,00
2.000.000  OTAL DE OBLI Coste USD 302.  Ibligaciones o slas Caimán 375.000 350.000 2.084.773 2.000.000 3.182.991 4.353.692 1.000.000 1.773.589 1.000.000 1.773.589 1.000.000 2.650.000 700.000 217.709 131.111 300.000 450.000 1.000.000 1.000.000 1.000.000 1.000.000	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADO 369.222)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(e)(g)  Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  Dryden XXVI Senior Loan Fund 2013-26A "AR" 144A(e)(g)  Madison Park Funding XXX Ltd. 2018-30A "A" 144A(e)(g)  Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A(e)(g)  Ocean Trails CLO 8 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  SOUND POINT CLO Ltd. 2013-2RA "A1" 144A(e)(g)  Tryon Park CLO Ltd. 2013-1A "A1SR" 144A(e)(g)  Venture 41 CLO Ltd. 2021-41A "A1N" 144A(e)(g)  York CLO 1 Ltd. 2014-1A "APR" 144A(e)(g)  Bank 2017-BNK8 "D" 144A(g)  Bank 2018-BNK15 "D" 144A(g)  Bark 2018-BNK15 "D" 144A(g)  Brazos Education Loan Authority, Inc. 2012-1 "A1"(e)  Brazos Higher Education Authority, Inc. 2012-1 "A2"(e)  CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-G6 "D" 144A(e)(g)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P7 "D" 144A(g)  Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P7 "D" 144A(g)  COMM 2012-CCRE2 Mortgage Trust 2012-CR2 "A4"  Connecticut Avenue Securities Trust 2012-R01 "1M2" 144A(e)(g)  FNT Mortgage-Backed Pass-Through Certificate Series Trust 2001-4 "1A1"	USD	AGENCIAS  1,182 % 3,032 % 1,024 % 1,492 % 0,874 % 0,922 % 1,014 % 1,932 % 1,014 % 1,462 % 1,248 %  2,600 % 3,000 % 3,000 % 4,047 % 3,261 % 0,792 % 0,978 % 4,338 % 4,908 % 3,250 % 3,000 % 3,147 % 1,600 % 1,385 % 6,750 %	18/04/2034 18/04/2034 15/04/2029 16/01/2033 15/04/2029 18/01/2028 15/07/2034 15/04/2029 21/01/2031 15/04/2029 20/01/2034 22/10/2029 15/11/2050 15/11/2061 15/12/2051 10/10/2051 26/12/2035 25/02/2030 10/11/2049 11/04/2050 15/08/2045 25/10/2041 27/12/2066 21/09/2031	374.379 347.776 2.085.432 2.000.600 3.184.042 4.354.593 995.421 2.145.947 445.846 1.774.559 1.000.839 1.000.445 19.709.879  301.145 92.378 718.879 2.989.719 667.666 218.254 131.929 273.973 465.107 80.992 910.100 302.475 139.942 1.290.242 282	0,13 0,12 0,71 0,66 1,09 1,48 0,34 0,73 0,15 0,61 0,34

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha	a de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia s – (continuación)	ıs – (cont	inuación)				
	Impac CMB Trust Series 2004-8 "1A"(e)	USD	0,812 %		25/10/2034	13.462	0,00
	D JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2017-C7 "D" 144A <sup>(g)</sup>	USD	3.000 %		15/10/2050	612.818	0,21
	5 KnowledgeWorks Foundation 2010-1 "A" <sup>(e)</sup>	USD	1,130 %		25/02/2042	138.961	0,05
	O Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C23 "D"	000	1,100 70		LOIOLILOAL	100.001	0,00
	144Å(e)(9)	USD	4,282 %		15/07/2050	249.781	0,09
400.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 "D" 144A <sup>(g)</sup>	USD	3,060 %		15/10/2048	382.681	0,13
3 000 000	O Morgan Stanley Capital I Trust 2018-L1 "A3"	USD	4,139 %		15/10/2051	3.339.982	1,14
	O Morgan Stanley Capital I Trust 2018-L1 "D" 144A <sup>(g)</sup>	USD	3,000 %		15/10/2051	689.155	0,23
	New Residential Mortgage Loan Trust 2015-14 "A1" 144A <sup>(e)(g)</sup>	USD	3,750 %		28/05/2052	75.659	0,23
	1 PHEAA Student Loan Trust 2016-1A "A" 144A(e)(g)	USD					
		USD	1,242 %		25/09/2065	200.720 716.445	0,07
	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2005-AR8 "A2"(e)     Student Loan Consolidation Center Student Loan Trust I 2011-1 "A"		1,979 %		25/02/2036		0,24
	144A(e)(g)	USD	1,312 %		25/10/2027	30.153	0,01
	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C37 "D" 144A <sup>(e)(g)</sup>	USD	3,342 %		15/12/2049	93.285	0,03
	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C38 "D" 144A <sup>(g)</sup>	USD	3,000 %		15/07/2050	271.284	0,09
300.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RB1 "D" 144A <sup>(g)</sup>	USD_	3,401 %		15/03/2050	279.660	0,10
TOTAL DE OBL	IGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS NO EMITIDOS NI					18.000.003	6,14
GARANTIZADO	S POR AGENCIAS						40.0=
(coste USD 36.5	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					37.709.882	12,87
REGULADO	LORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO						
(coste USD 33	<u> </u>					343.803.010	117,37
(coste USD 43	RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS 2.848.651)					437.737.314	149,44
-	arantía de activos hipotecarios a plazo cubiertos – (14,65 %)		0.500.0/		10/01/0050	(4.000.004)	(4.44)
	) Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(h)(i)</sup>	USD	3,500 %		13/01/2052	(4.208.281)	(1,44)
	) Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(h)(i)</sup>	USD	3,500 %		13/12/2051	(7.365.586)	(2,51)
	) Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(h)(i)</sup>	USD	4,000 %		14/01/2052	(2.131.484)	(0,73)
•	) Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(h)(i)</sup>	USD	4,000 %		13/12/2051	(4.262.969)	(1,46)
	) Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	5,000 %		13/12/2051	(1.095.155)	(0,37)
(7.000.000	) Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)(j)</sup>	USD	2,500 %		20/12/2051	(7.211.723)	(2,46)
(11.000.000	) Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)(j)</sup>	USD	3,000 %		20/12/2051	(11.403.163)	(3,89)
(4.000.000	) Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)(j)</sup>	USD	3,500 %		20/12/2051	(4.178.909)	(1,43)
(1.000.000	) Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)(j)</sup>	USD	4,000 %		20/12/2051	(1.055.234)	(0,36)
						(42.912.504)	(14,65)
(coste USD (43	ORES HIPOTECARIOS A PLAZO CUBIERTOS .013.008))					(42.912.504)	(14,65)
Contratos de f	futuros – 0,06 %						
Número de					Valor de mercad de la asignació		% del
contratos	Descripción del valor				US		patrimonio
_	USD				4 0 40 = 1	0 67.500	2.5.
	5 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022			Larga	4.049.21		0,04
	6 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022			Larga	19.135.12		0,09
1	1 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022			Larga	2.409.25		0,00
DI HSVALÍA I A	TENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS				25.593.60	2 367.501 367.501	0,13 <b>0,13</b>
FLUSVALIALA	TENTE SOBRE CONTRATOS DE FOTOROS					307.301	0,13
Número de contratos	Descripción del valor				Valor de mercad de la asignació US	n latente	% del patrimonio
	USD						
(128	3) Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022			Corta	(15.577.000	) (147.728)	(0,05)
(6	6) Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/20	)22		Corta	(1.198.500	(41.194)	(0,02)
(2	2) Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 a	ños 22/03/	2022	Corta	(293.969		(0,00)
`	,				(17.069.469		(0,07)
MINUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS				(.7.000.400	(194.918)	(0,07)
						(107.010)	(0,07)

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones – 0,05 %

Divisa	Compra	Divisa	Venta			Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
EUR	14.331.312	USD	16.182.766			10/02/2022	161.253	0,05
PLUSVALÍA LATI	ENTE SOBRE CONTRA	ATOS DE DIVISAS A PLAZO CI	ELEBRADOS CON FINE	S DE COBE	RTURA		161.253	0,05
Divisa	Compra	Divisa	Venta			Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% del patrimonio
GBP	78.230	USD	107.653			21/01/2022	(3.050)	(0,00)
USD	763	GBP	571			21/01/2022	(1)	(0,00)
PLN USD	3.050.098 105.371	USD EUR	749.340 93.564			10/02/2022 10/02/2022	(10.114) (1.333)	(0,00) (0,00)
		RATOS DE DIVISAS A PLAZO (		ES DE COBI	ERTURA		(14.498)	(0,00)
Opciones - (0,0	1 %)							
(1)	,					Plusvalía/		
Tenencias	Descripción del valor					(minusvalía) latente Valor ( USD	de mercado en USD	% del patrimonio
	Opciones adquirida	as						
5 4 40 000	USD	0.5				(40.050)	4.440	2.22
	Call Swaption del LIBO Call Swaption del LIBO		Vence 23/12/2021 Vence 07/01/2022		ejercicio 0,63 ejercicio 0,61	(13.253) (13.144)	1.116 1.575	0,00 0,00
	Call Swaption del LIB		Vence 22/02/2022		ejercicio 0,61	(5.641)	1.019	0,00
	Call Swaption del LIB		Vence 23/03/2022		ejercicio 0,47 ejercicio 0,86	(12.432)	10.978	0,00
	Call Swaption del LIB		Vence 21/06/2022		ejercicio 1,05	(12.767)	15.518	0,01
					-,	(57.237)	30.206	0,01
	ONES ADQUIRIDAS						20.200	0.04
(coste USD 87.44	Opciones suscritas	<u> </u>					30.206	0,01
	USD	•						
(1.670.000)	Call Swaption del LIB	OR a 3 meses	Vence 23/12/2021	Precio de	ejercicio 1,30	11.040	(3.334)	(0,00)
, ,	Call Swaption del LIB		Vence 07/01/2022	Precio de	ejercicio 1,12	13.058	(1.661)	(0,00)
, ,	Call Swaption del LIB		Vence 22/02/2022		ejercicio 0,85	5.351	(1.302)	(0,00)
, ,	Call Swaption del LIB		Vence 23/03/2022		ejercicio 1,41	4.617	(18.802)	(0,01)
(1.670.000)	Call Swaption del LIB	OR a 3 meses	Vence 21/06/2022	Precio de	ejercicio 1,38	5.112	(23.169)	(0,01)
						39.178	(48.268)	(0,02)
(coste USD (87.4	ONES SUSCRITAS 46))						(48.268)	(0,02)
TOTAL DE OPCIO (coste USD (4))	ONES						(18.062)	(0,01)
Contratos de pe	ermutas financieras	- 0,20 %						
Importe teórico							Plusvalía latente en	% del
local neto	A pagar		A recibir		Divisa	Fecha de vencimiento	USD	patrimonio
4 700 000	Permutas de tipos de	e interés	Marie 11	(CDOD -				
1.720.000	Fijo 1,680 %			(CDOR a en CAD)	CAD	22/08/2028	23.563	0,01
180 000	Variable (CDOR a 3 m	neses en CAD)	Fijo 2,18	,	CAD	22/08/2052	23.303	0,00
	Fijo 1,000 %	10000 011 0712)	Fijo 1,00		USD	25/07/2024	207	0,00
	Variable (SOFR a 1 m	es en USD)	Fijo 1,53		USD	22/09/2031	22.982	0,01
PLUSVALÍA LATI	ENTE SOBRE PERMU	TAS DE TIPOS DE INTERÉS					46.816	0,02
	Permutas de incump	olimiento crediticio (CDS)						
2.000.000	Variable (The Markit C America A 11 Index)	CMBX North	Fijo 2,00	0 %	USD	18/11/2054	293.854	0,10
600.000	Variable (The Markit C		•					
900 000	America BBB- 11 Inde Variable (The Markit C	•	Fijo 3,00	0 %	USD	18/11/2054	70.733	0,02
	America BBB- 11 Inde	ex)	Fijo 3,00	0 %	USD	18/11/2054	52.345	0,02
1.200.000	Variable (The Markit C America BBB- 8 Index		Fijo 3,00	0 %	USD	17/10/2057	144.646	0,05
1.250.000	Variable (The Markit C America BBB- 8 Index	CMBX North	Fijo 3,00		USD	17/10/2057	56.621	0,02
	WILLING DDD- 0 IIIUEX	·)	Fiju 3,00	· 0 /0	USD	17710/2057	30.021	0,02

#### Contratos de permutas financieras – (continuación)

•	ermutas financieras – (continuación)					
Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS) – (continuación	n)				
650.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 10 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/11/2059	56.584	0,02
1.200.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 10 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/11/2059	70.352	0,02
PLUSVALÍA LATE	NTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMIENTO CREDITICIO (C	DS)			745.135	0,25
TOTAL DE PLUSV	/ALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE PERMUTAS FINANCIE	RAS			791.951	0,27
Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% del
	Permutas de tipos de interés					
2.420.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 1,560 %	CAD	22/08/2025	(21.121)	(0,01)
	Variable (LIBOR a 3 meses en USD) Fijo 1,630 %	Fijo 1,250 % Variable (SOFR	USD	15/12/2026	(20.380)	(0,00
2.100.000	1,500 %	a 1 mes en USD)	USD	22/09/2036	(21.741)	(0,01
MINUSVALÍA LAT	TENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTERÉS				(63.242)	(0,02
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)					
1.550.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 10 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/11/2059	(146.865)	(0,05
MINUSVALÍA LAT	ENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMIENTO CREDITICIO (C	CDS)			(146.865)	(0,05
TOTAL DE MINUS	VALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE PERMUTAS FINANCIE	ERAS			(210.107)	(0,07
VALOR DE MERO (coste USD 389.8	CADO DE LAS INVERSIONES (35.639)				395.707.930	135,09
OTROS ACTIVOS	S Y PASIVOS			(	102.781.307)	(35,09)
PATRIMONIO					292.926.623	100,00
TOTAL DE INVER	SIONES			Valo	or de mercado en USD	% de
Total inversiones e	excluyendo derivados (coste USD 432.848.651)				437.737.314	149.44
Valor de mercado	de títulos con garantía hipotecaria a plazo cubiertos (coste USD (4	13.013.008))			(42.912.504)	(14,65
Plusvalía latente s	obre contratos de futuros	,,			367.501	0,1
Minusvalía latente	sobre contratos de futuros				(194.918)	(0,07
Plusvalía latente s	obre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertu	ra			161.253	0,0
Minusvalía latente	sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobert	tura			(14.498)	(0,00
	de opciones compradas (coste USD 87.442)				30.206	0,0
	de opciones suscritas (coste USD (87.446))				(48.268)	(0,02
	obre contratos de permutas financieras				791.951	0,2
	sobre contratos de permutas financieras				(210.107)	(0,07
Otros activos y pa	•				102.781.307)	(35,09

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Australia & New Zealand Banking Group Ltd., Barclays Bank Plc., Deutsche Bank AG, Morgan Stanley & Co. International Plc., Royal Bank of Canada, State Street Bank & Trust y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Bank of America N.A., Citibank N.A. y JP Morgan Chase Bank N.A.

Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Citibank N.A., Credit Suisse, JP Morgan Securities Inc. y Morgan Stanley & Co. International Plc.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,13 %.

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- $^{(d)}$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.
- (e) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (f) Este título tiene un cupón escalonado que pasará al segundo tipo en una fecha determinada del futuro.
- (9) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (h) Los valores TBA (por confirmar) se compran sobre una vez suscrito un compromiso a plazo con un importe de principal aproximado (por lo general +/-2,5 %) y sin fecha definitiva de vencimiento. El importe real del principal y la fecha de vencimiento se determinarán tras la liquidación cuando se asignen los "pools" de hipotecas específicos.
- (i) Estos valores representan ventas por confirmar (TBA) cubiertas con posiciones FNMA largas. Estos importes se declaran por separado en el Balance de situación como Valores hipotecarios a plazo cubiertos.
- (i) Estos valores representan ventas por confirmar (TBA) cubiertas con posiciones GNMA largas. Estos importes se declaran por separado en el Balance de situación como Valores hipotecarios a plazo cubiertos.

					Valor de mercado	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en USD	% del patrimonio
	rios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	I				
Bonos – 42,13 <sup>9</sup> Argentina	<b>%</b>					
-	Bonos internacionales del Estado de Argentina	EUR	0,500 %	09/07/2029	1.310	0,01
	Bonos internacionales del Estado de Argentina	USD	1,000 %	09/07/2029	1.976	0,01
97.000	Bonos internacionales del Estado de Argentina	EUR	0,125 %	09/07/2030	33.884	0,20
	Bonos internacionales del Estado de Argentina <sup>(c)</sup>	USD	1,125 %	09/07/2035	20.623	0,12
	YPF S.A.	USD	6,950 %	21/07/2027	6.718	0,04
10.000	YPF S.A.	USD	7,000 %	15/12/2047	6.195 70.706	0,03
Baréin					70.700	0,41
	Bonos internacionales del Estado de Baréin	USD	7,375 %	14/05/2030	218.757	1,28
Belice	Bonos internacionales del Estado de Belice	USD	4,938 %	20/02/2034	259	0,00
Brasil	BOTIOS ITILETTIACIONALES DEL ESTADO DE BEILCE	030	4,936 %	20/02/2034	209	0,00
	Brazil Notas do Tesouro Nacional – Serie F	BRL	10,000 %	01/01/2025	13.940	0,08
	Brazil Notas do Tesouro Nacional – Serie F	BRL	10,000 %	01/01/2027	140.427	0,82
250.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional – Serie F	BRL	10,000 %	01/01/2029	43.321	0,25
200.000	Bonos internacionales del Estado de Brasil	USD	3,875 %	12/06/2030	188.094	1,10
					385.782	2,25
Chile 30.000.000	Bonos de la Tesorería de la República en pesos	CLP	5,000 %	01/03/2035	33.821	0,20
China						
	Agricultural Development Bank of China – Serie 2004	CNY	2,960 %	17/04/2030	229.225	1,34
630.000	China Development Bank – Serie 2010	CNY	3,090 %	18/06/2030	97.822	0,57
1.680.000	China Development Bank – Serie 2012	CNY	3,340 %	14/07/2025	268.280	1,57
	Bonos del Estado de China	CNY	2,850 %	04/06/2027	12.593	0,07
190.000	Bonos del Estado de China	CNY	3,270 %	19/11/2030	30.749	0,18
					638.669	3,73
Colombia	Dance internacionales del Fetade de Colombia	USD	4.425.0/	45/05/0054	161.644	0.05
	Bonos internacionales del Estado de Colombia TES de Colombia – Serie B	COP	4,125 % 6,250 %	15/05/2051 26/11/2025	92.659	0,95 0,54
	TES de Colombia – Serie B	COP	5,750 %	03/11/2027	31.343	0,18
	TES de Colombia – Serie B	COP	7,250 %	26/10/2050	41.123	0,24
					326.769	1,91
República Checa						
1.600.000	Bonos del Estado de la República Checa – Serie 100	CZK	0,250 %	10/02/2027	63.102	0,37
290.000	Bonos del Estado de la República Checa – Serie 103	CZK	2,000 %	13/10/2033	12.225	0,07
	Bonos del Estado de la República Checa – Serie 125	CZK	1,500 %	24/04/2040	9.298	0,05
1.250.000	Bonos del Estado de la República Checa – Serie 94	CZK	0,950 %	15/05/2030	49.160	0,29
					133.785	0,78
República Domir 150.000	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	6,400 %	05/06/2049	153.453	0,90
Ecuador						
21.928	Bonos internacionales del Estado de Ecuador	USD	6,932 %	31/07/2030	12.225	0,07
38.120	Bonos internacionales del Estado de Ecuador <sup>(c)</sup>	USD	10,174 %	31/07/2035	25.255	0,15
48.600	Bonos internacionales del Estado de Ecuador <sup>(c)</sup>	USD	0,500 %	31/07/2040	28.461	0,16
					65.941	0,38
<b>Egipto</b> 200.000	Bonos internacionales del Estado de Egipto	USD	7,625 %	29/05/2032	181.000	1,06
El Salvador						
10.000	Bonos internacionales del Estado de El Salvador	USD	6,375 %	18/01/2027	6.628	0,04
20.000	Bonos internacionales del Estado de El Salvador	USD	8,250 %	10/04/2032	13.514	0,08
					20.142	0,12
Honduras	Bonos internacionales del Estado de Honduras	USD	7,500 %	15/03/2024	209.629	1,22
Hungría	Bondo internacionales del Estado de Horidulas	000	1,500 %	15/05/2024	203.029	1,22
14.620.000	Bonos del Estado de Hungría – Serie 26/D	HUF	2,750 %	22/12/2026	42.616	0,25
33.240.000	Bonos del Estado de Hungría – Serie 27/A	HUF	3,000 %	27/10/2027	96.770	0,56

				•	Valor de mercado	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en USD	% del patrimonio
Bonos - (conti	nuación)					
Hungría – (conti	•		/			
	D Bonos del Estado de Hungría – Serie 30/A	HUF	3,000 %	21/08/2030	25.063	0,15
110.000	O OTP Bank Nyrt <sup>(d)</sup>	EUR	2,875 %	15/07/2029	129.779	0,76
					294.228	1,72
Indonesia						
	D Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	2,850 %	14/02/2030	299.425	1,75
	D Bonos del Tesoro de Indonesia – Serie FR56 D Bonos del Tesoro de Indonesia – Serie FR70	IDR IDR	8,375 % 8,375 %	15/09/2026 15/03/2024	129.532 76.418	0,76 0,44
	D Bonos del Tesoro de Indonesia – Serie FR70  D Bonos del Tesoro de Indonesia – Serie FR73	IDR	8,750 %	15/05/2024	29.157	0,44
	D Bonos del Tesoro de Indonesia – Serie FR80	IDR	7,500 %	15/06/2035	9.917	0,06
	D Bonos del Tesoro de Indonesia – Serie FR87	IDR	6,500 %	15/02/2031	141.875	0,83
					686.324	4,01
Costa de Marfil						.,
	O Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	EUR	6,625 %	22/03/2048	108.944	0,64
 Líbano						
	Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,200 %	26/02/2025	5.750	0,04
20.000	D Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,750 %	29/11/2027	2.300	0,01
50.000	D Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,850 %	25/05/2029	5.750	0,03
41.000	O Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,650 %	26/02/2030	4.715	0,03
					18.515	0,11
México						
1.566.100	D Bonos mexicanos – Serie M	MXN	5,750 %	05/03/2026	69.221	0,40
528.500	D Bonos mexicanos – Serie M 20	MXN	8,500 %	31/05/2029	26.141	0,15
1.636.000	D Bonos mexicanos – Serie M 30	MXN	10,000 %	20/11/2036	91.545	0,54
917.600	D Bonos mexicanos – Serie M 30	MXN	8,500 %	18/11/2038	44.781	0,26
	D Bonos internacionales del Estado de México	USD	4,750 %	27/04/2032	223.446	1,31
	Petroleos Mexicanos	USD	4,500 %	23/01/2026	19.640	0,12
	Petroleos Mexicanos	USD	5,350 %	12/02/2028	38.360	0,22
	O Petroleos Mexicanos	USD	5,625 %	23/01/2046	7.587	0,04
	O Petroleos Mexicanos	USD	6,350 %	12/02/2048	14.906	0,09
15.000	O Petroleos Mexicanos	USD	6,950 %	28/01/2060	12.240	0,07
					547.867	3,20
Nigeria 200.000	D Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	7,143 %	23/02/2030	190.000	1,11
Panamá			, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,			,
	) Panamá Notas del Tesoro 144A <sup>(e)</sup>	USD	3,750 %	17/04/2026	10.611	0,06
Perú						
25.000	D Bonos del Estado de Perú	PEN	5,940 %	12/02/2029	6.324	0,03
310.000	D Bonos del Estado de Perú	PEN	5,400 %	12/08/2034	69.742	0,41
100.000	O Bonos internacionales del Estado de Perú	EUR	1,250 %	11/03/2033	108.096	0,63
					184.162	1,07
Filipinas						
	D Bonos del Estado de Filipinas – Serie 1063	PHP	6,250 %	22/03/2028	5.054	0,03
460.000	D Bonos del Estado de Filipinas – Serie 1064	PHP	6,875 %	10/01/2029	10.438	0,06
					15.492	0,09
Polonia 790 000	D Bonos del Estado de Polonia – Serie 425	PLN	0,750 %	25/04/2025	179.040	1,04
	D Bonos del Estado de Polonia – Serie 425 D Bonos del Estado de Polonia – Serie 428	PLN	2,750 %	25/04/2025 25/04/2028	91.935	1,04 0,54
	D Bonos del Estado de Polonia – Serie 726	PLN	2,500 %	25/07/2026	65.428	0,38
	D Bonos del Estado de Polonia – Serie 727	PLN	2,500 %	25/07/2027	16.508	0,10
70.000	5 Bollos del Estado de Fololila Gollo 727	1 214	2,000 70	20/01/2027	352.911	2,06
Dumaní-					302.811	2,00
Rumanía 70.000	D Bonos del Estado de Rumanía – Serie 15 a	RON	3,650 %	24/09/2031	13.853	0,08
	D Bonos del Estado de Rumanía – Serie 8 a	RON	4,150 %	26/01/2028	17.255	0,10
	D Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,625 %	02/12/2040	30.316	0,18
	D Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	3,375 %	28/01/2050	42.698	0,25
					104.122	0,61
Rusia					· -	-,
	D Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6221	RUB	7,700 %	23/03/2033	49.253	0,29
5.125.000	D Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ – Serie 6226	RUB	7,950 %	07/10/2026	67.781	0,40

				V	alor de mercado	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en USD	% del patrimonio
Bonos - (contir	nuación)					
Rusia – (continua	•	5115	7.050.0/	40/04/0000	07.400	0.55
	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ – Serie 6228	RUB	7,650 %	10/04/2030	97.486	0,57
	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ - Serie 6232	RUB	6,000 %	06/10/2027	27.868	0,16
200.000	Bonos federales de Rusia - Bonos OFZ – Serie 6237	RUB	6,700 %	14/03/2029	2.459	0,01
Arabia Saudí					244.047	1,70
	Bonos internacionales del Estado saudí	USD	3,250 %	17/11/2051	194.900	1,14
Sudáfrica						
	Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2030	ZAR	8,000 %	31/01/2030	130.329	0,76
	Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2032	ZAR	8,250 %	31/03/2032	27.481	0,16
	Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2035	ZAR	8,875 %	28/02/2035	124.837	0,73
1.770.000	Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2037	ZAR	8,500 %	31/01/2037	92.168	0,54
Supranacionales					374.815	2,19
•	Eastern & Southern African Trade & Development Bank	USD	4,875 %	23/05/2024	206.260	1,20
Tailandia						
	Bonos del Estado de Tailandia	THB	2,400 %	17/12/2023	63.281	0,37
4.168.441	Bonos del Estado de Tailandia	THB	1,250 %	12/03/2028	124.080	0,72
370.000	Bonos del Estado de Tailandia	THB	2,875 %	17/12/2028	11.953	0,07
510.000	Bonos del Estado de Tailandia	THB	3,650 %	20/06/2031	17.501	0,10
2.400.000	Bonos del Estado de Tailandia	THB	3,775 %	25/06/2032	83.054	0,49
310.000	Bonos del Estado de Tailandia	THB	3,400 %	17/06/2036	10.371	0,06
2.170.000	Bonos del Estado de Tailandia	THB	3,300 %	17/06/2038	71.063	0,42
100.000	Bonos del Estado de Tailandia	THB	3,600 %	17/06/2067	3.341	0,02
					384.644	2,25
Turquía						
305.000	Bonos del Estado de Turquía	TRY	12,200 %	18/01/2023	21.552	0,12
170.000	Bonos del Estado de Turquía	TRY	11,000 %	24/02/2027	8.931	0,05
400.000	Bonos del Estado de Turquía	TRY	11,700 %	13/11/2030	19.978	0,12
350.000	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	4,875 %	09/10/2026	323.419	1,89
					373.880	2,18
Ucrania 100 000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	7,750 %	01/09/2024	100.214	0,58
	Bonos internacionales del Estado de Ucrania <sup>(d)</sup>	USD	0,000 %	31/05/2040	18.049	0,11
20.000	Solide internationalist del Estado de Columb	005		0.000,2010	118.263	0,69
Reino Unido						-,,,,
200.000	Gazprom PJSC Via Gaz Finance Plc.	USD	3,250 %	25/02/2030	193.507	1,13
Estados Unidos	1714 01 7 1 114	0111/	0.000.04	00/05/0000	400.000	0.70
	JPMorgan Chase Bank NA	CNY	3,290 %	23/05/2029	122.690	0,72
Venezuela 560.000	Petroleos de Venezuela S.A.	USD	6,000 %	16/05/2024	26.600	0,16
440.000	Petroleos de Venezuela S.A.	USD	6,000 %	15/11/2026	21.340	0,12
			-		47.940	0,28
TOTAL DE BONO					7 242 625	42.42
(coste USD 8.328	5.502)				7.213.635	42,13
Tenencias	Descripción del valor			V	alor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ordin	arias – 45,21 %					
Argentina	Managed the state				440.050	0.00
	MercadoLibre, Inc.				112.659	0,66
18.114	Aeris Industria E Comercio De Equipamentos Para Geracao	De Energia S.A.	-		24.193	0,14
	Banco Bradesco S.A.—Preferente	- 3			38.568	0,22
	Blau Farmaceutica S.A.				16.665	0,10
	Boa Vista Servicos S.A.				13.450	0,08
	Caixa Seguridade Participacoes S.A.				22.630	0,00
	Clear Sale S.A.					
	Hapvida Participacoes e Investimentos S.A. 144A <sup>(e)</sup>				8.426	0,05 0,17
	Locaweb Servicos de Internet S.A. 144A				28.687 41.885	0,17
10.900	LOCAWOD GETVICOS DE ITITÉTITET G.A.				41.000	0,24

Tenencias		Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones Brasil - (c		arias – (continuación)		
Diasii – (C		Pagseguro Digital Ltd. "A"	14.899	0,09
		Qualicorp Consultoria e Corretora de Seguros S.A.	7.066	0,04
		Rede D'Or Sao Luiz S.A. 144A <sup>(e)</sup>	35.582	0,21
			252.051	1,47
China				
		Alibaba Group Holding Ltd.—ADR <sup>(f)</sup>	188.616 16.051	1,10
		ANTA Sports Products Ltd. Beijing Easpring Material Technology Co. Ltd. "A"	38.134	0,09 0,22
		Bilibili. Inc.—ADR <sup>(f)</sup>	47.341	0,22
		China Feihe Ltd. 144A <sup>(e)</sup>	33.475	0,20
	20.000	China Merchants Bank Co., Ltd. "H"	155.635	0,91
	700	Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. "A"	75.478	0,44
		Ecovacs Robotics Co., Ltd. "A"	41.484	0,24
		ENN Energy Holdings Ltd.	101.412	0,59
		Full Truck Alliance Co., Ltd.—ADR <sup>(†)</sup>	27.263	0,16
		Hangzhou Robam Appliances Co., Ltd. "A"  Jiumaojiu International Holdings Ltd. 144A <sup>(e)</sup>	35.186 29.198	0,21 0,17
		Kweichow Moutai Co., Ltd. "A"	99.890	0,17
		Luxshare Precision Industry Co., Ltd. "A"	43.792	0,26
		Meituan "B" 144A <sup>(e)</sup>	191.344	1,12
	12.000	Minth Group Ltd.	55.904	0,33
		Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. "H"	76.810	0,45
		Qingdao Haier Biomedical Co., Ltd. "A"	26.621	0,15
		SF Holding Co., Ltd. "A"	38.586	0,22
		Silergy Corp. Sunny Optical Technology Group Co., Ltd.	168.894 79.160	0,99
		Tencent Holdings Ltd.	79.160 455.019	0,46 2,66
		Topsports International Holdings Ltd. 144A <sup>(e)</sup>	32.725	0,19
		WuXi AppTec Co., Ltd. "H" 144A <sup>(e)</sup>	60.073	0,35
		Yunnan Aluminium Co., Ltd. "A"	33.086	0,19
	1.332	Zepp Health Corp.—ADR <sup>(f)</sup>	9.937	0,06
	10.668	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co., Ltd. "A"	39.099	0,23
			2.200.213	12,85
Chipre	1.231	TCS Group Holding Plc.—GDR <sup>(f)</sup>	116.920	0,68
Egipto				
	14.671	Commercial International Bank Egypt SAE—GDR <sup>(f)</sup>	45.333	0,26
Grecia	0.700		44.044	0.00
		Hellenic Exchanges - Athens Stock Exchange S.A.  JUMBO S.A.	11.214	0,06
		Sarantis S.A.	30.328 30.417	0,18 0,18
	3.112	Salatius S.A.	71.959	0,10
Hong Kon	20		71.959	0,42
riong Ron	•	AIA Group Ltd.	101.791	0,59
		Alibaba Health Information Technology Ltd.	5.892	0,03
		China Mengniu Dairy Co., Ltd.	72.818	0,43
	1.355	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	75.225	0,44
		Sino Biopharmaceutical Ltd.	47.623	0,28
	2.500	Techtronic Industries Co., Ltd.	51.885	0,30
			355.234	2,07
Hungría	1.017	OTP Bank Nyrt	56.026	0,33
India				
	1.195	Amber Enterprises India Ltd.	48.171	0,28
	475	Atul Ltd.	20.309	0,12 0,36
	983	Avenue Supermarts Ltd. 144A <sup>(e)</sup> Cartrade Tech Ltd.	61.766 12.205	
	983 998 966	Avenue Supermarts Ltd. 144A <sup>(e)</sup> Cartrade Tech Ltd. Computer Age Management Services Ltd.	12.205 39.671	0,07 0,23
	983 998 966 6.737	Avenue Supermarts Ltd. 144A <sup>(e)</sup> Cartrade Tech Ltd. Computer Age Management Services Ltd. Crompton Greaves Consumer Electricals Ltd.	12.205 39.671 40.264	0,07 0,23 0,24
	983 998 966 6.737 649	Avenue Supermarts Ltd. 144A <sup>(e)</sup> Cartrade Tech Ltd. Computer Age Management Services Ltd. Crompton Greaves Consumer Electricals Ltd. Divi's Laboratories Ltd.	12.205 39.671 40.264 42.197	0,07 0,23 0,24 0,25
	983 998 966 6.737 649 438	Avenue Supermarts Ltd. 144A <sup>(e)</sup> Cartrade Tech Ltd. Computer Age Management Services Ltd. Crompton Greaves Consumer Electricals Ltd.	12.205 39.671 40.264	0,07 0,23 0,24
	983 998 966 6.737 649 438 3.009	Avenue Supermarts Ltd. 144A <sup>(e)</sup> Cartrade Tech Ltd. Computer Age Management Services Ltd. Crompton Greaves Consumer Electricals Ltd. Divi's Laboratories Ltd. FSN E-Commerce Ventures Ltd.	12.205 39.671 40.264 42.197 14.223	0,07 0,23 0,24 0,25 0,08

Acciones ordina India – (continuac	rias – (continuación)		
(00	ión)		
5 359	Infosys Ltd.	123.019	0,72
	Kotak Mahindra Bank Ltd.	63.887	0,37
	Navin Fluorine International Ltd.	75.883	0,44
2.028	Route Mobile Ltd.	49.140	0,29
2.595	SBI Life Insurance Co., Ltd. 144A <sup>(e)</sup>	40.183	0,23
	Sona BLW Precision Forgings Ltd. 144A <sup>(e)</sup>	52.729	0,31
	Tata Consumer Products Ltd.	50.123	0,29
	TeamLease Services Ltd.	45.812	0,27
	Wipro Ltd.	55.705	0,33
37.241	Zomato Ltd.	75.595 1.093.484	6,39
Indonesia		1.033.404	0,00
	Bank BTPN Syariah Tbk PT	30.617	0,18
	Bank Central Asia Tbk PT	103.913	0,61
454.300	BFI Finance Indonesia Tbk PT	30.926	0,18
57.800	Map Aktif Adiperkasa PT	10.049	0,06
	Pakuwon Jati Tbk PT	16.283	0,09
27.436	Semen Indonesia Persero Tbk PT	15.352	0,09
México		207.140	1,21
8.799	Arca Continental SAB de CV	54.755	0,32
19.900	Gentera SAB de CV	10.278	0,06
19.034	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV "A"	28.645	0,17
7.694	Prologis Property Mexico S.A. de CV	17.408	0,10
17.700	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	57.218	0,33
		168.304	0,98
Filipinas	Del Monte Pacific Ltd.	3.943	0.00
	Jollibee Foods Corp.	30.550	0,02 0,18
	Monde Nissin Corp. 144A <sup>(e)</sup>	58.152	0,10
172.200	Horico Hoosil Gorp. 14477	92.645	0,54
Polonia			
673	Dino Polska S.A. 144A <sup>(e)</sup>	56.283	0,33
	InPost S.A.	38.781	0,23
4.848	Powszechna Kasa Oszczedności Bank Polski S.A.	51.489	0,30
		146.553	0,86
<b>Rusia</b> 25 710	Detsky Mir PJSC 144A <sup>(e)</sup>	47.961	0,28
	Fix Price Group Ltd.—GDR <sup>(f)</sup>	34.042	0,20
	Fix Price Group Ltd.—GDR 144A <sup>(e)(f)</sup>	8.795	0,05
	Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC	21.915	0,13
	Ozon Holdings Plc.—ADR <sup>(f)</sup>	40.872	0,24
	Renaissance Insurance Group JSC	16.449	0,09
	Sberbank of Russia PJSC	67.170	0,39
	United Medical Group CY Plc.—GDR <sup>(f)</sup>	14.991	0,09
1.037	Yandex NV "A"	75.846	0,44
Arabia Saudí		328.041	1,91
	Saudi National Bank	66.396	0,39
Singapur			
	Nanofilm Technologies International Ltd.  Sea Ltd.—ADR <sup>(f)</sup>	38.654	0,22
	Sea Ltd.—ADR <sup>(f)</sup> TDCX, Inc.—ADR <sup>(f)</sup>	59.481 11.875	0,35 0,07
033	TDGA, IIIC.—ADK	110.010	0,67
		110.010	0,04
Eslovenia	Never Linkling to Books day ODD(f)	28.410	0,17
Eslovenia 1.659	Nova Ljubljanska Banka dd—GDR <sup>(f)</sup>		
1.659 Sudáfrica			
1.659 <b>Sudáfrica</b> 2.039	Clicks Group Ltd.  JSE Ltd.	36.158 26.211	0,21 0,15

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ordin	arias – (continuación)		
Sudáfrica – (con	,		
	Santam Ltd.	19.046	0,11
16.106	Transaction Capital Ltd.	43.023	0,25
		173.248	1,01
Corea del Sur	Fila Holdings Corp.	20.554	0,12
	Hankook Tire & Technology Co., Ltd.	26.542	0,15
	KB Financial Group, Inc.	51.019	0,30
90	Krafton, Inc.	38.109	0,22
637	LG Electronics, Inc.	62.194	0,36
	NAVER Corp.	98.453	0,57
	NCSoft Corp.	73.380	0,43
	NHN KCP Corp.	23.478	0,14
	Orion Corp.	40.303	0,24
0.743	Samsung Electronics Co., Ltd.	405.874	2,37
		839.906	4,90
Taiwán 1 000	ASMedia Technology, Inc.	69.943	0,41
	Chailease Holding Co., Ltd.	53.559	0,31
	MediaTek, Inc.	109.122	0,64
	momo.com, Inc.	83.476	0,49
1.000	Nien Made Enterprise Co., Ltd.	13.667	0,08
26.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	556.883	3,25
	Tong Hsing Electronic Industries Ltd.	43.598	0,25
	United Microelectronics Corp.	64.738	0,38
1.000	Win Semiconductors Corp.	13.070	0,08
-		1.008.056	5,89
Tailandia	Airports of Theiland DCI	38.917	0,23
	Airports of Thailand PCL Kasikornbank PCL	54.650	0,23
10.000	Tabliofibalit 1 02	93.567	0,55
Turquía		35.561	
•	Mavi Giyim Sanayi ve Ticaret AS "B" 144A(e)	12.963	0,07
Emiratos Árabes	Unidos		
20.015	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	46.317	0,27
Reino Unido			
	VTEX "A"	32.085	0,19
Estados Unidos	EDAM Cystoma, Inc.	20 522	0.10
	EPAM Systems, Inc. Samsonite International S.A. 144A <sup>(e)</sup>	30.532 33.868	0,18 0,20
10.000	Samonic memaloral GA. 14470	64.400	0,38
Uruguay		04.400	
	Dlocal Ltd.	20.016	0,12
TOTAL DE ACCIO	DNES ORDINARIAS	7.741.936	45,21
Fondos de inve		1.171.330	
Luxemburgo	131011 - 0,10 /0		
-	Goldman Sachs Funds - Emerging Markets Corporate Bond Portfolio(g)	1.052.281	6,15
TOTAL DE FOND	OS DE INVERSIÓN .578)	1.052.281	6,15
-	RES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VALORES OFICIAL	<del>-</del>	
(coste USD 15.41		16.007.852	93,49

Tenencias	Descripción del valo	•		Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de patrimonio
	biliarios negociados er		egulado	2				Patimoni
Bonos – 0,7	=	i ou o moroado i	oguidao					
Estados Uni								
1.581.000	0.000 Bonos del Tesoro de	Indonesia – JPMo	rgan Chase Bank NA	IDR	8,375 %	15/03/2034	125.012	0,73
TOTAL DE B							125.012	0,73
TOTAL DE V	ALORES MOBILIARIOS N	IEGOCIADOS EN	OTRO MERCADO REGULADO				405.040	
(coste USD 1 VALOR DE N	125.785) MERCADO DE LAS INVER	SIONES EXCLUY	ENDO DERIVADOS				125.012	0,73
(coste USD 1	15.541.142)						16.132.864	94,22
Contratos d	de futuros – 0,08 %							
						Compromiso	Plusvalía	
Número de contratos	Descripción del valor				,	Valor de mercado en USD	latente en USD	% de patrimonio
	EUR							paamone
(3)	Futuros sobre bonos de l	a República Feder	al de Alemania a 10 años					
(0)	08/12/2021	a 1 topubilou 1 ouoi	ar ac / nomama a 10 anos		Corta	(589.008)	455	0,00
1	Futuros sobre bonos de I	a República Feder	al de Alemania a 2 años 08/12/2021		Larga	127.945	177	0,00
						(461.063)	632	0,00
	USD							
1	Futuros sobre pagarés de	el Tesoro de EE. U	U. a 10 años 22/03/2022		Larga	131.063	2.145	0,01
	Futuros sobre pagarés de				Larga	219.023	668	0,00
	Futuros sobre pagarés de		U. a 5 años 31/03/2022 a muy largo plazo 22/03/2022		Larga Larga	243.391 399.500	2.464 11.678	0,02 0,07
2	. I utulos sobie bollos del	resort de LL. OO.	a muy largo piazo 22/03/2022		Laiya			
						992.977	16.955	0,10
PLUSVALÍA	LATENTE SOBRE CONTI	RATOS DE FUTUR	NOS				17.587	0,10
Número de						Compromiso Valor de mercado en	Minusvalía latente	% de
contratos	Descripción del valor					USD	USD	patrimonio
1	EUR Futuros sobre bonos de l	a República Feder	al de Alemania a 5 años 08/12/2021		Larga	154.338	(239)	(0,00)
(1)	USD Futuros sobre pagarés del	Tesoro de EE. UU.	a muv largo plazo a 10 años					
	22/03/2022				Corta	(146.984)	(2.998)	(0,02)
MINUSVALÍA	A LATENTE SOBRE CONT	RATOS DE FUTU	ROS				(3.237)	(0,02)
Contratos d	de divisas a plazo – (0,1	0 %)						
							Plusvalía	
Divisa	Compra	Divisa	Venta			Fecha de vencimiento	latente USD	% del patrimonio
BRL	653.403	USD	116.564			02/12/2021	106	0,00
USD	116.909	BRL	653.403			02/12/2021	238	0,00
USD	84.548	TRY	748.186			14/12/2021	27.764	0,16
USD	50.936	MXN	1.027.336			15/12/2021	2.882	0,02
USD USD	127.313 90.315	THB TRY	4.164.922 804.418			15/12/2021 15/12/2021	3.717 29.291	0,02 0,17
USD	35.265	ZAR	508.329			15/12/2021	3.447	0,02
USD	32.204	ZAR	506.391			03/02/2022	722	0,00
USD	26.698	IDR	384.312.230			10/02/2022	42	0,00
USD	9.709	TRY	94.529			23/02/2022	2.785	0,02
USD	39.524	TRY	386.861			06/04/2022	11.863	0,07
PLUSVALÍA	LATENTE SOBRE CONT	RATOS DE DIVISA	S A PLAZO				82.857	0,48
						Fecha de	Plusvalía latente	
Divisa	Compra	Divisa	Venta			vencimiento	USD	% del patrimonio
PLN	53.169	USD	13.916			15/12/2021	(976)	(0,01)
RON	544.812	USD	127.175			15/12/2021	(2.041)	(0,01)
THB	3.708.704	USD	113.088			15/12/2021	(3.030)	(0,02)
TRY	507.871	USD	52.247			15/12/2021	(13.720)	(0,08)
USD	294.976	CNH	1.920.472			15/12/2021	(6.287)	(0,04) (0,00)
BRL	653.403	USD	116.053			04/01/2022	(197)	(

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
MXN	4.098.684	USD	200.400	24/01/2022	(10.139)	(0,06)
CZK	2.789.119	USD	127.833	31/01/2022	(3.853)	(0,02)
USD	61.860	CZK	1.404.751	31/01/2022	(583)	(0,00)
CLP	51.454.966	USD	62.442	07/02/2022	(1.304)	(0,01)
MYR	1.480.613	USD	354.239	09/02/2022	(3.433)	(0,02)
PEN	24.095	USD	5.972	10/02/2022	(63)	(0,00)
PLN	205.250	USD	50.420	10/02/2022	(675)	(0,00)
RUB	4.341.451	USD	60.216	10/02/2022	(2.525)	(0,02)
USD	466.335	EUR	412.606	10/02/2022	(4.218)	(0,02)
USD	64.766	PLN	269.569	10/02/2022	(567)	(0,00)
TRY	139.017	USD	13.503	23/02/2022	(3.321)	(0,02)
TRY	1.516.613	USD	151.460	06/04/2022	(43.019)	(0,25)
MINUSVALÍA L	MINUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO					

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones – (0,41 %)

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	latente USD	% del patrimonio
USD	115.749	SGD	156.000	15/12/2021	1.366	0,01
PLUSVALÍA LAT	ENTE SOBRE CONTR	PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA		1.366	0,01	

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
AUD	382.000	USD	281.578	15/12/2021	(7.954)	(0,05)
EUR	176.000	USD	208.954	15/12/2021	(8.602)	(0,05)
GBP	346.000	USD	477.068	15/12/2021	(14.736)	(0,09)
SGD	3.794.000	USD	2.821.907	15/12/2021	(40.041)	(0,23)
MINUSVALÍA LA	ATENTE SOBRE CONT	RATOS DE DIVISA	S A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA		(71.333)	(0.42)

### Contratos de permutas financieras – 0,12 %

Importe teórico				Fecha de	Plusvalía latente	
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	vencimiento	USD	% del patrimonio
	Permutas de tipos de interés					
1.240.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,650 %	MYR	27/02/2024	7.650	0,05
1.390.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,693 %	MYR	01/03/2024	8.904	0,05
170.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,330 %	MYR	31/05/2024	784	0,00
250.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,250 %	MYR	18/12/2024	1.024	0,01
PLUSVALÍA LATEN	NTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE	INTERÉS			18.362	0,11
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)					
80.000	Variable (Bonos extranjeros rusos -					
	Eurobono)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2025	449	0,00
70.000	Variable (Bonos internacionales del					
	Estado de Indonesia)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	1.157	0,01
PLUSVALÍA LATE	NTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLI	MIENTO CREDITICIO (CDS)			1.606	0,01
TOTAL DE PLUSVA	ALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS D	E PERMUTAS FINANCIERAS			19.968	0,12
VALOR DE MERCA	ADO DE LAS INVERSIONES					
(coste USD 15.541	.142)			1	16.080.121	93,91
OTROS ACTIVOS	Y PASIVOS				1.042.721	6,09
PATRIMONIO				1	17.122.842	100,00

TOTAL DE INVERSIONES	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Total inversiones excluyendo derivados (coste USD 15.541.142)	16.132.864	94,22
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	17.587	0,10
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(3.237)	(0,02)
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	82.857	0,48
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	(99.951)	(0,58)
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	1.366	0,01
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	(71.333)	(0,42)
Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	19.968	0,12
Otros activos y pasivos	1.042.721	6,09
Patrimonio	17.122.842	100,00

El Comisionista de futuros fue Morgan Stanley & Co., Inc.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., Morgan Stanley & Co., Inc., Natwest Markets Plc. y State Street Bank & Trust.

Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Citibank N.A., Morgan Stanley y Morgan Stanley & Co. International Plc.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,26 %.

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) Este título tiene un cupón escalonado que pasará al segundo tipo en una fecha determinada del futuro.
- (d) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (e) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (f) Los títulos se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional)).
- (g) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

						Valor de mercado	
Tenencia	ıs	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en USD	% del patrimonio
Valores	mobiliari	os admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial				,	
	- 26,70 %						
Australi	а						
		APT Pipelines Ltd.	GBP	3,125 %	18/07/2031	143.970	0,1
		Australia & New Zealand Banking Group Ltd. (c)	EUR	0,669 %	05/05/2031	280.011	0,21
		Australia & New Zealand Banking Group Ltd. (c)	GBP	1,809 %	16/09/2031	131.098	0,10
		Bonos del Estado de Australia – Serie 138 Macquarie Bank Ltd.	AUD GBP	3,250 % 1,125 %	21/04/2029 15/12/2025	216.948 132.343	0,16 0,10
		Westpac Banking Corp.(c)	USD	2,668 %	15/11/2035	98.041	0,10
	100.000	Westpac Banking Gorp.	OOD	2,000 70	13/11/2000	1.002.411	
						1.002.411	0,75
Austria	200 000	ams AG	USD	7,000 %	31/07/2025	211.500	0,16
		Erste Group Bank AG <sup>(c)</sup>	EUR	1,000 %	10/06/2030	114.394	0,08
		Raiffeisen Bank International AG <sup>(c)</sup>	EUR	1,375 %	17/06/2033	112.732	0,08
	100.000	Volksbank Wien AG	EUR	0,875 %	23/03/2026	114.516	0,09
						553.142	0,41
Bélgica							
		Ageas S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	1,875 %	24/11/2051	114.307	0,08
		Bonos del Estado de Bélgica – Serie 60 144A <sup>(d)</sup>	EUR	4,250 %	28/03/2041	58.136	0,04
	20.000	Bonos del Estado de Bélgica – Serie 80 144A <sup>(d)</sup>	EUR	2,150 %	22/06/2066	34.013	0,03
						206.456	0,15
Bermud		IHS Markit Ltd.	USD	4,000 %	01/03/2026	92.544	0,07
016	03.000	III I Walkit Liu.		4,000 /6	01/03/2020	92.544	0,07
Canadá	45.000	1011778 BC ULC Via New Red Finance, Inc.	USD	4,000 %	15/10/2030	43.425	0,03
		Bank of Nova Scotia	GBP	1,250 %	17/12/2025	132.836	0,10
		Bausch Health Cos., Inc.	USD	5,250 %	30/01/2030	198.950	0,15
		Bonos del Estado de Canadá	CAD	0,250 %	01/03/2026	337.573	0,25
		Bonos del Estado de Canadá	CAD	0,500 %	01/12/2030	179.825	0,13
		Bonos del Estado de Canadá	CAD	2,000 %	01/12/2051	72.839	0,06
						965.448	0,72
Islas Ca	imán						
		Avolon Holdings Funding Ltd.	USD	3,950 %	01/07/2024	183.948	0,14
		Seagate HDD Cayman	USD	3,125 %	15/07/2029	142.312	0,10
	100.000	ocagate (188 Gayman	002	0,120 70	10/01/2020	326.260	0,24
Dinama	rea					320.200	0,24
Dillallia		Danske Bank A/S <sup>(c)</sup>	EUR	1,375 %	12/02/2030	172.676	0,13
	100.000	Nykredit Realkredit AS <sup>(c)</sup>	EUR	0,875 %	28/07/2031	113.034	0,08
						285.710	0,21
Finlandi	ia						
		Citycon OYJ <sup>(c)</sup>	EUR	3,625 %	Perp.	109.569	0,08
		Nordea Bank Abp <sup>(c)</sup>	GBP	1,625 %	09/12/2032	129.078	0,10
	150.000	SBB Treasury OYJ	EUR	0,750 %	14/12/2028	163.658	0,12
						402.305	0,30
Francia	100 000	Agence Francisco de Develones	EUD	0.405.07	00/00/0004	440 440	0.00
		Agence Française de Developpement EPIC	EUR	0,125 %	29/09/2031	113.416	0,08
		BNP Paribas S.A. <sup>(c)</sup> BNP Paribas S.A. <sup>(c)</sup>	USD	4,375 % 0,875 %	01/03/2033	354.946 110.161	0,26
		CNP Assurances <sup>(c)</sup>	EUR	·	31/08/2033	110.161	0,08 0,09
		Crédit Agricole S.A. <sup>(c)</sup>	EUR EUR	2,000 % 1,625 %	27/07/2050 05/06/2030	117.958 233.612	0,09
		Électricité de France S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	2,625 %		230.130	0,17
		Bonos del Estado de Francia OAT	EUR	0,500 %	Perp. 25/05/2025	307.536	0,17
		Bonos del Estado de Francia OAT	EUR	(0,512 %)	25/02/2026	93.127	0,23
		Bonos del Estado de Francia OAT	EUR	4,500 %	25/04/2041	80.423	0,07
		Bonos del Estado de Francia OAT  Bonos del Estado de Francia OAT	EUR	·			0,06
				3,250 % 1,750 %	25/05/2045	73.232	
		Bonos del Estado de Francia OAT 144A <sup>(d)</sup>	EUR	1,750 %	25/05/2066	61.703	0,05
		Société Générale S.A. <sup>(c)</sup> Société Générale S.A. <sup>(c)</sup>	EUR EUR	0,875 % 1,125 %	22/09/2028 30/06/2031	229.712 113.233	0,17 0,08
	100.000	Obtate Generale G.A.M	EUR	1,125 %	30/00/2031		
A1						2.119.189	1,57
Alemani		Commerzbank AG <sup>(c)</sup>	EUR	1,375 %	29/12/2031	111.652	0,08
							,

Alemania - 25	Descripción del va  continuación) - (continuación) 50.000 Deutsche Bank AG 00.000 Deutsche Bank AG 00.000 Deutsche Bank AG 00.000 AIB Group Plc. (c) 00.000 Bank of Ireland Gr 00.000 Aeroporti di Roma 00.000 Aeroporti di Roma 00.000 Aeroporti di Roma 00.000 Bank of Ireland Gr 00.000 Buoni poliennali de 10.000 Buoni poliennali de 10.000 Buoni poliennali de 10.000 Buoni poliennali de 10.000 Buoni Polienn 00.000 Bono del Estado d	oup PIc.(c) oup PIc.(c) oup PIc.(c)  SpA 6,5 a(c) pA el Tesoro Italia el Tesoro Italia el Tesoro 144A(d) hali Del Tesoro 144A(d) hali Del Tesoro 144A(d) hali Del Tesoro 144A(d)	EUR	1,750 % 1,375 % 1,375 % 1,375 % 0,625 % 0,950 % 6,000 % 0,950 % 2,950 % 2,800 %	Perp. 10/05/2027 11/08/2031  30/07/2031 Perp. 24/02/2026 15/03/2023 01/05/2031 01/12/2031 01/09/2038 01/03/2067	250.745 227.975 590.372 247.253 112.490 111.900 471.643 116.703 110.886 282.633 486.815 184.471 79.782 112.438 39.618	0,15 0,17 0,44 0,16 0,08 0,08 0,08 0,08 0,09 0,09 0,09 0,09
Alemania - 25	- (continuación) 50.000 Deutsche Bank AG 00.000 Deutsche Bank AG 00.000 AIB Group Plc. (c) 00.000 Bank of Ireland Gr 00.000 Aeroporti di Roma 00.000 Aeroporti di Roma Enel SpA – Serie 6 50.000 Intesa Sanpaolo S 00.000 Buoni poliennali de 10.000 Buoni poliennali de 10.000 Italy Buoni Polienn 100.000 Italy Buoni Polienn 100.000 Italy Buoni Polienn 100.000 Bono del Estado d 10.000 Bono del Estado d	oup Plc. <sup>(6)</sup> oup Plc. <sup>(6)</sup> oup Plc. <sup>(6)</sup> SpA 8,5 a <sup>(6)</sup> pA el Tesoro Italia el Tesoro Italia el Tesoro 144A <sup>(d)</sup> hali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> hali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> el Japón – Serie 14	EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR	4,625 %  6,250 % 0,375 % 1,375 %  1,750 % 1,375 % 0,625 % 0,950 % 6,000 % 0,950 % 2,950 % 2,800 %	Perp. 10/05/2027 11/08/2031 30/07/2031 Perp. 24/02/2026 15/03/2023 01/05/2031 01/12/2031 01/09/2038	227.975 590.372 247.253 112.490 111.900 471.643 116.703 110.886 282.633 486.815 184.471 79.782 112.438 39.618	0,1' 0,4' 0,1! 0,00 0,00 0,3: 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00
25 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20	Deutsche Bank AG Deutsc	oup Plc. <sup>(6)</sup> oup Plc. <sup>(6)</sup> oup Plc. <sup>(6)</sup> SpA 8,5 a <sup>(6)</sup> pA el Tesoro Italia el Tesoro Italia el Tesoro 144A <sup>(d)</sup> hali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> hali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> el Japón – Serie 14	EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR	4,625 %  6,250 % 0,375 % 1,375 %  1,750 % 1,375 % 0,625 % 0,950 % 6,000 % 0,950 % 2,950 % 2,800 %	Perp. 10/05/2027 11/08/2031 30/07/2031 Perp. 24/02/2026 15/03/2023 01/05/2031 01/12/2031 01/09/2038	227.975 590.372 247.253 112.490 111.900 471.643 116.703 110.886 282.633 486.815 184.471 79.782 112.438 39.618	0,1 0,4 0,1 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
Irlanda	20.000 Deutsche Bank AG 20.000 AIB Group Plc. (c) 20.000 Bank of Ireland Gr 20.000 Aeroporti di Roma 20.000 Aeroporti di Roma 20.000 Bank of Ireland Gr 20.000 Bene Sanpaolo S 20.000 Buoni poliennali de 20.000 Buoni poliennali de 20.000 Italy Buoni Polienn 20.000 Italy Buoni Polienn 20.000 Bono del Estado d	oup Plc. <sup>(6)</sup> oup Plc. <sup>(6)</sup> oup Plc. <sup>(6)</sup> SpA 8,5 a <sup>(6)</sup> pA el Tesoro Italia el Tesoro Italia el Tesoro 144A <sup>(d)</sup> hali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> hali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> el Japón – Serie 14	EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR	4,625 %  6,250 % 0,375 % 1,375 %  1,750 % 1,375 % 0,625 % 0,950 % 6,000 % 0,950 % 2,950 % 2,800 %	Perp. 10/05/2027 11/08/2031 30/07/2031 Perp. 24/02/2026 15/03/2023 01/05/2031 01/12/2031 01/09/2038	227.975 590.372 247.253 112.490 111.900 471.643 116.703 110.886 282.633 486.815 184.471 79.782 112.438 39.618	0,17 0,44 0,11 0,08 0,08 0,08 0,08 0,08 0,02 0,34 0,14 0,06 0,08
Irlanda	00.000 AIB Group Plc. (c) 00.000 Bank of Ireland Gr 00.000 Bank of Ireland Gr 00.000 Aeroporti di Roma 00.000 Enel SpA – Serie 6 00.000 Buoni poliennali de 10.000 Buoni poliennali de 10.000 Italy Buoni Polienn 10.000 Italy Buoni Polienn 10.000 Bono del Estado d	oup Plc. <sup>(c)</sup> oup Plc. <sup>(c)</sup> SpA 3,5 a <sup>(c)</sup> pA el Tesoro Italia el Tesoro Italia lali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> lali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> lali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup>	EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR	6,250 % 0,375 % 1,375 %  1,750 % 1,375 %  0,625 % 0,950 % 6,000 % 0,950 % 2,950 % 2,800 %	Perp. 10/05/2027 11/08/2031 30/07/2031 Perp. 24/02/2026 15/03/2023 01/05/2031 01/12/2031 01/09/2038	247.253 112.490 111.900 471.643 116.703 110.886 282.633 486.815 184.471 79.782 112.438 39.618	0,44  0,11  0,08  0,08  0,38  0,08  0,08  0,22  0,38  0,14  0,06  0,08  0,09
20 11 10 11 11 11 11 25 42 42 11 5 5 7 7 8 8 6 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9	20.000 Bank of Ireland Gr 20.000 Bank of Ireland Gr 20.000 Aeroporti di Roma 20.000 Enel SpA – Serie 6 20.000 Buoni poliennali de 20.000 Buoni poliennali de 20.000 Buoni poliennali de 20.000 Italy Buoni Polienn 20.000 Italy Buoni Polienn 20.000 Bono del Estado de 20.000 Bono del Estado de 20.000 Bono del Estado del 20.000 Bono del Estado del	SpA 8,5 a(c) pA el Tesoro Italia el Tesoro Italia el Tesoro 144A(d) el Del Tesoro 144A(d) el Del Tesoro 144A(d) el Del Tesoro 144A(d)	EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR	1,750 % 1,375 %  1,750 % 1,375 % 0,625 % 0,950 % 6,000 % 0,950 % 2,950 % 2,800 %	30/07/2031 Perp. 24/02/2026 15/03/2023 01/105/2031 01/12/2031	247.253 112.490 111.900 471.643 116.703 110.886 282.633 486.815 184.471 79.782 112.438 39.618	0,15 0,08 0,08 0,08 0,08 0,08 0,2 0,36 0,14 0,06 0,08
20 11 10 11 11 11 11 25 42 42 11 5 5 7 7 8 8 6 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9	20.000 Bank of Ireland Gr 20.000 Bank of Ireland Gr 20.000 Aeroporti di Roma 20.000 Enel SpA – Serie 6 20.000 Buoni poliennali de 20.000 Buoni poliennali de 20.000 Buoni poliennali de 20.000 Italy Buoni Polienn 20.000 Italy Buoni Polienn 20.000 Bono del Estado de 20.000 Bono del Estado de 20.000 Bono del Estado del 20.000 Bono del Estado del	SpA 8,5 a(c) pA el Tesoro Italia el Tesoro Italia el Tesoro 144A(d) el Del Tesoro 144A(d) el Del Tesoro 144A(d) el Del Tesoro 144A(d)	EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR	1,750 % 1,375 %  1,750 % 1,375 % 0,625 % 0,950 % 6,000 % 0,950 % 2,950 % 2,800 %	30/07/2031 Perp. 24/02/2026 15/03/2023 01/105/2031 01/12/2031	112.490 111.900 471.643 116.703 110.886 282.633 486.815 184.471 79.782 112.438 39.618	0,08 0,08 0,08 0,08 0,00 0,02 0,38 0,14 0,06 0,08
10 10 11 11 10 24 44 11 17 17 18 18 18 18 18 18 18 18 18 18 18 18 18	20.000 Bank of Ireland Gr 20.000 Bank of Ireland Gr 20.000 Aeroporti di Roma 20.000 Enel SpA – Serie 6 20.000 Buoni poliennali de 20.000 Buoni poliennali de 20.000 Buoni poliennali de 20.000 Italy Buoni Polienn 20.000 Italy Buoni Polienn 20.000 Bono del Estado de 20.000 Bono del Estado de 20.000 Bono del Estado del 20.000 Bono del Estado del	SpA 8,5 a(c) pA el Tesoro Italia el Tesoro Italia el Tesoro 144A(d) el Del Tesoro 144A(d) el Del Tesoro 144A(d) el Del Tesoro 144A(d)	EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR	1,750 % 1,375 %  1,750 % 1,375 % 0,625 % 0,950 % 6,000 % 0,950 % 2,950 % 2,800 %	30/07/2031 Perp. 24/02/2026 15/03/2023 01/105/2031 01/12/2031	112.490 111.900 471.643 116.703 110.886 282.633 486.815 184.471 79.782 112.438 39.618	0,08 0,08 0,08 0,08 0,00 0,02 0,38 0,14 0,06 0,08
Italia	00.000 Bank of Ireland Gr 00.000 Aeroporti di Roma 00.000 Enel SpA – Serie 6 00.000 Intesa Sanpaolo S 00.000 Buoni poliennali de 10.000 Buoni poliennali de 10.000 Italy Buoni Polienn 130.000 Italy Buoni Polienn 130.000 Italy Buoni Polienn 130.000 Bono del Estado d 100.000 Bono del Estado d 150.000 Bono del Estado d 150.000 Bono del Estado d 150.000 Bono del Estado d	SpA 8,5 a(c) pA el Tesoro Italia el Tesoro Italia el Tesoro 144A(d) el Del Tesoro 144A(d) el Del Tesoro 144A(d) el Del Tesoro 144A(d)	EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR	1,375 %  1,750 % 1,375 % 0,625 % 0,950 % 6,000 % 0,950 % 2,950 % 2,800 %	30/07/2031 Perp. 24/02/2026 15/03/2023 01/05/2031 01/12/2031 01/09/2038	111.900 471.643 116.703 110.886 282.633 486.815 184.471 79.782 112.438 39.618	0,08 0,38 0,08 0,08 0,2° 0,36 0,14 0,06 0,08
Italia  10  11  22  42  11  3  3  Japón  30.00  26.11  99  25.00	20.000 Aeroporti di Roma 20.000 Enel SpA – Serie 6 50.000 Intesa Sanpaolo S 20.000 Buoni poliennali de 10.000 Buoni poliennali de 70.000 Italy Buoni Polienn 30.000 Italy Buoni Polienn 30.000 Bono del Estado d 20.000 Bono del Estado d 20.000 Bono del Estado d 20.000 Bono del Estado d	SpA 6,5 a(c) pA el Tesoro Italia el Tesoro Italia ali Del Tesoro 144A(d) ali Del Tesoro 144A(d) ali Del Tesoro 144A(d) el Japón – Serie 14	EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR	1,750 % 1,375 % 0,625 % 0,950 % 6,000 % 0,950 % 2,950 % 2,800 %	30/07/2031 Perp. 24/02/2026 15/03/2023 01/05/2031 01/12/2031 01/09/2038	471.643 116.703 110.886 282.633 486.815 184.471 79.782 112.438 39.618	0,38 0,08 0,08 0,22 0,36 0,14 0,06 0,08
10 10 24 44 11 11 13 8 6 6 7 9 9 25.00	00.000 Enel SpA – Serie 6 50.000 Intesa Sanpaolo S 20.000 Buoni poliennali de 10.000 Buoni poliennali de 10.000 Italy Buoni Polienn 30.000 Italy Buoni Polienn 30.000 Italy Buoni Polienn 30.000 Bono del Estado d 50.000 Bono del Estado d 50.000 Bono del Estado d	6,5 a (c) pA el Tesoro Italia el Tesoro Italia el Tesoro Italia lali Del Tesoro 144A(d) lali Del Tesoro 144A(d) lali Del Tesoro 144A(d) el Japón – Serie 14	EUR EUR EUR EUR EUR EUR	1,375 % 0,625 % 0,950 % 6,000 % 0,950 % 2,950 % 2,800 %	Perp. 24/02/2026 15/03/2023 01/05/2031 01/12/2031 01/09/2038	116.703 110.886 282.633 486.815 184.471 79.782 112.438 39.618	0,00 0,00 0,2° 0,36 0,14 0,00 0,00
10 10 24 44 11 11 13 8 6 6 7 9 25.00	00.000 Enel SpA – Serie 6 50.000 Intesa Sanpaolo S 20.000 Buoni poliennali de 10.000 Buoni poliennali de 10.000 Italy Buoni Polienn 30.000 Italy Buoni Polienn 30.000 Italy Buoni Polienn 30.000 Bono del Estado d 50.000 Bono del Estado d 50.000 Bono del Estado d	6,5 a (c) pA el Tesoro Italia el Tesoro Italia el Tesoro Italia lali Del Tesoro 144A(d) lali Del Tesoro 144A(d) lali Del Tesoro 144A(d) el Japón – Serie 14	EUR EUR EUR EUR EUR EUR	1,375 % 0,625 % 0,950 % 6,000 % 0,950 % 2,950 % 2,800 %	Perp. 24/02/2026 15/03/2023 01/05/2031 01/12/2031 01/09/2038	110.886 282.633 486.815 184.471 79.782 112.438 39.618	0,08 0,2° 0,36 0,1° 0,06 0,08
10 25 42 11 5 8 6 30.00 26.11 95 25.00	00.000 Enel SpA – Serie 6 50.000 Intesa Sanpaolo S 20.000 Buoni poliennali de 10.000 Buoni poliennali de 10.000 Italy Buoni Polienn 30.000 Italy Buoni Polienn 30.000 Italy Buoni Polienn 30.000 Bono del Estado d 50.000 Bono del Estado d 50.000 Bono del Estado d	6,5 a (c) pA el Tesoro Italia el Tesoro Italia el Tesoro Italia lali Del Tesoro 144A(d) lali Del Tesoro 144A(d) lali Del Tesoro 144A(d) el Japón – Serie 14	EUR EUR EUR EUR EUR EUR	1,375 % 0,625 % 0,950 % 6,000 % 0,950 % 2,950 % 2,800 %	Perp. 24/02/2026 15/03/2023 01/05/2031 01/12/2031 01/09/2038	110.886 282.633 486.815 184.471 79.782 112.438 39.618	0,08 0,2° 0,36 0,1° 0,06 0,08
29 42 11 5 8 3 <b>Japón</b> 30.00 26.10 99 25.00	50.000 Intesa Sanpaolo S 20.000 Buoni poliennali de 10.000 Buoni poliennali de 70.000 Italy Buoni Polienn 30.000 Italy Buoni Polienn 30.000 Bono del Estado d 10.000 Bono del Estado d	pA el Tesoro Italia el Tesoro Italia el Tesoro Italia alii Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> iali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> iali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> el Japón – Serie 14	EUR EUR EUR EUR EUR EUR	0,625 % 0,950 % 6,000 % 0,950 % 2,950 % 2,800 %	24/02/2026 15/03/2023 01/05/2031 01/12/2031 01/09/2038	282.633 486.815 184.471 79.782 112.438 39.618	0,2° 0,36 0,11 0,06 0,08 0,03
42 11 5 8 3 30.00 26.10 99 25.00	20.000 Buoni poliennali de 10.000 Buoni poliennali de 70.000 Italy Buoni Polienn 30.000 Italy Buoni Polienn 30.000 Italy Buoni Polienn 00.000 Bono del Estado d 00.000 Bono del Estado d 50.000 Bono del Estado d	el Tesoro Italia el Tesoro Italia nali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> nali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> nali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> el Japón – Serie 14	EUR EUR EUR EUR EUR	0,950 % 6,000 % 0,950 % 2,950 % 2,800 %	15/03/2023 01/05/2031 01/12/2031 01/09/2038	486.815 184.471 79.782 112.438 39.618	0,36 0,14 0,06 0,08 0,03
11 8 6 3 <b>Japón</b> 30.00 26.10 99 25.00	10.000 Buoni poliennali de 70.000 Italy Buoni Polienn 30.000 Italy Buoni Polienn 30.000 Italy Buoni Polienn 10.000 Bono del Estado d 10.000 Bono del Estado d	el Tesoro Italia Iali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> e Japón – Serie 14	EUR EUR EUR EUR	6,000 % 0,950 % 2,950 % 2,800 %	01/05/2031 01/12/2031 01/09/2038	184.471 79.782 112.438 39.618	0,14 0,06 0,08 0,03
Japón 30.00 26.10 95	70.000 Italy Buoni Polienn 80.000 Italy Buoni Polienn 80.000 Italy Buoni Polienn 90.000 Bono del Estado d 90.000 Bono del Estado d 90.000 Bono del Estado d 90.000 Bono del Estado d 90.000 Bono del Estado d	ali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> Iali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> Iali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> Iali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> e Japón – Serie 14	EUR EUR EUR	0,950 % 2,950 % 2,800 %	01/12/2031 01/09/2038	112.438 39.618	0,06 0,08 0,03
Japón 30.00 26.10 99 25.00	30.000 Italy Buoni Polienn 30.000 Bono del Estado d 30.000 Bono del Estado d 30.000 Bono del Estado d 30.000 Bono del Estado d	alii Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> e Japón – Serie 14	EUR	2,800 %		39.618	0,03
Japón 30.00 26.10 99 25.00	30.000 Italy Buoni Polienn 30.000 Bono del Estado d 30.000 Bono del Estado d 30.000 Bono del Estado d 30.000 Bono del Estado d	alii Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup> e Japón – Serie 14	JPY	·	01/03/2067		
30.00 26.10 99 25.00	00.000 Bono del Estado d 50.000 Bono del Estado d	•		0.700.00		1.413.346	1,05
30.00 26.10 99 25.00	00.000 Bono del Estado d 50.000 Bono del Estado d	•		0.700.00			
26.10 98 25.00	00.000 Bono del Estado d 50.000 Bono del Estado d	•		0.700.00			
95 25.00	50.000 Bono del Estado d	e Japón – Serie 178	1017	0,700 %	20/03/2061	264.823	0,20
25.00			JPY	0,500 %	20/09/2041	233.913	0,17
	00 000 Bono del Estado d	•	JPY	2,200 %	20/03/2041	11.187	0,01
98.40		•	JPY	0,100 %	20/06/2031	223.386	0,16
	00.000 Bono del Estado d	•	JPY	0,005 %	01/11/2023	876.188	0,65
	50.000 Bono del Estado d	•	JPY	0,700 %	20/09/2051	159.028	0,12
8.90	00.000 Bono del Estado d	e Japón a veinte años – Serie 177	JPY	0,400 %	20/06/2041	78.450	0,06
						1.846.975	1,37
Jersey 20	00.000 Galaxy Pipeline As	ssets Bidco Ltd.	USD	2,940 %	30/09/2040	198.250	0,15
	25.000 Heathrow Funding		GBP	2,750 %	13/10/2029	312.432	0,23
						510.682	0,38
Luxemburg	go						
10	00.000 Aroundtown S.A.		GBP	3,000 %	16/10/2029	140.963	0,1
15	50.000 Blackstone Proper	ty Partners Europe Holdings SARL	EUR	1,000 %	04/05/2028	166.957	0,12
10	00.000 Blackstone Proper	ty Partners Europe Holdings SARL	GBP	2,625 %	20/10/2028	136.071	0,10
10	00.000 Blackstone Proper	ty Partners Europe Holdings SARL	EUR	1,625 %	20/04/2030	114.233	0,09
12	25.000 Helvetia Europe S.	.A.(c)	EUR	2,750 %	30/09/2041	154.009	0,1
						712.233	0,53
Países Baj							
	25.000 Airbus S.E.	d T D)/	EUR	2,375 %	09/06/2040	160.999 114.616	0,12
	00.000 Heimstaden Bosta		EUR	1,625 %	13/10/2031		0,08
	00.000 Iberdrola Internatio		EUR	1,450 %	Perp.	113.578	0,08
	00.000 Iberdrola Internation 00.000 ING Groep NV <sup>(c)</sup>	onal BV – Selle NCo.	EUR GBP	2,250 % 1,125 %	Perp. 07/12/2028	115.633 129.317	0,09 0,10
	00.000 Lukoil Securities B	W	USD	3,875 %	06/05/2030	205.150	0,15
	00.000 Prosus NV	•	USD	4,027 %	03/08/2050	187.000	0,14
	00.000 Prosus NV 00.000 Stedin Holding NV	(c)	EUR	4,027 % 1,500 %	03/06/2050 Perp.	114.258	0,08
	00.000 Steam Holding NV		EUR	1,125 %	28/05/2028	115.157	0,00
	00.000 Telefonica Europe		EUR	2,376 %	26/05/2026 Perp.	107.912	0,0
	00.000 Wintershall Dea Fi		EUR	0,840 %	25/09/2025	115.740	0,09
	75.000 WPC Eurobond B\		EUR	1,350 %	15/04/2028	203.222	0,15
						1.682.582	1,25
Polonia							
	00.000 mBank S.A. <sup>(c)</sup>		EUR	0,966 %	21/09/2027	112.505	0,08
España							·
	00.000 Banco Santander S	S.A.	EUR	1,625 %	22/10/2030	114.543	0,09
	00.000 Bankinter S.A.		EUR	0,625 %	06/10/2027	113.356	0,08
	00.000 CaixaBank S.A.(c)		EUR	0,375 %	18/11/2026	113.121	0,08
	00.000 CaixaBank S.A.(c)		EUR	5,875 %	Perp.	254.992	0,19
	00.000 Cellnex Finance C	o., S.A.	EUR	1,500 %	08/06/2028	224.014	0,17
12	25.000 FCC Aqualia S.A.		EUR	2,629 %	08/06/2027	157.006	0,12

					Valor de mercedo	
		<b>.</b>	(a)	(h)	Valor de mercado en	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	USD	% del patrimonio
Bonos – (conti España – (conti	•					
	FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU	EUR	1,661 %	04/12/2026	120.400	0,09
	) Iberdrola Finanzas S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	1,575 %	Perp.	113.358	0,09
40.000	) Bonos del Estado de España 144A <sup>(d)</sup>	EUR	5,900 %	30/07/2026	58.827	0,04
90.000	) Bonos del Estado de España 144A <sup>(d)</sup>	EUR	1,500 %	30/04/2027	111.960	0,08
	Bonos del Estado de España 144A <sup>(d)</sup>	EUR	1,250 %	31/10/2030	359.299	0,27
	) Bonos del Estado de España 144A <sup>(d)</sup>	EUR	3,450 %	30/07/2066	72.691	0,05
150.000	Telefonica Emisiones S.A.	USD	4,103 %	08/03/2027	166.049	0,12
					1.979.616	1,47
Supranacionales 200,000	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp.					
200.000	Via Atlas Luxco 4 SARL	USD	4,625 %	01/06/2028	194.500	0,14
30.000	) Unión Europea	EUR	(0,449 %)	06/07/2026	34.882	0,03
	Unión Europea	EUR	(0,263 %)	04/10/2028	11.599	0,01
	Unión Europea	EUR	(0,074 %)	22/04/2031	34.397	0,02
20.000	Unión Europea	EUR	0,400 %	04/02/2037	23.501	0,02
					298.879	0,22
Suecia						
	Heimstaden Bostad AB <sup>(c)</sup>	EUR	3,625 %	Perp.	112.710	0,08
100.000	Heimstaden Bostad AB <sup>(c)</sup>	EUR	3,000 %	Perp.	108.073	0,08
					220.783	0,16
Suiza	0.07(1)	1100	0.000.0/	10/04/0000	000 000	
	Crédit Suisse Group AG <sup>(c)</sup>	USD	3,869 %	12/01/2029	268.660	0,20
250.000	UBS Group AG <sup>(c)</sup>	USD	1,364 %	30/01/2027	245.513	0,18
					514.173	0,38
Turquía	. T. I	1100	0.500.0/	00/04/0000	404.500	0.45
	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO	USD	6,500 %	08/01/2026	194.500	0,15
Reino Unido	Applicates Funding Dis	ODD	0.404.0/	40/07/0000	440.704	0.44
	Annington Funding Plc.	GBP	3,184 %	12/07/2029	143.701	0,11
	) Barclays Plc. (c)	GBP	3,750 %	22/11/2030	246.898	0,18
	) Barclays Plc. <sup>(c)</sup> ) eG Global Finance Plc.	EUR EUR	1,106 % 4,375 %	12/05/2032 07/02/2025	113.526 112.092	0,08 0,08
	HSBC Holdings Plc. (c)	USD	4,583 %	19/06/2029	252.785	0,00
	) Legal & General Group Plc. <sup>(c)</sup>	GBP	3,750 %	26/11/2049	140.313	0,10
	M&G Plc. <sup>(c)</sup>	GBP	3,875 %	20/07/2049	174.203	0,13
	National Express Group Plc.(c)	GBP	4,250 %	Perp.	136.040	0,10
	Nationwide Building Society <sup>(c)</sup>	USD	4,302 %	08/03/2029	250.823	0,19
	NatWest Group Pic.(c)	EUR	0,780 %	26/02/2030	168.281	0,13
	NatWest Group Plc. <sup>(c)</sup>	GBP	2,105 %	28/11/2031	164.220	0,12
	NatWest Group Plc.(c)	EUR	1,043 %	14/09/2032	111.575	0,08
	Pension Insurance Corp., Plc.	GBP	4,625 %	07/05/2031	296.559	0,22
	Santander UK Group Holdings Plc. (c)	USD	1,532 %	21/08/2026	198.058	0,15
	Standard Chartered Plc.(c)	EUR	1,200 %	23/09/2031	112.851	0,08
100.000	Tritax EuroBox Plc.	EUR	0,950 %	02/06/2026	114.537	0,09
230.000	) Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	0,625 %	31/07/2035	294.293	0,22
50.000	Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	1,500 %	31/07/2053	79.325	0,06
170.000	Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	1,625 %	22/10/2054	278.466	0,21
200.000	Virgin Money UK Plc. (c)	GBP	9,250 %	Perp.	296.453	0,22
100.000	Vodafone Group Plc.	USD	5,000 %	30/05/2038	125.194	0,09
					3.810.193	2,83
Estados Unidos						
	) AdaptHealth LLC	USD	6,125 %	01/08/2028	127.500	0,09
	Air Lease Corp.	USD	2,875 %	15/01/2026	51.508	0,04
	Air Lease Corp.	USD	3,750 %	01/06/2026	159.802	0,12
	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp.	USD	6,625 %	15/07/2026	83.633	0,06
	Allison Transmission, Inc.	USD	3,750 %	30/01/2031	52.938	0,04
	American Tower Corp.	USD	4,000 %	01/06/2025	26.939	0,02
	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	USD	5,450 %	23/01/2039	163.642	0,12
	Aramark Services, Inc.	USD	6,375 %	01/05/2025	125.700	0,09
	AT&T, Inc.	USD	4,100 %	15/02/2028	335.046	0,25
	AT&T, Inc.	USD	2,250 %	01/02/2032	217.156	0,16
	AT&T, Inc.	USD	5,450 %	01/03/2047	66.327	0,05
	AutoNation Inc.	USD	3,650 %	01/06/2051	26.052	0,02
	AutoNation, Inc.  Recton Dickinson and Co	USD	4,750 % 3 700 %	01/06/2030	87.121 81.545	0,06
/5.000	Becton Dickinson and Co.	USD	3,700 %	06/06/2027	81.545	0,06

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

					Valor de mercado	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en USD	% del patrimonio
Bonos – (contir	•					70 doi patimonio
•	s – (continuación)					
	Broadcom, Inc.	USD	3,137 %	15/11/2035	148.560	0,11
	Broadcom, Inc.	USD	3,187 %	15/11/2036	222.871	0,17
	Buckeye Partners LP	USD	4,500 %	01/03/2028	122.656	0,09
	Carrier Global Corp.	USD	2,493 %	15/02/2027	102.678	0,08
	Catalent Pharma Solutions, Inc. (c)	USD	1,632 %	18/03/2034	28.725	0,02
	Centene Corp. Cheniere Corpus Christi Holdings LLC	USD USD	2,500 % 3,700 %	01/03/2031 15/11/2029	105.473 80.381	0,08 0,06
	Cheniere Energy Partners LP	USD	3,250 %	31/01/2032	28.988	0,00
	CIT Group, Inc.	USD	4.750 %	16/02/2024	58.163	0,04
	Citigroup, Inc. (c)	USD	3,668 %	24/07/2028	108.045	0,08
175.000	Citigroup, Inc. (c)	USD	4,412 %	31/03/2031	200.079	0,15
100.000	Citrix Systems, Inc.	USD	3,300 %	01/03/2030	101.535	0,07
120.000	CommScope, Inc.	USD	7,125 %	01/07/2028	112.200	0,08
	DaVita, Inc.	USD	3,750 %	15/02/2031	116.562	0,09
	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	6,020 %	15/06/2026	234.214	0,17
	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	5,300 %	01/10/2029	119.191	0,09
	EQT Corp.	USD	6,625 %	01/02/2025	100.125	0,07
	EQT Corp. FirstEnergy Corp.	USD USD	3,625 % 2,650 %	15/05/2031 01/03/2030	137.869 68.942	0,10 0,05
	Freedom Mortgage Corp.	USD	7,625 %	01/05/2026	173.700	0,03
	Global Partners LP Via GLP Finance Corp.	USD	6,875 %	15/01/2029	102.500	0,08
	Go Daddy Operating Co., LLC Via GD Finance Co., Inc.	USD	5,250 %	01/12/2027	124.500	0,09
	H&E Equipment Services, Inc.	USD	3,875 %	15/12/2028	151.319	0,11
100.000	Halliburton Co.	USD	2,920 %	01/03/2030	102.681	0,08
30.000	HB Fuller Co.	USD	4,250 %	15/10/2028	30.713	0,02
75.000	Hewlett Packard Enterprise Co.	USD	6,350 %	15/10/2045	101.553	0,08
	Hillenbrand, Inc.	USD	5,750 %	15/06/2025	125.700	0,09
	HUB International Ltd.	USD	7,000 %	01/05/2026	102.625	0,08
	iHeartCommunications, Inc.	USD	4,750 %	15/01/2028	89.775	0,07
	Ingevity Corp.	USD	3,875 %	01/11/2028	38.400	0,03
	International Flavors & Fragrances, Inc. Kinder Morgan, Inc.	USD USD	1,832 % 2,000 %	15/10/2027 15/02/2031	172.846 70.750	0,13 0,05
	Kraft Heinz Foods Co.	USD	5,000 %	15/07/2035	204.720	0,05
	Kraft Heinz Foods Co.	USD	4,375 %	01/06/2046	103.760	0,08
	LD Holdings Group LLC	USD	6,500 %	01/11/2025	53.350	0,04
	LPL Holdings, Inc.	USD	4,625 %	15/11/2027	61.950	0,05
	Lumen Technologies, Inc. – Serie U	USD	7,650 %	15/03/2042	173.200	0,13
125.000	Marathon Petroleum Corp.	USD	3,800 %	01/04/2028	135.369	0,10
	Marriott International, Inc. – Serie EE	USD	5,750 %	01/05/2025	9.052	0,01
	Micron Technology, Inc.	USD	3,366 %	01/11/2041	25.320	0,02
	MidAmerican Energy Co.	USD	3,100 %	01/05/2027	241.402	0,18
	ModivCare, Inc.	USD USD	5,875 %	15/11/2025 29/11/2061	20.800	0,02
	Moody's Corp.  Morgan Stanley <sup>(c)</sup>	USD	3,100 % 2,484 %	16/09/2036	80.783 144.715	0,06 0,11
	MPH Acquisition Holdings LLC	USD	5,750 %	01/11/2028	93.838	0,07
	MPLX LP	USD	2,650 %	15/08/2030	198.290	0,15
	NiSource, Inc.	USD	1,700 %	15/02/2031	94.199	0,07
	Occidental Petroleum Corp.	USD	6,625 %	01/09/2030	48.500	0,04
100.000	Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp.	USD	6,250 %	15/06/2025	104.062	0,08
85.000	Ovintiv Exploration, Inc.	USD	5,625 %	01/07/2024	93.131	0,07
	Prestige Brands, Inc.	USD	3,750 %	01/04/2031	66.981	0,05
	Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp.	USD	4,875 %	01/06/2023	133.900	0,10
	Sabine Pass Liquefaction LLC	USD	4,500 %	15/05/2030	85.046	0,06
	Sabre GLBL, Inc.	USD	9,250 %	15/04/2025	128.944	0,10
	Scripps Escrow II, Inc. Sensata Technologies, Inc.	USD USD	5,375 % 3,750 %	15/01/2031	5.038 162.937	0,00 0,12
	Six Flags Entertainment Corp.	USD	5,500 %	15/02/2031 15/04/2027	137.531	0,12
	Skyworks Solutions, Inc.	USD	3,000 %	01/06/2031	25.501	0,02
	Southwestern Energy Co.	USD	5,375 %	01/02/2029	73.325	0,05
	Spectrum Brands, Inc.	USD	3,875 %	15/03/2031	121.250	0,09
70.000	Sprint Capital Corp.	USD	8,750 %	15/03/2032	103.863	0,08
130.000	TEGNA, Inc.	USD	4,625 %	15/03/2028	130.000	0,10
175.000	T-Mobile USA, Inc.	USD	3,875 %	15/04/2030	190.512	0,14
	T-Mobile USA, Inc.	USD	2,875 %	15/02/2031	77.880	0,06
	T-Mobile USA, Inc.	USD	3,000 %	15/02/2041	71.947	0,05
	TransDigm, Inc.	USD	5,500 %	15/11/2027	226.687	0,17
	Travel & Leisure Co.	USD	6,625 %	31/07/2026	125.135	0,09
	Tri Pointe Homes, Inc.	USD USD	5,700 % 0,750 %	15/06/2028	124.056	0,09 2,38
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU. Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	4,250 %	31/01/2028 15/05/2039	3.210.054 1.138.711	2,36 0,84
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	3,375 %	15/11/2048	2.030.387	1,51
	· g. · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	505	0,0.070		000.007	.,51

					V	alor de mercado	
Bones	Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	en USD	% del patrimonio
		•					
### SECONO V Wilners Cine.  ##	•						
T5,000 Williams Coes, Inc.	100.00	00 Verizon Communications, Inc.		4,125 %	16/03/2027	111.625	0,08
TOTAL DE BONOS (costs USD 38.568.580)		•					0,02
TOTAL DE BONDS (cotes USD 38.868.99)         38.987.836           Cotes USD 38.868.99)         Valor de mercado (usb)           Tenencia         Descripción del valor           Caciones ordinaries – 42.65 %         Aspentina           Bédical (usb)         17.332           Bédical (usb)         17.332           Bédical (usb)         17.332           Bermudas (usb)         28.877           2.800         Bank of Nova Scotia (usb)         17.006           1.400         Canadan Western Bank (usb)         14.100           5.511         Arch Capital Group Ltd.         21.038           5.200         Bank of Nova Scotia (usb)         14.100           1.400         Canadian Western Bank (usb)         14.100           5.100         Usb Assertion (usb)         14.100           5.100         Wirin Ltd.         21.038.00           5.200         Bank of Nova Scotia (usb)         14.100           5.100         Wirin Ltd.         21.038.00           6.100         Marian Ltd.         21.038.00           7.200         18.200         21.038.00           8.100         18.200         21.038.00           8.100         18.200         21.038.00           8.100 <th< td=""><td>75.00</td><td>00 Williams Cos., Inc.</td><td>USD</td><td>2,600 %</td><td>15/03/2031</td><td>74.541</td><td>0,05</td></th<>	75.00	00 Williams Cos., Inc.	USD	2,600 %	15/03/2031	74.541	0,05
Contention Is a position and in valor         Significant and a position and in valor         Valor dame and a position and in valor         Valor dame and a position and in valor and a position and in valor and and a position and in valor and and a position and a position and a position and and a position and and a position and and a position and and a position and and a position and a position and a position and and a position and and a position and and a position and a positi						15.655.889	11,62
Terenecias         Descripción del valor         Valor de mercado usos           Acciones ordinarias – 42,55 % Argentína         Argentína         7.732           Bégica         14 Mercadollore, Inc.         17.332           Bermudas         228,877         2.88,877           Canadá         172,006         1.700           L 1,000         1,000         1,000         1,000           1,000         1,000         1,000         1,000         1,000           1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000         1,000						35.967.836	26,70
Tenencias         Descripción del valor         en BB           Acciones ordinarias – 4,25 % Agrentina         Acciones ordinarias – 4,25 % Agrentina         T. 332           Acciones ordinarias – 4,25 % Agrentina         1 % Recadol. bre. Inc.         17.332           Bélgica 397 Van de Velde NV         14.385         28.8877           5 581 Arch Capital Group Ltd.         228.877         28.8877           Canadá         178.008         1 78.008         1 78.008           1 400 Canadán Visician Linc.         2 10.318         3.00         1 60.001         1 81.001         3.00         1 82.003         1 81.001         3.00         1 82.003         1 81.001         3.00         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003         1 82.003	(4444)				Va		
Agent   Agen	Tenencias	Descripción del valor				en	% de patrimonio
14 MercadoLibre, In.	Acciones ord	inarias – 42,55 %					
Belgica         14.365           Bermudas         22.877           Canadá         178.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008         18.008 <th< td=""><td>_</td><td>Margadel ibra Inc</td><td></td><td></td><td></td><td>17 222</td><td>0.01</td></th<>	_	Margadel ibra Inc				17 222	0.01
Samualan		MercadoLibre, Inc.				17.332	0,01
5.81 Arch Capital Group Lett         28.87           Canada         178.006           2.800 Bank of Nova Scotia         41.190           5.100 Gilden Activereur Inc.         20.98           3.200 Magna International, Inc.         246.939           3.100 Nutrien Lett.         246.939           3.100 Nutrien Lett.         765.227           Dinamarca           23 A P Molier - Maersk A/S 'A'         66.614           44 AP Molier - Maersk A/S 'B'         135.044           2.133 Nov Nordisk A/B' 'B'         27.830           8 Finlandla         8           8 Finlandla         27.830           8 Finlandla         310.921           4.175 Nordea Bank Abp         27.830           5 Finlandla         8           87 Compagnie de Saint-Gobain         62.23           5 44 Electricite de France S.A         7.747           244 Eging S.A         35.516           1.206 IP-SOS         57.621           3 20 Kerling S.A         247.778           3 21 Kerling S.A         247.778           3 42 Legrand S.A         17.083           3 13 Portion Stelemi Biotech         25.369           3 14 Legrand S.A         27.701           3 17 Portion Reversión Mot	-	Van de Velde NV				14.365	0,01
Canadá         178,006           2,800         Bank of Nova Scotia         178,006           1,100         Canadiani Western Bank         41,190           5,100         Gildan Activewear, Inc.         210,318           3,200         Magna International, Inc.         88,774           1,100         Nutrien Ltd.         88,774           Dinamarca         23         AP Moller - Maersk A'S 'A'         66,814           4,4         AP Moller - Maersk A'S 'B'         135,044           2,133         Novo Nordisk A'S 'B'         22,2132           2,133         Novo Nordisk A'S 'B'         27,630           6,668         Neste O'J' B'         27,630           6,668         Neste O'J'         310,921           4,175         Nordea Bank Abp         49,726           54         Electricite de France S.A.         2,747           2,445         Elegis S.A.         35,516           34         Electricite de France S.A.         24,778           244         Elegis S.A.         24,778           347         Legrand S.A.         24,778           347         Elegrand S.A.         27,777           348         Elegrand S.A.         27,777           370<	Bermudas						
178.006		Arch Capital Group Ltd.				228.877	0,17
1400   Canadian Western Bank		Dark of Nava Ocean				470.000	
Silden Activewear, Inc.   210.318   246.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339   326.339							0,13 0,03
3.00 Magna International, Inc.       246,339 (8,74 (8,74 (1))         1,300 Nutrien Ltd.       88,774 (7)         Primamare         23 AP Moller - Maersk AVS 'B' (3,04 (4))       66,614 (3),044 (4)         24,133 Novo Nordisk AVS 'B' (2,23,132 (2))       222,132 (2)         Finaladla (8,68 kot OV)' B' (8,68 to OV)' B' (27,630 (3,68 kote OV)' B' (3,09 to 1)         6,68 Neste OV)       49,726 (3,68 kote OV)' B' (3,09 to 1)         6,68 Neste OV B' (4,175 (4))       49,726 (3,09 to 1)         6,74 Electricite de France SA.       7,747 (3,09 to 1)         7,84 Electricite de France SA.       7,747 (3,09 to 1)         2,44 Electricite de France SA.       7,747 (3,09 to 1)         3,20 Kering SA.       9,005 (3,09 to 1)         1,26 IP SOS       5,621 (3,09 to 1)         3,20 Kering SA.       9,005 (3,09 to 1)         4,12 Eugrand SA.       9,005 (3,09 to 1)         3,13 Beval SA.       20,770 (3,09 to 1)         3,119 Reval SA.       20,770 (3,09 to 1)         3,119 Reval SA.       20,770 (3,09 to 1)         3,119 Everla SE.       1,476,101 (4)         4 Everla Market Flectric S.E.       1,476,101 (4)         4 Everla Market Flectric S.E.       1,476,101 (4)         4 Everla Market Flectric S.E.       1,476,101 (4)							0,03
1,300   Nutrien Ltd.   765,227							0,18
Processing   Pr							0,07
23 AP Moller - Maersk AIS 'Ar'       66.614         44 AP Moller - Maersk AIS 'Br'       135.044         2.133 Novo Nordisk AIS 'Br'       433.790         Finlandia         876 Kesko CYJ 'Br'       27.630         6.466 Neste OYJ       49.726         4.175 Nordea Bank Abp       49.726         Francia         Francia         971 Compagnie de Saint-Gobain       62.623         544 Electricite de France S.A.       7.747         2.445 Engle S.A.       35.516         1.266 IPSOS       57.621         320 Kering S.A.       247.778         847 Legrand S.A.       94.005         742 Pernod Ricard S.A.       170.883         3.168 Publicis Groupe S.A.       207.703         3.119 Reval S.A.       57.777         370 Sartorius Stedim Biotech       225.490         1.739 Schneider Electric S.E.       309.958         1.476.101       1476.101         Aleman       49.406         678 Covestro AG 144A(4)       38.946         4.507 Deutsche Post AG       272.056         20210 E. LON S.E.       252.036         2.619 Infineon Technologies AG       121.213         1.282 Merck KGgaA       320.399 <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td>_</td> <td></td> <td>0,57</td>					_		0,57
135 144	Dinamarca						·
23.13   Novo Nordisk A/S "B"   23.132   433.790   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.132   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.133   23.13	23	AP Moller - Maersk A/S "A"				66.614	0,05
Name	44	AP Moller - Maersk A/S "B"				135.044	0,10
Finandia	2.133	Novo Nordisk A/S "B"			_	232.132	0,17
876       Kesko OYJ 'B'       27.830         6.466       Neste OYJ       310.921         4.175       Nordea Bank Abp       310.921         Francia         Francia       62.623         544       Electricite de France S.A.       7.747         2.445       Engle S.A.       35.516         1.266       IPSOS       57.621         320       Kering S.A.       24.7778         847       Legrand S.A.       170.883         3.189       Publicis Groupe S.A.       207.703         3.189       Reskl S.A.       207.703         3.119       Reskl S.A.       207.703         3.179       Sattorius Stedim Biotech       225.490         1.739       Schneider Electric S.E.       308.958         Alemania         Alemania       253.885         1.060       Bayerische Motoren Werke AG—Preferente       83.946         1.722       Brenntag S.E.       419.540         678       Covestro AG 144A(4)       38.504         4.507       Deutsche Post AG       272.056         2.619       Infineon Technologies AG       121.213         2.109       Infineon Technologies AG <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td>433.790</td> <td>0,32</td>						433.790	0,32
1.646   Neste OVJ							
4.175         Nordea Bank Abp         49.726           Remarkable           Francia         82.823           971         Compagnie de Saint-Gobain         62.623           544         Electricile de France S.A.         7.747           2.445         Engle S.A.         35.516           1.266         IPSOS         57.621           320         Kering S.A.         247.778           487         Legrand S.A.         94.005           742         Pernod Ricard S.A.         94.005           3.168         Publicis Groupe S.A.         207.703           3.119         Rexis S.A.         57.777           370         Sartorius Stedim Biotech         225.490           1.739         Schneider Electric S.E.         308.958           Alemania							0,02
Francia         971 Compagnie de Saint-Gobain         62.623           544 Electricite de France S.A.         7.747           2.445 Engie S.A.         35.516           1.266 IPSOS         57.621           320 Kering S.A.         247.778           847 Legrand S.A.         94.005           742 Pernod Ricard S.A.         170.883           3.168 Publicis Groupe S.A.         207.703           3.119 Rexel S.A.         57.777           370 Sartorius Stedim Biotech         225.490           1.739 Schneider Electric S.E.         38.958           Alemania           3.853 BASF S.E.         253.885           1.060 Bayerische Motoren Werke AG—Preferente         83.946           1.722 Brenntag S.E.         49.504           678 Covestro AG 144A <sup>(d)</sup> 38.504           4.507 Deutsche Post AG         272.066           2.0210 E.ON S.E.         252.036           2.011 Infineon Technologies AG         121.213           1.282 Merck KGaA         323.399           3.087 METRO AG         35.041           Houghtoner Rueckversicherungs-Gesellschaft AG         5.161           Houghtoner Rueckversicherungs-Gesellschaft AG         1.534.781							0,23
Francia         62.623           971         Compagnie de Saint-Gobain         62.623           544         Electricite de France S.A.         7.747           2.445         Engle S.A.         35.516           1.266         IPSOS         57.621           320         Kering S.A.         247.778           847         Legrand S.A.         170.883           3.168         Publicis Groupe S.A.         207.703           3.119         Rexel S.A.         57.777           370         Sartorius Stedim Biotech         225.490           1.739         Schneider Electric S.E.         308.958           Alemania           3.853         BASF S.E.         253.885           1.060         Bayerische Motoren Werke AG—Preferente         83.946           1.722         Brenntag S.E.         149.540           678         Covestro AG 144A/d)         38.504           4.507         Deutsche Post AG         272.056           20.210         E.ON S.E.         252.036           2.619         Infineon Technologies AG         121.213           1.282         Merck KGaA         33.399           1.94         Merck KGaA         35.041 <td>4.175</td> <td>Nordea вапк Abp</td> <td></td> <td></td> <td>_</td> <td></td> <td>0,04</td>	4.175	Nordea вапк Abp			_		0,04
971       Compagnie de Saint-Gobain       62.623         544       Eletricite de France S.A.       7.747         2.445       Engle S.A.       35.516         1.266       IPSOS       57.621         320       Kering S.A.       247.778         847       Legrand S.A.       94.005         742       Pemod Ricard S.A.       170.883         3.189       Publicis Groupe S.A.       207.703         3.191       Rexel S.A.       57.777         370       Satorius Stedim Biotech       225.490         1.739       Schneider Electric S.E.       308.958         Alemania         Alemania         3.853       BASF S.E.       253.885         1.060       Bayerische Motoren Werke AG—Preferente       83.946         1.722       Brennlag S.E.       149.540         678       Covestro AG 144.410       38.504         4.507       Deutsche Post AG       272.056         20.210       E.ON S.E.       252.036         2.619       Infineon Technologies AG       121.213         1.282       Merck KGaA       30.941         19       Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG       5.161						388.277	0,29
544       Electricite de France S.A.       7.747         2.445       Engle S.A.       35.516         1.266       IPSOS       57.621         320       Kering S.A.       247.778         847       Legrand S.A.       94.005         742       Pernod Ricard S.A.       170.883         3.168       Publicis Groupe S.A.       207.703         3.119       Rexel S.A.       57.777         370       Sartorius Stedim Biotech       225.490         1.739       Schneider Electric S.E.       1.476.101         Alemania         3.853       BASF S.E.       253.885         1.060       Bayerische Motoren Werke AG—Preferente       83.946         1.722       Brenntag S.E.       149.540         678       Covestro AG 144A/d)       38.504         4.507       Deutsche Post AG       272.056         20210       E.ON S.E.       252.036         2.619       Infineon Technologies AG       121.213         3.087       METRO AG       35.041         4.99       Muerck KGBA       35.041         4.90       Muerck KGBA       35.041         4.90       Muerck Kersicherungs-Gesellschaft AG       5.161		Compagnie de Saint-Gobain				62 623	0,05
2.445       Engie S.A.       35.516         1.266       IPSOS       57.621         320       Kering S.A.       247.778         847       Legrand S.A.       34.005         742       Pernod Ricard S.A.       170.883         3.168       Publicis Groupe S.A.       207.703         3.119       Rexel S.A.       57.777         370       Sartorius Stedim Biotech       225.490         1.739       Schneider Electric S.E.       308.958         Alemania         Alemania       253.885         1.060       Bayerische Motoren Werke AG—Preferente       83.946         1.722       Brenntag S.E.       149.540         4.507       Deutsche Post AG       272.056         20.210       E.ON S.E.       252.036         2.619       Infineon Technologies AG       121.213         1.282       Merck KGaA       33.041         1.9       Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG       5.161         Hong Kong							0,01
1.266       IPSOS       57.621         320       Kering S.A.       247.778         847       Legrand S.A.       94.005         742       Permod Ricard S.A.       170.883         3.168       Publicis Groupe S.A.       207.703         3.119       Rexel S.A.       57.777         370       Sartorius Stedim Biotech       225.490         1.739       Schneider Electric S.E.       308.958         Alemania         3.853       BASF S.E.       253.885         1.060       Bayerische Motoren Werke AG—Preferente       83.946         1.722       Brenntag S.E.       149.540         678       Covestro AG 144A <sup>(d)</sup> 38.504         4.507       Deutsche Post AG       272.056         20.210       E.ON S.E.       252.036         2.619       Infineon Technologies AG       121.213         1.282       Merck KGaA       35.041         1.9       Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG       5.161         Hong Kong							0,03
320       Kering S.A.       247.778         847       Legrand S.A.       94.005         742       Pernod Ricard S.A.       170.883         3.168       Publicis Groupe S.A.       207.703         3.119       Rexel S.A.       57.777         370       Sartorius Stedim Biotech       225.490         1.739       Schneider Electric S.E.       308.958         Alemania         3.853       BASF S.E.       253.885         1.060       Bayerische Motoren Werke AG—Preferente       83.946         1.722       Brenntag S.E.       149.540         678       Covestro AG 144A <sup>(d)</sup> 38.504         4.507       Deutsche Post AG       272.056         20.210       E.ON S.E.       252.036         2.619       Infineon Technologies AG       121.213         1.282       Merck KGaA       323.399         3.087       METRO AG       35.041         19       Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG       5.161         Hong Kong							0,04
847       Legrand S.A.       94.005         742       Pernod Ricard S.A.       170.883         3.168       Publicis Groupe S.A.       207.703         3.119       Rexel S.A.       57.777         370       Sartorius Stedim Biotech       225.490         1.739       Schneider Electric S.E.       308.958         Alemania         3.853       BASF S.E.       253.885         1.060       Bayerische Motoren Werke AG—Preferente       83.946         1.722       Brenntag S.E.       149.540         678       Covestro AG 144A(d)       38.504         4.507       Deutsche Post AG       272.056         20.210       E.ON S.E.       252.036         2.619       Infineon Technologies AG       121.213         1.282       Merck KGaA       323.399         3.087       METRO AG       35.041         19       Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG       5.161         Hong Kong							0,18
3.168 Publicis Groupe S.A.       207.703         3.119 Rexel S.A.       57.777         370 Sartorius Stedim Biotech       225.490         1.739 Schneider Electric S.E.       308.958         Alemania         3.853 BASF S.E.       253.885         1.060 Bayerische Motoren Werke AG—Preferente       83.946         1.722 Brenntag S.E.       149.540         678 Covestro AG 144A(d)       38.504         4.507 Deutsche Post AG       272.056         20.210 E.ON S.E.       252.036         2.619 Infineon Technologies AG       121.213         1.282 Merck KGaA       323.399         3.087 METRO AG       35.041         19 Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG       5.161         Hong Kong						94.005	0,07
3.119 Rexel S.A.       57.777         370 Sartorius Stedim Biotech       225.490         1.739 Schneider Electric S.E.       308.958         Alemania         3.853 BASF S.E.       253.885         1.060 Bayerische Motoren Werke AG—Preferente       83.946         1.722 Brenntag S.E.       149.540         678 Covestro AG 144A <sup>(d)</sup> 38.504         4.507 Deutsche Post AG       272.056         20.210 E.ON S.E.       252.036         2.619 Infineon Technologies AG       121.213         1.282 Merck KGaA       323.399         3.087 METRO AG       35.041         19 Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG       5.161         Hong Kong	742	Pernod Ricard S.A.				170.883	0,13
370       Sartorius Stedim Biotech       225.490         1.739       Schneider Electric S.E.       308.958         1.476.101         Alemania         3.853       BASF S.E.       253.885         1.060       Bayerische Motoren Werke AG—Preferente       83.946         1.722       Brenntag S.E.       149.540         678       Covestro AG 144A <sup>(d)</sup> 38.504         4.507       Deutsche Post AG       272.056         20.210       E.ON S.E.       252.036         2.619       Infineon Technologies AG       121.213         1.282       Merck KGaA       323.399         3.087       METRO AG       35.041         19       Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG       5.161         Hong Kong	3.168	Publicis Groupe S.A.				207.703	0,15
1.739 Schneider Electric S.E.       308.958         Alemania         3.853 BASF S.E.       253.885         1.060 Bayerische Motoren Werke AG—Preferente       83.946         1.722 Brenntag S.E.       149.540         678 Covestro AG 144A( <sup>d)</sup> 38.504         4.507 Deutsche Post AG       272.056         20.210 E.ON S.E.       252.036         2.619 Infineon Technologies AG       121.213         1.282 Merck KGaA       323.399         3.087 METRO AG       35.041         19 Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG       5.161         Hong Kong	3.119	Rexel S.A.				57.777	0,04
Alemania							0,17
Alemania         3.853       BASF S.E.       253.885         1.060       Bayerische Motoren Werke AG—Preferente       83.946         1.722       Brenntag S.E.       149.540         678       Covestro AG 144A(d)       38.504         4.507       Deutsche Post AG       272.056         20.210       E.ON S.E.       252.036         2.619       Infineon Technologies AG       121.213         1.282       Merck KGaA       323.399         3.087       METRO AG       35.041         19       Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG       5.161     Hong Kong	1.739	Schneider Electric S.E.			_	308.958	0,23
3.853       BASF S.E.       253.885         1.060       Bayerische Motoren Werke AG—Preferente       83.946         1.722       Brenntag S.E.       149.540         678       Covestro AG 144A <sup>(d)</sup> 38.504         4.507       Deutsche Post AG       272.056         20.210       E.ON S.E.       252.036         2.619       Infineon Technologies AG       121.213         1.282       Merck KGaA       323.399         3.087       METRO AG       35.041         19       Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG       5.161    Hong Kong						1.476.101	1,10
1.060       Bayerische Motoren Werke AG—Preferente       83.946         1.722       Brenntag S.E.       149.540         678       Covestro AG 144A <sup>(d)</sup> 38.504         4.507       Deutsche Post AG       272.056         20.210       E.ON S.E.       252.036         2.619       Infineon Technologies AG       121.213         1.282       Merck KGaA       323.399         3.087       METRO AG       35.041         19       Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG       5.161    Hong Kong		BASE S E				253 885	0,19
1.722       Brenntag S.E.       149.540         678       Covestro AG 144A <sup>(d)</sup> 38.504         4.507       Deutsche Post AG       272.056         20.210       E.ON S.E.       252.036         2.619       Infineon Technologies AG       121.213         1.282       Merck KGaA       323.399         3.087       METRO AG       35.041         19       Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG       5.161         Hong Kong							0,06
678       Covestro AG 144A <sup>(d)</sup> 38.504         4.507       Deutsche Post AG       272.056         20.210       E.ON S.E.       252.036         2.619       Infineon Technologies AG       121.213         1.282       Merck KGaA       323.399         3.087       METRO AG       35.041         19       Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG       5.161         Hong Kong							0,11
4.507       Deutsche Post AG       272.056         20.210       E.ON S.E.       252.036         2.619       Infineon Technologies AG       121.213         1.282       Merck KGaA       323.399         3.087       METRO AG       35.041         19       Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG       5.161         Hong Kong							0,03
2.619       Infineon Technologies AG       121.213         1.282       Merck KGaA       323.399         3.087       METRO AG       35.041         19       Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG       5.161         Hong Kong	4.507	Deutsche Post AG				272.056	0,20
1.282 Merck KGaA       323.399         3.087 METRO AG       35.041         19 Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG       5.161         Hong Kong						252.036	0,19
3.087 METRO AG		•				121.213	0,09
19 Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG         5.161           Hong Kong         1.534.781							0,24
1.534.781 Hong Kong							0,03
Hong Kong	19	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG			_	5.161	0,00
						1.534.781	1,14
44.534		AIA Group I td (d)				44 594	0.00
	4.200	AIA GIOUP LIU.				44.534	0,03

		Valor de mercado en	% de
Tenencias	Descripción del valor	en USD	% de patrimonio
	ordinarias – (continuación)		
rlanda 1 a	661 Accenture Plc. "A"	604.106	0,4
Japón	TOT ACCORDING THE A	004.100	0,4.
-	900 Acom Co., Ltd.	14.589	0,0
21.3	300 Amada Co., Ltd.	200.286	0,1
17.3	300 Casio Computer Co., Ltd.	225.006	0,1
2	200 Eizo Corp.	6.975	0,0
1	100 Fujitsu Ltd.	16.737	0,0
3.3	300 Hoya Corp.	529.387	0,3
	500 Isuzu Motors Ltd.	129.627	0,1
8	300 Kao Corp.	41.032	0,0
8	300 Keyence Corp.	499.565	0,3
	300 Komori Corp.	21.214	0,0
	500 Kyocera Corp.	89.315	0,0
	200 Marui Group Co., Ltd.	3.687	0,0
	500 Mitsubishi Gas Chemical Co., Inc.	8.343	0,0
	700 Mitsubishi HC Capital, Inc.	210.853	0,1
	000 Mitsubishi Shokuhin Co., Ltd.	47.654	0,0
	700 Mitsui & Co., Ltd.	263.970	
	700 Mitsui & Co., Lta. 000 Mitsui OSK Lines Ltd.		0,2
		172.707	0,1
	300 NEC Corp.	81.753	0,0
	600 NEC Networks & System Integration Corp.	9.640	0,0
	400 NGK Insulators Ltd.	165.069	0,12
	700 Nidec Corp.	542.685	0,40
	200 Nikon Corp.	116.876	0,0
	400 Nippon Express Co., Ltd.	193.756	0,1
2.8	300 Nippon Telegraph & Telephone Corp.	77.713	0,0
3	300 Nippon Yusen KK	19.651	0,0
5	500 Nitto Denko Corp.	35.041	0,03
36.8	300 Nomura Holdings, Inc.	155.047	0,1
8.3	300 ORIX Corp.	164.668	0,12
1.7	700 Showa Denko KK	37.414	0,03
2.4	400 SoftBank Group Corp.	128.151	0,0
	300 Sumitomo Corp.	229.429	0,17
	500 Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	84.924	0,06
	200 Suntory Beverage & Food Ltd.	77.887	0,06
	500 Tokio Marine Holdings, Inc.	131.322	0,10
	100 Tokyo Gas Co., Ltd.	122.487	0,09
	100 Tokyo Seimitsu Co., Ltd.	230.849	0,0
		40.272	0,03
	300 Tosoh Corp.		
	500 Toyota Tsusho Corp.	21.841	0,02
	300 USS Co., Ltd.	4.426	0,00
	200 Yamaha Motor Co., Ltd.	30.339	0,02
7	700 Yellow Hat Ltd.	9.598	0,0
		5.191.785	3,8
Luxemburg 2 1	100 Eurofins Scientific S.E.	275.221	0,20
Países Bajo			0,2
-	552 ASM International NV	254.755	0,1
	513 ASML Holding NV		
	380 Koninklijke DSM NV	419.809	0,3
	•	412.109	0,3
13.1	192 Stellantis NV	229.571	0,17
		1.316.244	0,98
Nueva Zela 1.2	<b>nda</b> 268 Meridian Energy Ltd.	4.106	0,00
Noruega	<del>`</del>		·
•	356 Nordic Semiconductor ASA	29.292	0,02
28.3	305 Norsk Hydro ASA	185.962	0,14
25.0	···· · · · · · · · · · · · · · · · · ·	215.254	0,1
			-,
Portugal			
Portugal 1.1	154 Galp Energia SGPS S.A.	10.796	0,0
1.1 Singapur	154 Galp Energia SGPS S.A.  100 Oversea-Chinese Banking Corp., Ltd.	10.796 89.586	0,0

		Valor de mercado	
Tenencias	Descripción del valor	en USD	% de patrimonio
Acciones ord	linarias – (continuación)		
España	Assistant O.A	0.000	0.04
	Acerinox S.A. Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	9.038 464.191	0,01 0,34
	, ,	473.229	0,35
Suecia			
	Getinge AB "B"	6.792	0,00
	Hexagon AB "B" Investor AB "B"	343.661 242.779	0,26 0,18
	Lundin Energy AB	145.373	0,10
	SSAB AB "B"	8.964	0,01
	Volvo AB "B"	28.107	0,02
		775.676	0,58
Suiza			
	ABB Ltd.	118.343	0,09
	Chubb Ltd. Kuehne & Nagel International AG	293.764 207.537	0,22 0,15
	Lonza Group AG	62.410	0,15
	Nestlé S.A.	369.867	0,28
603	Roche Holding AG	235.111	0,17
38.418	UBS Group AG	661.410	0,49
		1.948.442	1,45
Taiwán 6 126	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.—ADR <sup>(e)</sup>	734.569	0,54
Reino Unido	Taiwan Connocitation manufacturing Co., Ed. 7610	704.000	- 0,01
	AstraZeneca Plc.	722.612	0,54
	Aviva Plc.	153.237	0,11
15.489	Compass Group Plc.	308.526	0,23
	Ferguson Plc.	576.831	0,43
	InterContinental Hotels Group Plc.	480.959	0,36
	Next Plc. Persimmon Plc.	152.745 179.030	0,11 0,13
	Reckitt Benckiser Group Plc.	619.713	0,10
	Rentokil Initial Plc.	362.797	0,27
4.722	Rio Tinto Plc.—ADR <sup>(e)</sup>	299.753	0,22
	Safestore Holdings Plc.	9.523	0,01
	Stolt-Nielsen Ltd.	11.637	0,01
1.429	Vodafone Group Plc.—ADR <sup>(e)</sup>	21.178	0,01
Estados Unide	es e	3.898.541	2,89
	AbbVie, Inc.	389.524	0,29
134	AECOM	9.649	0,01
	Air Products and Chemicals, Inc.	292.273	0,22
	Align Technology, Inc.	117.269	0,09
	Ally Financial, Inc. Alphabet, Inc. "A"	180.849 2.255.684	0,13 1,67
	Amazon.com, Inc.	768.567	0,57
	AMC Entertainment Holdings, Inc. "A"	4.451	0,00
	AMERCO	261.243	0,19
	American Electric Power Co., Inc.	204.963	0,15
	American Equity Investment Life Holding Co.	278.762	0,21
	American Homes 4 Rent "A"	278.444 716.540	0,21
	American Tower Corp. Amgen, Inc.	127.174	0,53 0,09
	Anthem, Inc.	271.599	0,08
	Apple, Inc.	1.336.767	0,99
	Applied Materials, Inc.	125.301	0,09
	Archer-Daniels-Midland Co.	269.446	0,20
	Arista Networks, Inc.	43.535	0,03
	Atkore, Inc. AutoNation, Inc.	178.822 136.051	0,13 0,10
	Ball Corp.	613.640	0,10
	Biogen, Inc.	173.368	0,13
	Boston Scientific Corp.	690.313	0,51
17.856			
147	Broadcom, Inc.	82.907	
147 1.355	Broadcom, Inc. Bruker Corp. Buckle, Inc.	82.907 115.256 106.094	0,06 0,09 0,08

		Valor de mercado	
Tenencias	Descripción del valor	en USD	% del patrimonio
Acciones ord	inarias – (continuación)		
Estados Unido	s – (continuación)		
2.057	Burlington Stores, Inc.	598.710	0,44
	Camden Property Trust	269.808	0,20
	Campbell Soup Co.	15.106	0,01
	Caterpillar, Inc.	301.219	0,22
	Cerner Corp. Cheniere Energy, Inc.	51.003 180.437	0,04 0,13
	Choice Hotels International, Inc.	61.591	0,05
	Cigna Corp.	107.919	0,08
	Cinemark Holdings, Inc.	66.546	0,05
	Citigroup, Inc.	296.781	0,22
	Citizens Financial Group, Inc.	220.422	0,16
	CMS Energy Corp.	229.618	0,17
	Cognizant Technology Solutions Corp. "A"	282.250 265.575	0,21 0,20
	Colgate-Palmolive Co. Costco Wholesale Corp.	532.128	0,20
	CSX Corp.	292.292	0,22
	Danaher Corp.	15.781	0,01
	Darling Ingredients, Inc.	227.453	0,17
1.809	Dentsply Sirona, Inc.	87.845	0,07
	Dick's Sporting Goods, Inc.	173.983	0,13
	DocuSign, Inc.	255.210	0,19
	Dolby Laboratories, Inc. "A"	23.271	0,02
	Dow, Inc.	251.862 17.925	0,19
	DR Horton, Inc. Dynatrace, Inc.	64.640	0,01 0,05
	eBay, Inc.	85.262	0,06
	Elanco Animal Health, Inc.	511.769	0,38
	EPAM Systems, Inc.	138.665	0,10
597	Estee Lauder Cos., Inc. "A"	201.093	0,15
	Evercore, Inc. "A"	43.474	0,03
	Fair Isaac Corp.	94.486	0,07
	Fidelity National Information Services, Inc.	634.974	0,47
	First Industrial Realty Trust, Inc. Fortinet, Inc.	259.964 302.606	0,19 0,22
	Gartner, Inc.	274.700	0,22
	Gilead Sciences, Inc.	312.238	0,23
	Goosehead Insurance, Inc. "A"	33.461	0,03
563	Halliburton Co.	12.271	0,01
	HCA Healthcare, Inc.	267.432	0,20
	Hilton Worldwide Holdings, Inc.	59.195	0,04
	Hologic, Inc.	134.768	0,10
	HubSpot, Inc. Hyatt Hotels Corp. "A"	282.147 24.395	0,21 0,02
	Intel Corp.	24.393	0,02
	International Business Machines Corp.	189.591	0,14
	Interpublic Group of Cos., Inc.	61.236	0,05
	Intuit, Inc.	1.077.259	0,80
	IQVIA Holdings, Inc.	308.212	0,23
	Johnson & Johnson	492.980	0,37
	KB Home	112.124	0,08
	KeyCorp Korp Forny	213.679	0,16
	Korn Ferry Lennox International, Inc.	187.783 100.955	0,14 0,08
	LKQ Corp.	197.386	0,06
	ManpowerGroup, Inc.	70.738	0,05
	Marriott Vacations Worldwide Corp.	212.023	0,16
5.695	Marsh & McLennan Cos., Inc.	946.851	0,70
	Martin Marietta Materials, Inc.	384.416	0,29
	MasTec, Inc.	97.085	0,07
	Mettler-Toledo International, Inc.	310.228	0,23
	Microsoft Corp. Moderna, Inc.	1.151.136 94.651	0,85 0,07
	Molina Healthcare, Inc.	207.486	0,07
	Mondelez International, Inc. "A"	117.096	0,13
	MongoDB, Inc.	234.904	0,17
	NetApp, Inc.	82.236	0,06
	Nexstar Media Group, Inc. "A"	9.010	0,01
	NextEra Energy, Inc.	260.129	0,19
2.308	NIKE, Inc. "B"	391.252	0,29
	Norfolk Southern Corp.	134.063	0,10

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado USD	% del patrimonio
Acciones ord	narias – (continuación)		
	os – (continuación)		
4.894	Northern Trust Corp.	574.164	0,43
2.846	NVIDIA Corp.	947.377	0,70
829	Okta, Inc.	185.041	0,14
3.411	Omnicom Group, Inc.	228.435	0,17
	ON Semiconductor Corp.	208.296	0,15
	Otis Worldwide Corp.	232.998	0,17
	Ovintiv, Inc.	14.999	0,01
	Parker-Hannifin Corp.	245.497	0,18
	PayPal Holdings, Inc.	323.466	0,24
	Perficient, Inc.	24.021	0,02
	Pioneer Natural Resources Co. Procter & Gamble Co.	46.790	0,04
		747.638 142.596	0,56
	Prologis, Inc. Raymond James Financial, Inc.	51.954	0,11 0,04
	Reinsurance Group of America, Inc.	75.105	0,04
	S&P Global, Inc.	700.574	0,52
	Salesforce.com, Inc.	173.401	0,13
	SeaWorld Entertainment, Inc.	155.996	0,12
	ServiceNow, Inc.	327.324	0,24
	Simon Property Group, Inc.	93.648	0,07
	SiteOne Landscape Supply, Inc.	31.728	0,02
	Snowflake, Inc. "A"	71.344	0,05
3.932	Stewart Information Services Corp.	283.419	0,21
	Synchrony Financial	237.745	0,18
267	T Rowe Price Group, Inc.	54.951	0,04
551	Tesla, Inc.	642.466	0,48
1.186	Texas Instruments, Inc.	230.736	0,17
1.188	Travel & Leisure Co.	58.473	0,04
132	Ulta Beauty, Inc.	51.865	0,04
455	UnitedHealth Group, Inc.	202.343	0,15
1.117	VeriSign, Inc.	273.509	0,20
905	Vertex Pharmaceuticals, Inc.	172.629	0,13
	Visa, Inc. "A"	299.684	0,22
	Vishay Intertechnology, Inc.	229.971	0,17
	VMware, Inc. "A"	248.752	0,18
	Voya Financial, Inc.	92.347	0,07
	Vulcan Materials Co.	69.580	0,05
	Walgreens Boots Alliance, Inc.	242.221	0,18
	Walt Disney Co.	469.701	0,35
	Western Digital Corp.	237.811 117.695	0,18
	Western Union Co. Weyerhaeuser Co.	103.402	0,09 0,08
	Wyndham Hotels & Resorts, Inc.	201.850	0,08
	Zoetis, Inc.	247.016	0,13
1.101	2000, 110.	36.882.938	27,38
TOTAL DE ACC	ciones ordinarias 631.386)	57.323.777	42,55
	versión – 23,67 %		
Irlanda	Coldman Cooks Clobal Fauity Valatility Fund (Close do series - de distribución IOVA	0.070.704	0.10
	Goldman Sachs Global Equity Volatility Fund (Clase de acciones de distribución IO) <sup>(f)</sup>	3.278.701	2,43
	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de acumulación X) <sup>(f)(g)</sup>	8.533.960	6,33
	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X) <sup>(f)</sup> (h)	2.896.162	2,15
	Invesco Morningstar US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	335.040	0,25
	iShares S&P 500 Consumer Discretionary Sector UCITS ETF iShares S&P 500 Energy Sector UCITS ETF	332.367 709.877	0,25
	iShares S&P 500 Health Care Sector UCITS ETF	709.877 511.673	0,53
	iShares S&P 500 Industrials Sector UCITS ETF	511.673	0,38
	iShares S&P 500 Industrials Sector UCITS ETF	293.274 307.237	0,22 0,23
34.492	ionarca dai avo ivialenaia accidi dona en	17.198.291	12,77
Luxemburgo			
	Goldman Sachs Funds - Alternative Trend Portfolio (Clase de acciones de distribución IO)(f)	4.754.969	3,53

Tenencias	Descripción del valor				Valor de mercado USD	% del patrimonio
Fondos de i	nversión – (continuación)					
_	- (continuación)			v/f)	5.055.500	
	<ol> <li>Goldman Sachs Funds - Emerging Markets Equity ESG Portfolio (Clase</li> <li>Goldman Sachs Funds - Global Environmental Impact Equity Portfolio</li> </ol>			(6)	5.955.586 3.979.751	4,42 2,95
303.440	o Goldman Sacris Funds - Global Environmental Impact Equity Fortiono (	Clase de ac	ciones de distribuci	_	14.690.306	10,90
	ONDOS DE INVERSIÓN					
(coste USD 3					31.888.597	23,67
(coste USD 1	ALORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA D 19.602.871)	E VALORE	S OFICIAL		125.180.210	92,92
		<b>.</b>	(a)	(b)	Valor de mercado	, % de
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	USD	patrimonio
Obligacione por agencias	•					
Islas Caimán		LICD	1 100 0/	20/04/2024	240.006	0.10
	O AIMCO CLO Serie 2017-A <sup>(c)</sup> Neuberger Berman Loan Advisers CLO 31 Ltd. 2019-31X "AR" <sup>(c)</sup>	USD	1,182 % 1,172 %	20/04/2034 20/04/2031	249.986 250.241	0,18 0,19
	0 OZLM XVI Ltd. 2017-16X "A1R" <sup>(c)</sup>	USD	1,172 %	16/05/2030	250.067	0,19
					750.294	0,56
Reino Unido						
	6 Finsbury Square 2021-1GRX "AGRN" <sup>(c)</sup>	GBP	0,700 %	16/12/2067	131.012	0,10
Estados Unid		HOD	0.747.0/	45/00/0040	407.500	0.00
	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-P1 "A5"     COMM Mortgage Trust 2013-CCRE8 "A5"	USD USD	3,717 % 3,612 %	15/09/2048 10/06/2046	107.528 103.349	0,08 0,07
100.00	o communicação mais zono con Eco 7.0	002		10/00/2010	210.877	0,15
	BLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS NO EMITIDOS NI GARA	NITIZADOS	DOD ACENCIAS		210.077	0,10
(coste USD 1		NTIZADOS	POR AGENCIAS		1.092.183	0,81
TOTAL DE VA (coste USD 1.	ALORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULA .104.760)	DO			1.092.183	0,81
VALOR DE M (coste USD 1	ERCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS 20.707.631)				126.272.393	93,73
						,
Contratos de	e futuros – 0,17 %					
Número de				Compromis Valor de mercad		% del
contratos	Descripción del valor			US		patimonia
	AUD		,			
1	1 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021			Larga 1.097.70	5 10.203	0,01
	CAD					
	2 Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022			Larga 221.85	7 4.189	0,00
	EUR					
	1 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08			Larga 1.407.40		0,00
•	1 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 0	8/12/2021		Larga 247.98		0,01
				1.655.38	5 10.485	0,01
	JPY			1 250 00	0 2.100	0.00
	1 Futuros sobre bonos del Estado de Japón a 10 años 13/12/2021			Larga 1.350.00	0 3.109	0,00
	USD					0.00
11				Larga 2 105 50	4 30 976	11 ()
	3 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022			Larga 2.105.59 Larga 14.547.93		
11:	3 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 1 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022			Larga 14.547.93	7 196.805	0,15
11 <sup>.</sup>	3 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 1 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 2 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022			Larga 14.547.93 Larga 262.12	7 196.805 5 3.040	0,15 0,00
11 <sup>1</sup> 2 1!	3 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 1 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 2 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 5 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022			Larga 14.547.93 Larga 262.12 Larga 3.285.35	17 196.805 15 3.040 12 10.976	0,15 0,00 0,01
11: : 1: 1:	3 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 1 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 2 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 5 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022 1 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022	122		Larga     14.547.93       Larga     262.12       Larga     3.285.35       Larga     1.338.64	17 196.805 15 3.040 12 10.976 14.008	0,15 0,00 0,01 0,01
11: : 1: 1:	3 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 1 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 2 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 5 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022	022		Larga     14.547.93       Larga     262.12       Larga     3.285.35       Larga     1.338.64       Larga     1.398.25	7 196.805 5 3.040 2 10.976 8 14.008 0 50.165	0,15 0,00 0,01 0,01 0,04
11: : 1: 1:	3 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 1 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 2 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 5 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022 1 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022	022		Larga     14.547.93       Larga     262.12       Larga     3.285.35       Larga     1.338.64	7 196.805 5 3.040 2 10.976 8 14.008 0 50.165	0,02 0,15 0,00 0,01 0,01 0,04 0,23

Cantuataa	da fiitiiraa	– (continuación)

% del patrimonio	Minusvalía latente USD	Compromiso Valor de mercado USD		Descripción del valor	úmero de ontratos
		'		AUD	
(0,01)	(12.811)	3.365.046	Larga	Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 3 años 15/12/2021	41
				EUR	
(0,00)	(2.958)	345.907	Larga	Futuros sobre Euro BTP Bonos del Estado de Italia 08/12/2021	2
(0,00)	(842)	383.456	Larga	Futuros sobre OAT en euros 08/12/2021	2
(0,00)	(2.276)	427.604	Larga	EURO STOXX Banks Index 17/12/2021	80
(0,01)	(12.812)	(981.681)	Corta	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años 08/12/2021	(5)
(0,01)	(9.979)	(2.160.733)	Corta	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/12/2021	(14)
(0,02)	(28.867)	(1.985.447)			
				GBP	
(0,03)	(40.132)	(3.217.048)	Corta	Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022	(19)
				USD	,
(0,01)	(7.750)	(323.938)	Corta	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022	(2)
(0,01)	(11.344)	(587.937)	Corta	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022	(4)
(0,02)	(19.094)	(911.875)			
(0,08)	(100.904)			ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS	INUSVALÍA L

#### Contratos de divisas a plazo - 0,34 %

Divisa	Compra Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
USD	1.009.848 AUD	1.370.000	15/12/2021	28.525	0,02
USD	1.584.754 CAD	2.000.000	15/12/2021	18.356	0,02
USD	1.413.273 CHF	1.290.000	15/12/2021	4.273	0,00
USD	383.107 DKK	2.400.000	15/12/2021	15.758	0,01
USD	4.838.620 EUR	4.075.544	15/12/2021	199.195	0,15
USD	2.061.321 GBP	1.495.000	15/12/2021	63.672	0,05
USD	424.429 HKD	3.300.000	15/12/2021	1.107	0,00
USD	3.297.140 JPY	362.565.068	15/12/2021	76.557	0,06
USD	92.125 NOK	800.000	15/12/2021	3.706	0,00
USD	35.315 NZD	50.000	15/12/2021	1.127	0,00
USD	549.519 SEK	4.725.000	15/12/2021	25.215	0,02
USD	148.756 SGD	200.000	15/12/2021	2.111	0,00
USD	3.890.473 GBP	2.825.055	21/01/2022	113.082	0,08
USD	275.813 AUD	372.440	31/01/2022	8.912	0,01
USD	619.223 CAD	770.598	31/01/2022	15.497	0,01

PLUSVALIA LATENTE SUI	USVALIA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO				5//.093	0,43	
						Minusvalía	
					Fecha	latente	% del

Divisa	Compra Divisa	Venta	de vencimiento	USD	patrimonio
CAD	31.217 USD	24.780	15/12/2021	(330)	(0,00)
NZD	39.351 USD	27.931	15/12/2021	(1.025)	(0,00)
SEK	286.335 USD	33.312	15/12/2021	(1.539)	(0,00)
USD	49.967 ILS	160.000	15/12/2021	(922)	(0,00)
GBP	24.256 USD	32.717	21/01/2022	(285)	(0,00)
USD	9.961.300 EUR	8.814.295	10/02/2022	(90.886)	(0,07)
USD	1.796.371 JPY	204.286.025	16/02/2022	(19.961)	(0,02)
MINUSVALÍA LAT	TENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS	A PLAZO		(114.948)	(0,09)

#### Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones - (2,03 %)

Divisa	Compra Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	latente USD	% del patrimonio
USD	1.128.278 EUR	973.000	15/12/2021	20.656	0,02
PLUSVALÍA LAT	ENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A	PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA		20.656	0,02

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones - (continuación)

Divisa	Compra Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	latente USD	% de patrimonio
EUR GBP	19.773.000 USD 44.221.000 USD	23.445.610 60.914.302		15/12/2021 15/12/2021	(936.874) (1.825.341)	(0,70 (1,35
MINUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVIS	SAS A PLAZO CELEBRADOS CO	ON FINES DE COBERTURA		(2.762.215)	(2,05
Opciones - 0	,43 %			Plusvalía/(minusvalía)		
Tenencias	Descripción del valor			latente USD	Valor de mercado USD	% del patrimonio
	Opciones adquiridas AUD					
2.169.000	Put AUD / Call USD	Vence 14/11/2022	Precio de ejercicio 0,67	7.942	29.953	0,02
5.345.000	CHF Call CHF / Put SEK	Vence 10/11/2022	Precio de ejercicio 10,18	57.324	120.689	0,09
120.000	EUR Put EUR / Call USD	Vence 07/03/2023	Precio de ejercicio 1,19	2.386	6.754	0,00
25	GBP Call FTSE 100 Index	Vence 18/03/2022	Precio de ejercicio 7.579,65	(2.092)	1.549	0,00
	JPY		•	,		0,00
475.180.000	Call JPY / Put KRW	Vence 11/11/2022	Precio de ejercicio 11,63	19.009	77.645	0,06
983	Call NIKKEI 225 Index	Vence 30/12/2021	Precio de ejercicio 28.402,40	(2.236)	4.035	0,00
	Call NIKKEI 225 Index	Vence 30/12/2021	Precio de ejercicio 28.674,72	(4.143)	5.182	0,01
1.645	Put NIKKEI 225 Index	Vence 30/12/2021	Precio de ejercicio 23.711,78	489	1.483	0,00
				13.119	88.345	0,07
4.465.000	<b>NZD</b> Put NZD / Call USD	Vence 11/11/2022	Precio de ejercicio 0,64	18.985	61.089	0,05
	USD					
265.000	Call Futuros en eurodólares a 90 días	Vence 19/12/2022	Precio de ejercicio 99,00	(50.000)	100.700	0,07
47.500	Call Futuros en eurodólares a 90 días	Vence 13/03/2023	Precio de ejercicio 97,75	(23.318)	60.325	0,05
52.500	Call Futuros en eurodólares a 90 días	Vence 19/06/2023	Precio de ejercicio 97,75	(27.316)	58.275	0,04
185	Call Russell 2000 Index	Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 2.353,48	(4.953)	3.520	0,00
5.183.000	Call USD / Put CAD	Vence 09/11/2022	Precio de ejercicio 1,34	31.591	75.128	0,06
140.000	Call USD / Put CHF	Vence 07/03/2023	Precio de ejercicio 0,93	(1.766)	2.473	0,00
140.000	Call USD / Put JPY	Vence 07/03/2023	Precio de ejercicio 108,20	2.663	7.364	0,01
				(73.099)	307.785	0,23
(coste USD 59	CIONES ADQUIRIDAS 1.599)				616.164	0,46
	Opciones suscritas					
	GBP					
(25)	Put FTSE 100 Index	Vence 18/03/2022	Precio de ejercicio 6.135,90	1.111	(2.905)	(0,00)
(1.645)	JPY Put NIKKEI 225 Index	Vence 30/12/2021	Precio de ejercicio 23.711,78	4.112	(1.483)	(0,00)
	USD					
(316)	Put Health Care Select Sector Index	Vence 30/12/2022	Precio de ejercicio 1.286,61	(3.960)	(28.781)	(0,02)
(185)	Put Russell 2000 Index	Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 2.066,47	(1.601)	(5.572)	(0,01)
				(5.561)	(34.353)	(0,03)
TOTAL DE OPO	CIONES SUSCRITAS 3.403))				(38.741)	(0,03)
TOTAL DE OPO					577.423	0,43
						-,

Minusvalía

Contratos de	permutas financieras - 0,01 %					
Importe					Plusvalía	0/ 1.1
neto local teórico	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	latente USD	% del patrimonio
	Permutas de incumplimiento crediticio	(CDS)				<u> </u>
5.025.000		. ,				
	Investment Grade 35 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20 de diciembre de 2025	17.117	0,01
PLUSVALÍA LA	ATENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMP	PLIMIENTO CREDITICIO (CDS)			17.117	0,01
TOTAL DE PLU	USVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS	DE PERMUTAS FINANCIERAS			17.117	0,01
Importe					Minusvalía	
neto local				Fecha de	latente	% del
teórico	A pagar	A recibir	Divisa	vencimiento	USD	patrimonio
	Permutas de tipos de interés					
90.000	Fijo 0,000 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15 de diciembre de 2031	(899)	(0,00)
MINUSVALÍA I	ATENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS	DE INTERÉS			(899)	(0,00)
TOTAL DE MIN	NUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATO	S DE PERMUTAS FINANCIERAS			(899)	(0,00)
VALOR DE ME (coste USD 12	RCADO DE LAS INVERSIONES 1.260.827)				124.819.672	92,65
OTROS ACTIV	OS Y PASIVOS				9.908.536	7,35
PATRIMONIO					134.728.208	100,00
TOTAL DE INV	ERSIONES			Va	lor de mercado USD	% de patrimonio
Total inversione	es excluyendo derivados (coste USD 120.7	07.631)			126.272.393	93,73
Plusvalía latent	e sobre contratos de futuros				333.956	0,25
Minusvalía late	nte sobre contratos de futuros				(100.904)	(0,08)
Plusvalía latent	e sobre contratos de divisas a plazo				577.093	0,43
Minusvalía late	nte sobre contratos de divisas a plazo				(114.948)	(0,09)
Plusvalía latent	e sobre contratos de divisas a plazo celebr	rados con fines de cobertura			20.656	0,02
Minusvalía late	nte sobre contratos de divisas a plazo cele	brados con fines de cobertura			(2.762.215)	(2,05)
Valor de merca	do de opciones compradas (coste USD 59	1.599)			616.164	0,46
Valor de merca	do de opciones suscritas (coste USD (38.4	03))			(38.741)	(0,03)
	te sobre contratos de permutas financieras				17.117	0,01
	nte sobre contratos de permutas financiera	s			(899)	(0,00)
Otros activos y	pasivos				9.908.536	7,35
Patrimonio					134.728.208	100,00

El Comisionista de futuros fue Morgan Stanley & Co., Inc.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron BNP Paribas S.A., Deutsche Bank AG, JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Morgan Stanley & Co., Inc. y State Street Bank & Trust.

Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Barclays Bank Plc., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, Morgan Stanley & Co., International Plc. y Morgan Stanley & Co., Inc.

La contraparte de los contratos de permutas financieras fue Morgan Stanley.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,75 %.

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (d) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (e) Los títulos se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional)).
- (f) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- (g) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,238 %.
- (h) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

Tenencias	Descripción del valor					Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Valores mobilia	arios admitidos a cotiz	zación en una bolsa de valo	ores oficial				
Fondos de inve	ersión – 96,77 %						
Irlanda	7 Caldman Casha Astiva	Data IIC Large Can Equity IICI	TO ETE(a)			4.395.333	0.00
		Beta US Large Cap Equity UCI I Equity Volatility Fund (Clase d		)(a)		4.395.333	0,92 2,43
		iquid Reserves Plus Fund (Clas		,		43.461.321	9,1
		reasury Liquid Reserves Fund		,			
	distribución X) <sup>(a)(c)</sup>					14.210.935	2,98
	-	S Energy Infrastructure MLP U				1.299.419	0,27 0,94
	3 iShares Global Infrastru	rkets Property Yield UCITS ETF				4.486.365 5.432.498	1,14
		umer Discretionary Sector UCI	TS ETF			1.490.687	0,3
	3 iShares S&P 500 Energ	•				2.836.075	0,59
173.386	S iShares S&P 500 Health	th Care Sector UCITS ETF				1.721.723	0,36
	S iShares S&P 500 Indus					1.352.716	0,28
154.763	3 iShares S&P 500 Mater	rials Sector UCITS ETF			_	1.378.551	0,29
						93.665.741	19,62
Luxemburgo							
		- Alternative Trend Portfolio (C				19.709.532	4,13
		- Emerging Markets CORE® E	' '	'	a)	9.155.425	1,92
		<ul> <li>Emerging Markets Debt Loca</li> <li>Emerging Markets Debt Portf</li> </ul>	,			5.424.156 24.604.364	1,14 5,15
		- Emerging Markets Equity Pol	*	*		8.240.788	1,73
		- Global CORE® Equity Portfol	•	,		38.845.471	8,14
		- Global Credit Portfolio (Hedg				68.066.832	14,26
978.888	Goldman Sachs Funds	- Global Equity Partners Portfo	olio (Clase de acciones de dis	tribución IO) <sup>(a)</sup>		20.742.637	4,34
		- Global Fixed Income Plus Po				85.428.477	17,90
		- Global Fixed Income Portfoli			ción IO) <sup>(a)</sup>	41.434.147	8,68
		- Global High Yield Portfolio (C				19.315.540	4,05
		- Global Millennials Equity Por - Global Small Cap CORE® Ed			ιción IO)(a)	9.283.448 18.005.568	1,94 3,77
1.004.213	Ocidinali Cacils i dilas	- Global Girlail Gap GOIL LC	quity i ortiono (orașe de acore	ries partadies de distrib	_	368.256.385	77,15
TOTAL DE EOND	DOS DE INVERSIÓN					000.200.000	77,10
(coste USD 409.3	357.123)					461.922.126	96,77
TOTAL DE VALO (coste USD 409.3		MITIDOS A COTIZACIÓN EN U	JNA BOLSA DE VALORES (	OFICIAL		461.922.126	96,77
VALOR DE MERO (coste USD 409.3		ONES EXCLUYENDO DERIVA	ADOS			461.922.126	96,77
Contratos de futu	euros – 0,18 %						
					Compromiso		
Número de					Valor de mercado en	Plusvalía latente	% de
contratos	Descripción del valor				USD	USD	patrimonic
	USD			-			
		i S&P 500 Index 17/12/2021 del Tesoro de EE. UU. a 10		Larga	2.083.838	78.738	0,02
200	años 22/03/2022			Larga	78.113.250	1.059.762	0,22
					80.197.088	1.138.500	0,24
	ENTE SOBRE CONTRAT	TOS DE FUTUROS				1.138.500	0,24
PLUSVALÍA LATI							
PLUSVALÍA LATI					Compromiso	D!!f:	
					Compromiso Valor de mercado en	Plusvalía latente	% del
PLUSVALÍA LATE  Número de contratos	Descripción del valor				Valor de mercado	Plusvalía latente USD	
Número de					Valor de mercado en	latente	
Número de contratos	Descripción del valor  EUR 2 EURO STOXX Banks Ir	ndex 17/12/2021		Larga	Valor de mercado en	latente	patrimonio
Número de contratos 422	Descripción del valor			Larga Larga	Valor de mercado en USD	latente USD	patrimonio (0,00
Número de contratos 422 45	Descripción del valor  EUR 2 EURO STOXX Banks Ir  USD	EAFE Index 17/12/2021			Valor de mercado en USD 2.255.612	(12.004)	(0,00)
Número de contratos 422 45 MINUSVALÍA LAT	Descripción del valor  EUR 2 EURO STOXX Banks Ir  USD 5 Futuros sobre el MSCI	EAFE Index 17/12/2021 ATOS DE FUTUROS			Valor de mercado en USD 2.255.612	(12.004) (284.619) (296.623)	(0,00)
Número de contratos 422 45 MINUSVALÍA LAT	Descripción del valor  EUR 2 EURO STOXX Banks Ir  USD 5 Futuros sobre el MSCI I	EAFE Index 17/12/2021 ATOS DE FUTUROS			Valor de mercado en USD 2.255.612 5.062.500	(12.004) (284.619) (296.623)	% del patrimonio (0,00) (0,06) (0,06) % de
Número de contratos 422 45 MINUSVALÍA LAT	Descripción del valor  EUR 2 EURO STOXX Banks Ir  USD 5 Futuros sobre el MSCI I	EAFE Index 17/12/2021 ATOS DE FUTUROS	Venta		Valor de mercado en USD 2.255.612	(12.004) (284.619) (296.623)	(0,00) (0,06)
Número de contratos 422 45 MINUSVALÍA LAT Contratos de di	Descripción del valor  EUR 2 EURO STOXX Banks Ir  USD 5 Futuros sobre el MSCI I  TENTE SOBRE CONTRA  ivisas a plazo – 0,17 %  Compra	EAFE Index 17/12/2021 ATOS DE FUTUROS	Venta 2.490.000		Valor de mercado en USD 2.255.612 5.062.500	(12.004) (284.619) (296.623)  Plusvalía latente en	(0,00) (0,06) (0,06)

	visas a plazo – (conti	induoion,					
					Fecha	Plusvalía latente en	% de
Divisa	Compra		Venta		de vencimiento	USD	patrimonio
USD	2.508.833	CHF	2.290.000		15/12/2021	7.585	0,00
USD	632.127	DKK	3.960.000		15/12/2021	26.000	0,01
JSD	8.773.704	EUR	7.390.000		15/12/2021	361.244	0,08
JSD	3.888.243	GBP	2.820.000		15/12/2021	120.104	0,02
JSD	861.721		6.700.000		15/12/2021	2.248	0,00
JSD	6.747.792		742.000.000		15/12/2021	156.773	0,03
JSD	166.976		1.450.000		15/12/2021	6.718	0,00
USD	70.630	NZD	100.000		15/12/2021	2.255	0,00
USD			8.400.000		15/12/2021	44.827	0,01
USD	290.075		390.000		15/12/2021	4.116	0,00
PLUSVALIA LATE PLAZO	INTE SOBRE CONTRA	TOS DE DIVISAS A				817.490	0,17
Divisa	Compra	Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% del patrimonio
USD	87.443		280.000		15/12/2021	(1.614)	(0,00)
MINUSVALÍA LAT	ENTE SOBRE CONTR				10,12,2021		
PLAZO	sas a plazo específico	e do una claeo do a	accionos – (0.83 %)			(1.614)	(0,00)
Contratos de divi	sas a piazo especifico	s de una ciase de a	(0,03 /6)			Plusvalía latente	
					Fecha	en	% del
Divisa	Compra	Divisa	Venta		de vencimiento	USD	patrimonio
USD	2.706.575	EUR	2.271.000		15/12/2021	121.367	0,02
PLUSVALÍA LATE	NTE SOBRE CONTRA	TOS DE DIVISAS A	PLAZO CELEBRADOS CON	FINES DE COBERTURA		121.367	0,02
					Essha	Minusvalía latente	0/ dal
Divisa	Compra	Divisa	Venta		de vencimiento	USD	% del patrimonio
EUR	27.298.000	USD	32.322.269		15/12/2021	(1.247.396)	(0,26)
GBP	65.923.000	USD	90.895.272		15/12/2021	(2.807.676)	(0,59)
MINUSVALÍA LAT COBERTURA	ENTE SOBRE CONTR	ATOS DE DIVISAS	A PLAZO CELEBRADOS COM	I FINES DE		(4.055.072)	(0,85)
Opciones - 0,45	%					,	(-,,
•					Plusvalía /(minusvalía) latente	Valor de mercado	% de
Tenencias	Descripción del valor				USD	en USD	patrimonic
	Opciones adquiridas						
	AUD						
7.772.000	Put AUD / Call USD		Vence 14/11/2022	Precio de ejercicio 0,67	28.459	107.330	0,02
	CHF						
18.944.000	Call CHF / Put SEK		Vence 10/11/2022	Precio de ejercicio 10,18	203.170	427.750	0,09
490.000	EUR Put EUR / Call USD		Vence 07/03/2023	Precio de ejercicio 1,19	9.745	27.579	0,01
	GBP						
92	Call FTSE 100 Index		Vence 18/03/2022	Precio de ejercicio 7.579,65	(7.699)	5.701	0,00
1 702 051 000	JPY Call JPY / Put KRW		Vence 11/11/2022	Precio de ejercicio 11,63	68.086	278.118	0,06
	Call NIKKEI 225 Index		Vence 30/12/2021	Precio de ejercicio 28.402,40	(8.169)	14.741	0,00
	Call NIKKEI 225 Index		Vence 30/12/2021	Precio de ejercicio 28.674,72	(15.259)	19.088	0,00
	Put NIKKEI 225 Index		Vence 30/12/2021	Precio de ejercicio 23.711,78	1.802	5.461	0,00
0.000	T ULTVIICKET 220 IIIUCX		VC/ICC 30/ 12/2021	1 1000 de ejerololo 20.7 11,70			
					46.460	317.408	0,07
15.994.000	<b>NZD</b> Put NZD / Call USD		Vence 11/11/2022	Precio de ejercicio 0,64	68.007	218.826	0,05
	USD						
	Call Euturos on aurodó	lares a 90 días	Vence 19/12/2022	Precio de ejercicio 99,00	(178.774)	360.050	0,07
947.500	Call Futuros en eurodo						
	Call Futuros en eurodó		Vence 13/03/2023	Precio de ejercicio 97,75	(98.180)	254.000	0,05
200.000		lares a 90 días	Vence 13/03/2023 Vence 19/06/2023	Precio de ejercicio 97,75 Precio de ejercicio 97,75	(98.180) (111.864)	254.000 238.650	0,05 0,05
200.000 215.000	Call Futuros en eurodó	lares a 90 días lares a 90 días		•			

Opciones - (continuación)

Tenencias	Descripción del valor			Plusvalía /(minusvalía) latente USD	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	Opciones adquiridas – (continuación)			,		
	USD – (continuación)					
580.000	Call USD / Put CHF	Vence 07/03/2023	Precio de ejercicio 0,93	(7.317)	10.246	0,00
580.000	Call USD / Put JPY	Vence 07/03/2023	Precio de ejercicio 108,20	11.032	30.506	0,01
				(290.715)	1.172.256	0,24
TOTAL DE OPCIO	ONES ADQUIRIDAS 0.423)				2.276.850	0,48
	Opciones suscritas					
	GBP					
(92)	Put FTSE 100 Index	Vence 18/03/2022	Precio de ejercicio 6.135,90	4.087	(10.692)	(0,00)
	JPY					
(6.059)	Put NIKKEI 225 Index	Vence 30/12/2021	Precio de ejercicio 23.711,78	15.147	(5.461)	(0,00)
	USD					
(1.119)	Put Health Care Select Sector Index	Vence 30/12/2022	Precio de ejercicio 1.286,61	(14.022)	(101.920)	(0,02)
(657)	Put Russell 2000 Index	Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 2.066,47	(5.687)	(19.788)	(0,01)
				(19.709)	(121.708)	(0,03)
TOTAL DE OPCIO	DNES SUSCRITAS 386))				(137.861)	(0,03)
TOTAL DE OPCIO (coste USD 2.082					2.138.989	0,45
VALOR DE MERO (coste USD 411.4	CADO DE LAS INVERSIONES 39.160)				461.785.163	96,74
OTROS ACTIVOS	Y PASIVOS				15.539.037	3,26
PATRIMONIO					477.324.200	100,00
					Valor de mercado	
TOTAL DE INVER	RSIONES				en USD	% del patrimonio
Total inversiones	excluyendo derivados (coste USD 409.357.1	123)			461.922.126	96.77
	sobre contratos de futuros	120)			1.138.500	0,24
	sobre contratos de futuros				(296.623)	(0,06)
	obre contratos de divisas a plazo				817.490	0,17
	sobre contratos de divisas a plazo				(1.614)	(0,00)
	obre contratos de divisas a plazo celebrado	s con fines de cobertura			121.367	0,02
	sobre contratos de divisas a plazo celebrad				(4.055.072)	(0,85)
	de opciones compradas (coste USD 2.219.				2.276.850	0,48
	de opciones suscritas (coste USD (137.386	,			(137.861)	(0,03)
Otros activos y pa		,,			15.539.037	3,26
Patrimonio					477.324.200	100,00

El Comisionista de futuros fue Morgan Stanley & Co., Inc.

La contraparte de los contratos de divisas a plazo fue Morgan Stanley & Co., Inc.

Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Barclays Bank Plc., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, Morgan Stanley & Co. International Plc. y Morgan Stanley & Co., Inc. La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,61 %.

<sup>(</sup>a) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

<sup>(</sup>b) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,238 %.

 $<sup>^{\</sup>rm (c)}$   $\,$  EI rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

Tenencias	Descripción del valor		n	Valor de nercado en USD	% del patrimonio	
Valores mobili	arios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial					
Fondos de inv	ersión – 97,14 %					
Irlanda						
	8 Goldman Sachs ActiveBeta US Large Cap Equity UCITS ETF <sup>(a)</sup>	a)		9.411.210	4,33	
	0 Goldman Sachs Global Equity Volatility Fund (Clase de acciones de distribución IO) 9 Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de accumulación			5.597.796 27.847.994	2,58 12,81	
	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribu-     Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribu-	,		2.753.731	1,27	
	9 Invesco Morningstar US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	0.01.71)		838.875	0,39	
	6 iShares Core S&P 500 UCITS ETF			31.095.544	14,31	
180.41	2 iShares Developed Markets Property Yield UCITS ETF			5.228.340	2,40	
	5 iShares Global Infrastructure UCITS ETF			5.365.420	2,47	
	3 iShares S&P 500 Consumer Discretionary Sector UCITS ETF			617.161	0,28	
	3 iShares S&P 500 Energy Sector UCITS ETF			1.514.399	0,70	
	4 iShares S&P 500 Health Care Sector UCITS ETF			1.107.433	0,51	
	0 iShares S&P 500 Industrials Sector UCITS ETF 4 iShares S&P 500 Materials Sector UCITS ETF			560.046 570.739	0,26 0,26	
04.07	4 Ionares our 300 Materials occion don'to Em		_	92.508.688	42,57	
Luvomburgo				92.300.000	42,37	
Luxemburgo 935.60	3 Goldman Sachs Funds - Alternative Trend Portfolio (Clase de acciones de distribució	in IO) <sup>(a)</sup>		10.132.577	4,66	
	5 Goldman Sachs Funds - Emerging Markets CORE® Equity Portfolio (Clase de accior			4.763.636	2,19	
	2 Goldman Sachs Funds - Emerging Markets Debt Local Portfolio (Clase de acciones	,		2.204.978	1,01	
911.35	5 Goldman Sachs Funds - Emerging Markets Debt Portfolio (Clase de acciones de dis	tribución IO) <sup>(a)</sup>		10.863.349	5,00	
236.92	2 Goldman Sachs Funds - Emerging Markets Equity Portfolio (Clase de acciones de d	istribución IO) <sup>(a)</sup>		4.695.789	2,16	
	0 Goldman Sachs Funds - Global CORE® Equity Portfolio (Clase de acciones puntuale	,		34.022.063	15,66	
	7 Goldman Sachs Funds - Global Credit Portfolio (Hedged) (Clase de acciones puntua			4.200.695	1,93	
	6 Goldman Sachs Funds - Global Equity Partners Portfolio (Clase de acciones de distr	'		17.266.369	7,95	
	3 Goldman Sachs Funds - Global High Yield Portfolio (Clase de acciones de distribucio			3.348.089 8.877.450	1,54 4,09	
	646.573 Goldman Sachs Funds - Global Millennials Equity Portfolio (Clase de acciones de distribución IO) <sup>(a)</sup> 1.014.986 Goldman Sachs Funds - Global Small Cap CORE <sup>®</sup> Equity Portfolio (Clase de acciones puntuales de distribución IO) <sup>(a)</sup>					
1.014.96	18.198.695 118.573.690	8,38 54,57				
TOTAL DE FON	DOS DE INVERSIÓN			110.070.000	04,07	
(coste USD 168				211.082.378	97,14	
TOTAL DE VALO (coste USD 168	DRES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VALORES O 702.376)	FICIAL		211.082.378	97,14	
VALOR DE MER (coste USD 168	CADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS .702.376)			211.082.378	97,14	
Contratos de f	uturos – (0,12 %)					
Contratos de 1	utuli 03 – (0, 12 70)		Compromiso			
			Valor de mercado	Plusvalía		
Número de contratos	Descripción del valor		en USD	latente USD	% del patrimonio	
	CAD					
1	4 Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021	Larga	2.784.980	97.297	0,04	
	CHF					
1	8 Futuros sobre Swiss Market Index 17/12/2021	Larga	2.392.467	20.240	0,01	
	EUR  1. Futures cobre al E mini ETSE MIR Index 17/13/2021	Larga	147.465	2 133	0.00	
	1 Futuros sobre el E-mini FTSE MIB Index 17/12/2021	Larga	147.465	2.133	0,00	
2	GBP 2 Futuros sobre el FTSE 100 Index 17/12/2021	Larga	3.025.660	13.407	0,01	
		Laiya	3.023.000	13.407		
•	USD	1	F 400 000	76.050	0.04	
	2 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 5 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022	Larga Larga	5.183.000 9.829.688	76.250 133.084	0,04 0,06	
,	3 Tutulos sobre pagares del Tesoro de EE. 00. a 10 anos 22/03/2022	Laiga				
			15.012.688	209.334	0,10	
PLUSVALÍA LA	TENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS			342.411	0,16	
			Compromiso	Diversal!-		
Número de			Valor de mercado en	Plusvalía latente	% del	
contratos	Descripción del valor		USD	USD	patrimonio	
	EUR					
	8 Futuros sobre el Amsterdam Index 17/12/2021	Larga	1.426.865	(70.911)	(0,03)	
2	4 Futuros sobre el CAC 40 Index 17/12/2021	Larga	1.840.314	(111.145)	(0,05)	
	5 Futuros sobre el DAX Index 17/12/2021	Larga	2.163.054	(66.920)	(0,03)	
		-				

Número de	ıturos – (continuación	,			Compromiso Valor de mercado er	Plusvalía	% de
contratos	Descripción del valor			,	USE		patrimonio
	EUR – (continuación) EURO STOXX Banks II Futuros sobre el IBEX 3			Lar Lar	•		(0,01) (0,03)
C	T didios sobie el IDEX	55 IIIUCX 17/12/2021		Lai	7.654.679	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	(0,15)
	HKD						
4	Futuros sobre el Hang	Seng Index 30/12/202		Lar	ga 602.271	(30.969)	(0,01)
24	JPY Futuros sobre el TOPIX	( Index 09/12/2021		Lar	ga 4.041.208	(171.446)	(0,08
	SEK				<u>-</u>		
32	2 Futuros sobre el OMX S	Stockholm 30 Index 17	7/12/2021	Lar	ga 804.818	(36.425)	(0,02)
21	SGD Futuros sobre el MSCI	Singapore Index 30/1	2/2021	Lar	ga 530.024	(32.568)	(0,02)
	TENTE SOBRE CONTRA			Lui	90 000.02	(592.763)	(0,28)
Contratos de di	ivisas a plazo – 0,15 %	<u> </u>				(	(-, -,
Contratos de di	ivisas a piazo – 0,13 /	0				Plusvalía	
Divisa	Compra	Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	latente en USD	% de patrimonio
USD	729.744		990.000		15/12/2021	20.613	0,01
USD	1.148.946	CAD	1.450.000		15/12/2021	13.308	0,01
USD	996.960	CHF	910.000		15/12/2021	3.014	0,00
USD	263.386	DKK	1.650.000		15/12/2021	10.834	0,00
USD	3.490.486	EUR	2.940.000		15/12/2021	143.716	0,07
USD	1.530.479	GBP	1.110.000		15/12/2021	47.275	0,02
USD	336.971	HKD	2.620.000		15/12/2021	879	0,00
USD	2.509.961	JPY	276.000.000		15/12/2021	58.314	0,03
USD	63.336	NOK	550.000		15/12/2021	2.548	0,00
USD	28.252	NZD	40.000		15/12/2021	902	0,00
USD	375.068	SEK	3.225.000		15/12/2021	17.211	0,01
USD	111.567	SGD	150.000		15/12/2021	1.583	0,00
PLUSVALÍA LAT	ENTE SOBRE CONTRA	TOS DE DIVISAS A P	LAZO			320.197	0,15
						Minusvalía	0/ 1
Divisa	Compra	Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	latente USD	% de patrimonio
USD	37.475	ILS	120.000		15/12/2021	(692)	(0,00
MINUSVALÍA LA	TENTE SOBRE CONTRA	ATOS DE DIVISAS A	PLAZO			(692)	(0,00)
Contratos de div	risas a plazo específicos	s de una clase de ac	ciones - (0,26 %)				
					Fecha	Plusvalía latente en	% del
Divisa	Compra		Venta		de vencimiento	USD	patrimonio
USD	289.001		251.000	N FINES DE CORERTURA	15/12/2021	3.273	0,00
PLUSVALIA LAT	ENTE SOBRE CONTRA	105 DE DIVISAS A P	LAZO CELEBRADOS CO	N FINES DE COBERTURA		3.273	0,00
Divice	Compra	Divice	Vonta		Fecha de vencimiento	Minusvalía latente	% del
Divisa	Compra		Venta		de vencimiento	USD	•
EUR GBP	2.361.000 11.523.000		2.800.452 15.858.118		15/12/2021 15/12/2021	(112.791) (460.861)	(0,05) (0,21)
				N FINES DE COBERTURA		(573.652)	(0,26)
Opciones - 0,4						(* * * * * * * * * * * * * * * * * * *	(-, -,
					Plusvalía /(minusvalía) latente		% del
Tenencias	Descripción del valor				USD		patrimonio
	Opciones adquiridas						
2 550 000	AUD / Call LICD		Vanna 44/44/0000	Dennie de nigratata 0.07	40.000	40.440	0.00
3.559.000	Put AUD / Call USD		Vence 14/11/2022	Precio de ejercicio 0,67	13.032	49.149	0,02
9 651 000	CHF  Call CHE / Put SEK		Vence 10/11/2022	Precio de ejercicio 10 18	92 780	195 337	0.09

92.780

195.337

0,09

Precio de ejercicio 10,18

Vence 10/11/2022

8.651.000 Call CHF / Put SEK

#### Opciones - (continuación)

Tenencias	Descripción del valor			Plusvalía /(minusvalía) latente USD	Valor de mercado en USD	% de
	Opciones adquiridas – (continuación)					
	EUR					
300.000	Put EUR / Call USD	Vence 07/03/2023	Precio de ejercicio 1,19	5.966	16.885	0,01
	GBP			(= == t)		
	Call FTSE 100 Index	Vence 18/03/2022	Precio de ejercicio 7.579,65	(5.021)	3.718	0,00
779.777.000	JPY Call JPY / Put KRW	Vence 11/11/2022	Precio de ejercicio 11,63	31.193	127.417	0,06
	Call NIKKEI 225 Index	Vence 30/12/2021	Precio de ejercicio 28.402,40	(5.373)	9.696	0,00
	Call NIKKEI 225 Index	Vence 30/12/2021	Precio de ejercicio 28.674,72	(10.092)	12.627	0,01
	Put NIKKEI 225 Index	Vence 30/12/2021	Precio de ejercicio 23.711,78	1.192	3.612	0,00
				16.920	153.352	0,07
	NZD			10.020	100.002	0,01
7.328.000	Put NZD / Call USD	Vence 11/11/2022	Precio de ejercicio 0,64	31.159	100.260	0,05
	USD					
537.500	Call Futuros en eurodólares a 90 días	Vence 19/12/2022	Precio de ejercicio 99,00	(101.415)	204.250	0,09
	Call Futuros en eurodólares a 90 días	Vence 13/03/2023	Precio de ejercicio 97,75	(55.226)	142.875	0,07
	Call Futuros en eurodólares a 90 días	Vence 19/06/2023	Precio de ejercicio 97,75	(62.436)	133.200	0,06
	Call Russell 2000 Index	Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 2.353,48	(11.887)	8.449	0,00
8.390.000	Call USD / Put CAD	Vence 09/11/2022	Precio de ejercicio 1,34	51.137	121.613	0,06
	Call USD / Put CHF	Vence 07/03/2023	Precio de ejercicio 0,93	(4.541)	6.359	0,00
	Call USD / Put JPY	Vence 07/03/2023	Precio de ejercicio 108,20	6.847	18.935	0,01
			_	(177.521)	635.681	0,29
	ONES ADQUIRIDAS					
(coste USD 1.177	7.068)				1.154.382	0,53
	Opciones suscritas					
(60)	GBP	Vanca 40/03/2022	Dracio de ciercicio 6 125 00	2.666	(6.072)	(0.00)
(60)	Put FTSE 100 Index	Vence 18/03/2022	Precio de ejercicio 6.135,90	2.666	(6.973)	(0,00)
(4 008)	JPY Put NIKKEI 225 Index	Vence 30/12/2021	Precio de ejercicio 23.711,78	10.018	(3.612)	(0,00
()	USD				(0.0.)	(4,44)
(777)	Put Health Care Select Sector Index	Vence 30/12/2022	Precio de ejercicio 1.286,61	(9.736)	(70.770)	(0,03
, ,	Put Russell 2000 Index	Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 2.066,47	(3.844)	(13.373)	(0,01)
()	. 4	70.100 0 17 12/2021		(13.580)	(84.143)	(0,04)
TOTAL DE OPCIO	ONES SUSCRITAS			(10.000)	(0 10)	(0,01)
(coste USD (93.8	33))				(94.728)	(0,04)
TOTAL DE OPCIO (coste USD 1.083					1.059.654	0,49
	CADO DE LAS INVERSIONES					
(coste USD 169.7					211.640.806	97,40
OTROS ACTIVOS	S Y PASIVOS				5.659.580	2,60
PATRIMONIO					217.300.386	100,00
				Va	or de mercado	% de
TOTAL DE INVER	SIONES				en USD	% de patrimonio
Total inversiones e	excluyendo derivados (coste USD 168.702.3	76)			211.082.378	97,14
	obre contratos de futuros	,			342.411	0,16
	sobre contratos de futuros				(592.763)	(0,28
	obre contratos de divisas a plazo				320.197	0,15
	sobre contratos de divisas a plazo				(692)	(0,00
	sobre contratos de divisas a plazo celebrados	con fines de cohertura			3.273	0,00
	sobre contratos de divisas a plazo celebrados				(573.652)	
	•				, ,	(0,26
	de opciones compradas (coste USD 1.177.0	00)			1.154.382	0,53
	de opciones suscritas (coste USD (93.833))				(94.728)	(0,04
Otros activos y pa	21402				5.659.580	2,60
Patrimonio					217.300.386	100,00

El Comisionista de futuros fue Morgan Stanley & Co., Inc.

La contraparte de los contratos de divisas a plazo fue Morgan Stanley & Co., Inc.

Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Barclays Bank Plc., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, Morgan Stanley & Co. International Plc. y Morgan Stanley & Co., Inc. La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,53 %.

- (a) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- $^{(b)}$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,238 %.
- $^{(c)}$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

					Valor de mercado en	% d
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	USD	% a patrimon
/aloros mohil	iarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial		•			•
Bonos – 25,19 Austria						
225.000	ams AG	USD	7,000 %	31/07/2025	237.937	0,0
Bermudas						
150.000	NCL Corp., Ltd.	USD	3,625 %	15/12/2024	138.750	0,0
slas Vírgenes	Británicas					
200.000	Studio City Finance Ltd.	USD	5,000 %	15/01/2029	180.598	0,0
Canadá						
	1011778 BC ULC Via New Red Finance, Inc. Bausch Health Cos., Inc.	USD	4,000 % 5,500 %	15/10/2030 01/11/2025	82.990 253.161	0,0 0,0
	Bausch Health Cos., Inc.	USD	9,000 %	15/12/2025	104.638	0,
	Bausch Health Cos., Inc.	USD	5,000 %	30/01/2028	229.861	0,0
	Bausch Health Cos., Inc.	USD	5,250 %	30/01/2030	43.250	0,0
	Bausch Health Cos., Inc.	USD	5,250 %	15/02/2031	246.240	0,
100.000	Bombardier, Inc.	USD	7,500 %	01/12/2024	103.563	0,
45.000	Bombardier, Inc.	USD	7,500 %	15/03/2025	45.844	0,0
83.000	Bombardier, Inc.	USD	7,875 %	15/04/2027	85.490	0,
	Brookfield Residential Properties, Inc. Via Brookfield Residential US LLC	USD	4,875 %	15/02/2030	47.353	0,
	Canadian Pacific Railway Co.	USD	2,450 %	02/12/2031	328.919	0,
	Cenovus Energy, Inc.	USD	5,375 %	15/07/2025	40.023	0,
	First Quantum Minerals Ltd.	USD	7,250 %	01/04/2023	405.250	0,
	GFL Environmental, Inc.	USD	5,125 %	15/12/2026	62.400	0,
	GFL Environmental, Inc.	USD	4,000 %	01/08/2028	292.940	0,
	Masonite International Corp.	USD	5,375 %	01/02/2028 01/03/2030	109.987 206.741	0, 0,
	Mattamy Group Corp. MEG Energy Corp.	USD	4,625 % 7,125 %	01/02/2027	62.250	0,
	MEG Energy Corp.	USD	5,875 %	01/02/2029	100.188	0,
	Superior Plus LP Via Superior General Partner, Inc.	USD	4,500 %	15/03/2029	152.437	0,
	Teck Resources Ltd.	USD	3,900 %	15/07/2030	156.074	0,
	Telesat Canada Via Telesat LLC	USD	4,875 %	01/06/2027	132.588	0,0
	Videotron Ltd.	USD	5,375 %	15/06/2024	240.469	0,0
					3.532.656	0,6
slas Caimán						
	Global Aircraft Leasing Co., Ltd.	USD	6,500 %	15/09/2024	120.670	0,0
	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd. Via HawaiianMiles Loyalty Ltd.	USD	5,750 %	20/01/2026	114.125	0,0
	Noble Finance Co.	USD	11,000 %	15/02/2028	33.377	0,
	Seagate HDD Cayman	USD	3,125 %	15/07/2029	154.646	0,
	Transocean Poseidon Ltd.	USD	6,875 %	01/02/2027	37.830	0,
470.000	Transocean, Inc.	050	11,500 %	30/01/2027	446.500	0,
rancia					907.148	0,
	Altice France S.A.	USD	5,125 %	15/01/2029	269.445	0,
341.000	Altice France S.A. 144A(c)	USD	5,125 %	15/07/2029	326.507	0,
1.272.000	Altice France S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/10/2029	1.233.840	0,
100.000	CAB SELAS	EUR	3,375 %	01/02/2028	112.426	0,
	Chrome Holdco SASU	EUR	5,000 %	31/05/2029	371.686	0,
	Constellium S.E.	USD	3,750 %	15/04/2029	238.438	0,
	Crédit Agricole S.A. (d)	USD	8,125 %	Perp.	236.296	0,
	Électricité de France S.A. <sup>(d)</sup>	EUR	5,000 %	Perp.	125.903	0,
	Getlink S.E.	EUR	3,500 %	30/10/2025	114.654	0,0
520.000	Laboratoire Eimer Selas	EUR	5,000 %	01/02/2029	594.576	0,
					3.623.771	0,
Memania 500.000	ADLER Real Estate AG	EUR	3,000 %	27/04/2026	518.166	0,
	Cheplapharm Arzneimittel GmbH	USD	5,500 %	15/01/2028	203.250	0,
	Deutsche Bank AG <sup>(d)</sup>	USD	3,729 %	14/01/2032	333.963	0,0
	IHO Verwaltungs GmbH	USD	6,375 %	15/05/2029	216.750	0,
	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH	EUR	2,000 %	15/07/2025	168.607	0,
792.000	TK Elevator Holdco GmbH 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,625 %	15/07/2028	827.640	0,
					2.268.376	0,4
rlanda	AgrCon Iroland Conital DAC Via AgrCon Clab of Addition Total	1100	0.500.01	45/07/0005	204.007	0
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	6,500 %	15/07/2025	291.837	0,
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	3,000 %	29/10/2028	605.406	0,
∠00.000	Motion Bondco DAC	USD	6,625 %	15/11/2027	202.904	0,

					Valor de mercado en	% d
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	USD	% d patrimon
Bonos – (con	tinuación)					
rlanda – (conti	·					
•	Motion Bondco DAC 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,625 %	15/11/2027	605.413	0,
	STERIS Irish FinCo Unlimited Co.	USD	2,700 %	15/03/2031	421.652	0,0
		-	·		2.127.212	0,3
talia						
275.000	Brunello Bidco SpA	EUR	3,500 %	15/02/2028	310.068	0,0
100.000	Telecom Italia SpA	EUR	1,625 %	18/01/2029	104.499	0,0
	Telecom Italia SpA 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,303 %	30/05/2024	284.969	0,0
200.000	UniCredit SpA <sup>(d)</sup>	USD	5,459 %	30/06/2035	219.685	0,0
					919.221	0,1
Liberia 45.000	Royal Caribbean Cruises Ltd.	USD	5,250 %	15/11/2022	46.069	0,0
Luxemburgo	•					
	Altice Financing S.A.	USD	5,000 %	15/01/2028	189.500	0,0
600.000	Altice Financing S.A.	EUR	4,250 %	15/08/2029	658.082	0,1
400.000	ARD Finance S.A.	USD	6,500 %	30/06/2027	414.000	0,0
200.000	Herens Holdco SARL 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/05/2028	198.250	0,0
220.000	Intelsat Jackson Holdings S.A.	USD	5,500 %	01/08/2023	110.000	0,0
100.000	Kleopatra Holdings 2 S.C.A.	EUR	6,500 %	01/09/2026	98.221	0,0
100.000	Lincoln Financing SARL	EUR _	3,625 %	01/04/2024	114.240	0,0
					1.782.293	0,3
México 200.000	Cemex SAB de CV	USD	5,200 %	17/09/2030	210.765	0,0
Países Bajos						
-	AerCap Holdings NV <sup>(d)</sup>	USD	5,875 %	10/10/2079	156.785	0,0
	ING Groep NV <sup>(d)</sup>	USD	6,500 %	Perp.	217.750	0,0
	Telefonica Europe BV <sup>(d)</sup>	EUR	5,875 %	Perp.	124.828	0,0
	United Group BV	EUR	3,125 %	15/02/2026	109.391	0,0
	Ziggo Bond Co. BV	EUR	3,375 %	28/02/2030	110.882	0,0
	Ziggo BV	USD	4,875 %	15/01/2030	202.000	0,0
		-			921.636	0,1
España						
200.000	Banco Santander S.A.	USD	3,490 %	28/05/2030	211.690	0,0
640.000	Lorca Telecom Bondco S.A.	EUR	4,000 %	18/09/2027	736.475	0,1
150.000	Telefonica Emisiones S.A.	USD	4,103 %	08/03/2027	166.049	0,0
					1.114.214	0,2
Supranacional						
	American Airlines, Inc. Via AAdvantage Loyalty IP Ltd.	USD	5,500 %	20/04/2026	30.738	0,0
	American Airlines, Inc. Via AAdvantage Loyalty IP Ltd.	USD	5,750 %	20/04/2029	61.966	0,0
210.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC Via Ardagh Metal Packaging Finance Plc.	EUR	3,000 %	01/09/2029	233.314	0,0
200.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC Via Ardagh Metal Packaging					
	Finance Plc.	USD	4,000 %	01/09/2029	193.875	0,0
	Clarios Global LP Via Clarios US Finance Co.	USD	8,500 %	15/05/2027	119.255	0,0
	Herbalife Nutrition Ltd. Via HLF Financing, Inc.	USD	7,875 %	01/09/2025	44.573	0,0
	JBS USA LUX S.A. Via JBS USA Food Co. Via JBS USA Finance, Inc.	USD	5,500 %	15/01/2030	176.710	0,0
19.000	Titan Acquisition Ltd. Via Titan Co-Borrower LLC	USD -	7,750 %	15/04/2026	19.024	0,0
					879.455	0,1
Suecia 175 000	Verisure Holding AB	EUR	3,250 %	15/02/2027	198.269	0,0
	Verisure Midholding AB	EUR	5,250 %	15/02/2029	290.059	0,0
		-	,		488.328	0,0
Suiza						
200.000	Credit Suisse Group AG <sup>(d)</sup>	USD	5,250 %	Perp.	205.000	0,0
595.000	Credit Suisse Group AG 144A(c)(d)	USD	5,250 %	Perp.	609.875	0,1
		-			814.875	0,1
Reino Unido						
200 000	Anglo American Capital Plc.	USD	4,750 %	10/04/2027	223.784	0,0
200.000				16/02/2026	126 644	0.0
	Bellis Acquisition Co., Plc.	GBP	3,250 %	16/02/2026	126.644	0,0
100.000	Bellis Acquisition Co., Plc. eG Global Finance Plc.	GBP USD	3,250 % 6,750 %	07/02/2025	288.563	0,0

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
	(continuación)					
	Natwest Group Plc.(d)	USD	3,754 %	01/11/2029	422.052	0,08
	Rolls-Royce Plc.	USD	5,750 %	15/10/2027	219.500	0,04
	Standard Chartered Plc.(d)	USD	4,750 %	Perp.	468.600	0,08
	TechnipFMC Plc.	USD	6,500 %	01/02/2026	249.400	0,05
238.000	Vmed O2 UK Financing I Plc.	USD -	4,250 %	31/01/2031	227.885	0,04
	_				2.338.749	0,42
Estados Unido	AbbVie, Inc.	USD	4,250 %	14/11/2028	365.989	0,07
	AbbVie, Inc.	USD	3,200 %	21/11/2029	818.795	0,07
	Acadia Healthcare Co., Inc.	USD	5,000 %	15/04/2029	30.563	0,01
	Acrisure LLC Via Acrisure Finance, Inc.	USD	10,125 %	01/08/2026	166.510	0,03
	Acrisure LLC Via Acrisure Finance, Inc.	USD	4,250 %	15/02/2029	112.950	0,02
	AdaptHealth LLC	USD	6,125 %	01/08/2028	47.813	0,02
	·	USD		01/08/2029	24.438	0,00
	AdaptHealth LLC Air Lease Corp.	USD	4,625 % 3,750 %	01/06/2029	346.239	0,00
	Air Lease Corp. – Serie B <sup>(d)</sup>	USD	4,650 %		77.625	0,00
	Albertsons Cos., Inc. Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via	03D	4,050 %	Perp.	77.025	0,01
341 000	Albertsons LLC Albertsons Cos., Inc. Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via	USD	5,875 %	15/02/2028	21.075	0,00
	Albertsons LLC	USD	3,500 %	15/03/2029	339.295	0,06
25.000	Albertsons Cos., Inc. Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via Albertsons LLC	USD	4,875 %	15/02/2030	26.563	0,01
124.000	Albertsons Cos., Inc. Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via					
	Albertsons LLC – Serie JAN	USD	4,625 %	15/01/2027	128.805	0,02
	Alliant Holdings Intermediate LLC Via Alliant Holdings Co-Issuer	USD	6,750 %	15/10/2027	75.709	0,01
	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp.	USD	6,625 %	15/07/2026	89.828	0,02
	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp.	USD	9,750 %	15/07/2027	36.772	0,01
	Ally Financial, Inc.	USD	8,000 %	01/11/2031	141.832	0,03
	Ally Financial, Inc. – Serie C <sup>(d)</sup>	USD	4,700 %	Perp.	933.300	0,17
	AMC Networks, Inc.	USD	4,750 %	01/08/2025	123.193	0,02
	American International Group, Inc.	USD	3,400 %	30/06/2030	81.364	0,01
	American Tower Corp.	USD	3,950 %	15/03/2029	82.282	0,02
	American Tower Corp.	USD	2,100 %	15/06/2030	413.944	0,07
	AmeriGas Partners LP Via AmeriGas Finance Corp.	USD	5,875 %	20/08/2026	136.250	0,02
	Anheuser-Busch Cos. LLC Via Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	USD	4,700 %	01/02/2036	362.178	0,07
	Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	USD	4,700 %	01/02/2036	241.788	0,04
	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	USD	4,750 %	23/01/2029	589.345	0,11
	Aramark Services, Inc.	USD	6,375 %	01/05/2025	21.998	0,00
	Arches Buyer, Inc.	USD	6,125 %	01/12/2028	16.240	0,00
	Arcosa, Inc.	USD	4,375 %	15/04/2029	230.121	0,04
	AssuredPartners, Inc.	USD	5,625 %	15/01/2029	24.313	0,00
	AT&T, Inc.	USD	2,300 %	01/06/2027	494.593	0,09
	AT&T, Inc.	USD	4,100 %	15/02/2028	83.762	0,02
	AT&T, Inc.	USD	2,750 %	01/06/2031	457.942	0,08
	AT&T, Inc.	USD	5,250 %	01/03/2037	186.706	0,03
	AT&T, Inc.	USD	3,500 %	01/06/2041	154.806	0,03
	Austin BidCo, Inc.	USD	7,125 %	15/12/2028	143.325	0,03
	AutoNation, Inc.	USD	4,750 %	01/06/2030	412.372	0,07
	Avaya, Inc.	USD	6,125 %	15/09/2028	144.900	0,03
	Avis Budget Car Rental LLC Via Avis Budget Finance, Inc.	USD	5,375 %	01/03/2029	93.150	0,02
	Axalta Coating Systems LLC	USD	3,375 %	15/02/2029	161.817	0,03
	B&G Foods, Inc.	USD	5,250 %	15/09/2027	154.539	0,03
	Bank of America Corp. (d)	USD	4,083 %	20/03/2051	61.049	0,01
	Bank of America Corp. – Serie L	USD	4,183 %	25/11/2027	384.086	0,07
	Bank of America Corp. – Serie X <sup>(d)</sup>	USD	6,250 %	Perp.	133.550	0,02
	BAT Capital Corp.	USD	4,390 %	15/08/2037	132.932	0,02
	Becton Dickinson and Co.	USD	2,823 %	20/05/2030	181.440	0,03
	Berry Global, Inc.	USD	5,625 %	15/07/2027	155.625	0,03
	Black Knight InfoServ LLC	USD	3,625 %	01/09/2028	63.375	0,01
	Boeing Co.	USD	3,450 %	01/11/2028	625.607	0,11
	Boeing Co.	USD	5,150 %	01/05/2030	350.099	0,06
	Boeing Co.	USD	5,805 %	01/05/2050	150.485	0,03
	Booking Holdings, Inc.	USD	4,625 %	13/04/2030	109.139	0,02
	Booz Allen Hamilton, Inc.	USD	3,875 %	01/09/2028	85.316	0,02
	BorgWarner, Inc.	USD	5,000 %	01/10/2025	112.599	0,02
	Broadcom, Inc.	USD	4,150 %	15/11/2030	130.764	0,02
160.000	Buckeye Partners LP	USD	4,350 %	15/10/2024	165.600	0,03
277.000	Buckeye Partners LP	USD	3,950 %	01/12/2026	277.000	0,05
	Buckeye Partners LP	USD	4,125 %	01/12/2027	697.375	0,13
700.000	Duckeye i aithers Li					

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos – (con	<u> </u>	211.00			5 552	
•	s – (continuación)					
	Builders FirstSource, Inc.	USD	5,000 %	01/03/2030	108.375	0,02
	BWX Technologies, Inc.	USD	4,125 %	30/06/2028	34.000	0,01
	BWX Technologies, Inc.	USD	4,125 %	15/04/2029 01/02/2026	252.630	0,05
	California Resources Corp. Calpine Corp.	USD USD	7,125 % 3,750 %	01/02/2026	104.000 168.437	0,02 0,03
	Carrier Global Corp. – Serie WI	USD	2,722 %	15/02/2030	128.169	0,03
	Carvana Co.	USD	5,500 %	15/04/2027	70.202	0,01
75.000	Castle US Holding Corp.	USD	9,500 %	15/02/2028	79.688	0,01
60.000	Catalent Pharma Solutions, Inc.	USD	1,632 %	18/03/2034	57.450	0,01
	CCO Holdings LLC Via CCO Holdings Capital Corp. – Serie DEC	USD	4,750 %	01/03/2030	92.025	0,02
	CDW LLC Via CDW Finance Corp.	USD	4,125 %	01/05/2025	49.320	0,01
	Centene Corp.	USD USD	4,250 %	15/12/2027 15/10/2030	280.765 169.838	0,05 0,03
	Centene Corp. Centene Corp.	USD	3,000 % 2,500 %	01/03/2031	187.935	0,03
	Central Garden & Pet Co.	USD	4,125 %	15/10/2030	55.344	0,01
	Charles Schwab Corp. – Serie E <sup>(d)</sup>	USD	4,625 %	Perp.	59.929	0,01
175.000	Charles Schwab Corp. – Serie I <sup>(d)</sup>	USD	4,000 %	Perp.	176.235	0,03
400.000	Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications					
00.000	Operating Capital	USD	6,384 %	23/10/2035	519.988	0,09
	Cheesecake Factory, Inc.	USD	0,375 %	15/06/2026	32.837	0,01
	Cheniere Energy Partners LP Chesapeake Energy Corp.	USD USD	4,500 % 5,500 %	01/10/2029	916.690 5.225	0,17
	Chesapeake Energy Corp.  Chesapeake Energy Corp.	USD	5,875 %	01/02/2026 01/02/2029	5.288	0,00 0,00
	Chobani LLC Via Chobani Finance Corp., Inc.	USD	7,500 %	15/04/2025	51.630	0,01
	Cigna Corp.	USD	2,400 %	15/03/2030	276.334	0,05
	Cincinnati Bell, Inc.	USD	7,000 %	15/07/2024	157.712	0,03
100.000	CIT Group, Inc.	USD	5,250 %	07/03/2025	109.375	0,02
450.000	Citigroup, Inc.	USD	4,125 %	25/07/2028	496.444	0,09
	Citigroup, Inc. (d)	USD	4,412 %	31/03/2031	57.166	0,01
	Citigroup, Inc. – Serie T <sup>(d)</sup>	USD	6,250 %	Perp.	113.250	0,02
	Citrix Systems, Inc.	USD	3,300 %	01/03/2030	152.302	0,03
	Cleveland-Cliffs, Inc. CoBank ACB – Serie I <sup>(d)</sup>	USD USD	4,875 %	01/03/2031	60.375 111.384	0,01 0,02
	Comcast Corp.	USD	6,250 % 2,800 %	Perp. 15/01/2051	88.084	0,02
	CommScope Technologies LLC	USD	6,000 %	15/06/2025	58.170	0,02
	CommScope, Inc.	USD	7,125 %	01/07/2028	65.450	0,01
	Compass Group Diversified Holdings LLC	USD	5,250 %	15/04/2029	75.190	0,01
75.000	Constellation Brands, Inc.	USD	2,875 %	01/05/2030	77.140	0,01
	Constellation Brands, Inc.	USD	2,250 %	01/08/2031	1.026.217	0,18
	Continental Resources, Inc.	USD	5,750 %	15/01/2031	128.287	0,02
	Cornerstone Building Brands, Inc.	USD	6,125 %	15/01/2029	50.520	0,01
	Covanta Holding Corp. CP Atlas Buyer, Inc.	USD USD	5,000 % 7,000 %	01/09/2030 01/12/2028	25.219 451.050	0,00 0,08
	Crown Castle International Corp.	USD	3,650 %	01/09/2027	410.240	0,08
	Crown Castle International Corp.	USD	3,300 %	01/07/2030	131.729	0,07
	CVS Health Corp.	USD	3,750 %	01/04/2030	175.926	0,03
230.000	Dana, Inc.	USD	4,250 %	01/09/2030	231.006	0,04
50.000	DaVita, Inc.	USD	4,625 %	01/06/2030	49.500	0,01
	DaVita, Inc.	USD	3,750 %	15/02/2031	308.657	0,06
	Dealer Tire LLC Via DT Issuer LLC	USD	8,000 %	01/02/2028	127.100	0,02
	Dealer Tire LLC Via DT Issuer LLC – Serie DEC	USD	8,000 %	01/02/2028	59.450	0,01
	Dell International LLC Via EMC Corp. Dell International LLC Via EMC Corp.	USD USD	6,020 % 6,200 %	15/06/2026 15/07/2030	644.088 419.938	0,12 0,08
	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	8,100 %	15/07/2036	191.464	0,08
	Delta Air Lines, Inc.	USD	7,375 %	15/01/2026	679.452	0,03
	Diamond Sports Group LLC Via Diamond Sports Finance Co.	USD	5,375 %	15/08/2026	44.500	0,01
	Diamond Sports Group LLC Via Diamond Sports Finance Co.	USD	6,625 %	15/08/2027	11.413	0,00
33.000	Diamondback Energy, Inc.	USD	4,750 %	31/05/2025	36.268	0,01
	DISH DBS Corp.	USD	5,875 %	15/07/2022	133.897	0,02
	DISH DBS Corp.	USD	7,750 %	01/07/2026	128.437	0,02
	DISH DBS Corp.	USD	7,375 %	01/07/2028	627.779	0,11
	DISH DBS Corp.  Dycom Industries, Inc.	USD USD	5,125 % 4,500 %	01/06/2029 15/04/2029	636.337 264.292	0,11 0,05
	Element Solutions, Inc.	USD	3,875 %	01/09/2028	44.438	0,03
	Endure Digital, Inc.	USD	5,875 % 6,000 %	15/02/2029	151.290	0,01
	Energizer Holdings, Inc.	USD	4,750 %	15/06/2028	147.991	0,03
	Energy Transfer LP	USD	5,500 %	01/06/2027	286.945	0,05
	Energy Transfer Operating LP	USD	5,250 %	15/04/2029	286.177	0,05
	Enviva Partners LP Via Enviva Partners Finance Corp.	USD	6,500 %	15/01/2026	116.443	0,02
	Expedia Group, Inc.	USD	4,625 %	01/08/2027	352.828	0,06
125.000	Expedia Group, Inc.	USD	3,800 %	15/02/2028	134.055	0,02

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con		DIVISU	interes	T cond de venennento	cii cob	patrimonio
•	umuacion) is – (continuación)					
	Expedia Group, Inc.	USD	3,250 %	15/02/2030	515.000	0,09
	Expedia Group, Inc.	USD	2,950 %	15/03/2031	156.499	0,03
	Fair Isaac Corp.	USD	4,000 %	15/06/2028	121.303	0,02
	Fidelity & Guaranty Life Holdings, Inc.	USD	5,500 %	01/05/2025	124.976	0,02
	Ford Motor Co.	USD	3,250 %	12/02/2032	1.349.322	0,24
	Ford Motor Credit Co., LLC Ford Motor Credit Co., LLC	USD USD	3,375 % 2,700 %	13/11/2025 10/08/2026	225.636 1.249.650	0,04 0,23
	Ford Motor Credit Co., LLC	USD	4,125 %	17/08/2027	211.965	0,23
	Ford Motor Credit Co., LLC	USD	3,815 %	02/11/2027	221.475	0,04
	Ford Motor Credit Co., LLC	USD	2,900 %	16/02/2028	388.576	0,07
86.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC – Serie DEC	USD	6,500 %	01/10/2025	88.043	0,02
	Foundation Building Materials, Inc.	USD	6,000 %	01/03/2029	43.313	0,01
	Freedom Mortgage Corp.	USD	7,625 %	01/05/2026	240.285	0,04
	Frontier Communications Holdings LLC	USD	5,875 %	15/10/2027	29.033	0,01
	Frontier Communications Holdings LLC	USD USD	5,000 %	01/05/2028 01/07/2028	37.000 166.400	0,01 0,03
	Gartner, Inc. Gartner, Inc.	USD	4,500 % 3,750 %	01/10/2030	100.500	0,03
	General Electric Co.	USD	6,750 %	15/03/2032	827.169	0,15
	General Electric Co. – Serie D <sup>(d)</sup>	USD	3,446 %	Perp.	303.044	0,05
	General Motors Co.	USD	6,600 %	01/04/2036	135.451	0,02
125.000	General Motors Co.	USD	6,750 %	01/04/2046	181.686	0,03
765.000	General Motors Financial Co., Inc.	USD	5,650 %	17/01/2029	911.689	0,16
110.000	Genesis Energy LP Via Genesis Energy Finance Corp.	USD	8,000 %	15/01/2027	110.275	0,02
	Genesis Energy LP Via Genesis Energy Finance Corp.	USD	7,750 %	01/02/2028	93.456	0,02
	Getty Images, Inc.	USD	9,750 %	01/03/2027	275.681	0,05
	Global Partners LP Via GLP Finance Corp.	USD	6,875 %	15/01/2029	597.575	0,11
	Go Daddy Operating Co., LLC Via GD Finance Co., Inc.	USD	5,250 %	01/12/2027 01/03/2029	144.212	0,03
	Go Daddy Operating Co., LLC Via GD Finance Co., Inc. Goodyear Tire & Rubber Co.	USD USD	3,500 % 9,500 %	31/05/2025	223.097 286.947	0,04 0,05
	Graphic Packaging International LLC	USD	3,500 %	15/03/2028	20.075	0,00
	Gray Television, Inc.	USD	7,000 %	15/05/2027	204.120	0,04
	Griffon Corp.	USD	5,750 %	01/03/2028	134.225	0,02
	GrubHub Holdings, Inc.	USD	5,500 %	01/07/2027	206.550	0,04
35.000	H&E Equipment Services, Inc.	USD	3,875 %	15/12/2028	34.169	0,01
106.000	Harley-Davidson Financial Services, Inc.	USD	3,350 %	08/06/2025	111.683	0,02
204.000	HCA, Inc.	USD	5,875 %	15/02/2026	228.480	0,04
	Herc Holdings, Inc.	USD	5,500 %	15/07/2027	145.075	0,03
	Hewlett Packard Enterprise Co.	USD	4,900 %	15/10/2025	540.372	0,10
	Hewlett Packard Enterprise Co.	USD	6,200 %	15/10/2035	296.865	0,05
	Hexion, Inc. Hilcorp Energy I LP Via Hilcorp Finance Co.	USD USD	7,875 % 6,000 %	15/07/2027 01/02/2031	106.125 115.575	0,02 0,02
	Hillenbrand, Inc.	USD	3,750 %	01/03/2031	1.279.800	0,02
	Hilton Domestic Operating Co., Inc.	USD	4,000 %	01/05/2031	149.034	0,03
	Home Depot, Inc.	USD	3,350 %	15/04/2050	44.465	0,01
	Howard Hughes Corp.	USD	5,375 %	01/08/2028	56.565	0,01
100.000	HUB International Ltd.	USD	7,000 %	01/05/2026	102.625	0,02
115.000	IAA, Inc.	USD	5,500 %	15/06/2027	119.313	0,02
	Icahn Enterprises LP Via Icahn Enterprises Finance Corp.	USD	4,750 %	15/09/2024	247.860	0,04
	Icahn Enterprises LP Via Icahn Enterprises Finance Corp.	USD	4,375 %	01/02/2029	597.123	0,11
	iHeartCommunications, Inc.	USD	8,375 %	01/05/2027	515.725	0,09
	Ingevity Corp.	USD	4,500 %	01/02/2026	135.675	0,02
	IRB Holding Corp.	USD USD	3,875 % 6,750 %	01/11/2028 15/02/2026	48.000 168.122	0,01 0,03
	Iron Mountain, Inc.	USD	5,250 %	15/07/2030	239.850	0,03
	JPMorgan Chase & Co.(d)	USD	2,956 %	13/05/2031	403.638	0,07
	JPMorgan Chase & Co. – Serie X <sup>(d)</sup>	USD	6,100 %	Perp.	132.300	0,02
	JPMorgan Chase & Co. – Serie Z <sup>(d)</sup>	USD	3,932 %	Perp.	75.200	0,01
45.000	KBR, Inc.	USD	4,750 %	30/09/2028	46.238	0,01
	Ken Garff Automotive LLC	USD	4,875 %	15/09/2028	194.512	0,04
	Kennedy-Wilson, Inc.	USD	4,750 %	01/02/2030	1.124.756	0,20
	Keurig Dr Pepper, Inc.	USD	4,597 %	25/05/2028	1.258.950	0,23
	Keurig Dr Pepper, Inc.	USD	3,200 %	01/05/2030	36.119	0,01
	Keurig Dr Pepper, Inc. Kinder Morgan Energy Partners LP	USD	3,800 %	01/05/2050	11.241 280.256	0,00
	Kinder Morgan Energy Partners LP Kraft Heinz Foods Co.	USD USD	7,300 % 5,000 %	15/08/2033 15/07/2035	1.165.045	0,05 0,21
	Kraft Heinz Foods Co.	USD	4,375 %	01/06/2046	334.337	0,21
	LABL Escrow Issuer LLC	USD	6,750 %	15/07/2026	118.594	0,00
	Ladder Capital Finance Holdings LLLP Via Ladder Capital Finance Corp.	USD	4,250 %	01/02/2027	46.648	0,02
	LD Holdings Group LLC	USD	6,500 %	01/11/2025	72.750	0,01
	LD Holdings Group LLC	USD	6,125 %	01/04/2028	101.406	0,02
142.000	Level 3 Financing, Inc.	USD	3,750 %	15/07/2029	132.592	0,02

Part				Tipo de		Valor de mercado	% del
	Tenencias	Descripción del valor	Divisa		Fecha de vencimiento(b)		
1000   Liferion Health, Inc.   USD   3,770 %   15010229   38.700 0.01	Bonos - (con	tinuación)					
40.000   Low Nation Entiretiamment, Inc.		,					
151.000   Lower & Cos., Inc.   USD							
1811.000   Luman Technologies, Inc Serie U				.,			
120.000 MH homes, Inc.   USD							
Section   Sect		•					
111000   Marke Croop treakings ILLC		·					
117:00   Martel, Inc.	189.000	Marriott Ownership Resorts, Inc.	USD	4,750 %	15/01/2028	190.654	0,03
2000   Marie, Inc.							
300.000 MDC Holdings, Inc.							
175.000   Mercer International, Inc.   USD   5,125 %   1010/2029   174.024   0.03   369.000   Memics, Inc.   USD   6,260 %   1016/2029   361.800   0.07   150.000   Memics, Inc.   USD   4,260 %   1517/2028   151.125   0.03   369.000   MM Circvist   15.075   0.00   0.07   15.000   Memics, Inc.   USD   4,500 %   1517/2028   151.125   0.03   15.000   Memics, Inc.   USD   4,500 %   1517/2028   151.125   0.03   15.000   Memics, Inc.   USD   4,700 %   1517/2028   12.45.405   0.21   17.000   Minerals Technologies, Inc.   USD   4,700 %   1517/2028   12.45.405   0.21   17.000   Minerals Technologies, Inc.   USD   3,960 %   1010/2028   12.45.405   0.21   17.000   Minerals Technologies, Inc.   USD   3,960 %   2.044/2077   1.071.934   0.19   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1.000   1							
35.000   Mentinge Homes Corp.   USD   3.775 %   1504-0209   501-000   0.075							
15:000   Membric Inc.   USD   4,500 %   15/16/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208   15/17/208		•					
150.000   Mentior, Inc.   USD   4,500 %   151/22028   151.125   0.03							
Colsauer, Inc.							
1218.000 MMR Resorts International	35.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP Via MGP Finance					
173.000 Minerals Technologies, Inc.		·		•			
88,000 Morgan Stanley — Serie H <sup>(1)</sup> USD 3,74 % Perp. 88,220 0,020   145,000 MPH Acquisition Holdings LLC USD 5,750 % 0111/2028 129,566 0,020   1150,000 MPH Acquisition Holdings LLC USD 5,750 % 0111/2028 129,566 0,020   1150,000 MPT Operating Partnership LP Vis MPT Finance Corp. USD 4,625 % 01068/2039 114,0167 0,21   157,000 MPT Operating Partnership LP Vis MPT Finance Corp. USD 4,625 % 01068/2039 164,660 0,03   175,000 MPT Operating Partnership LP Vis MPT Finance Corp. USD 3,750 % 150/32/2011 109,303 0,022   55,000 Murpy Ob USA, Inc. USD 3,750 % 150/32/2011 109,303 0,022   150,000 Authoris Industries. Inc. USD 3,750 % 150/32/2013 109,303 0,022   150,000 Authoris Industries. Inc. USD 3,750 % 150/32/2013 109,303 0,022   150,000 Authoris Industries Inc. USD 3,750 % 150/32/2013 109,303 0,022   150,000 Authoris Industries Inc. USD 3,750 % 150/32/2013 109,303 0,022   150,000 Authoris Industries Inc. USD 5,000 % 010/20/2025 148,100 0,03   150,000 Authoris Industries Inc. USD 5,000 % 150/32/2013 104,758 0,027   170,300 Authoris Industries Inc. USD 5,500 % 150/32/2013 104,758 0,027   170,300 Authoris Corp. USD 5,500 % 150/42/202 104,758 0,027   170,300 Authoris Corp. USD 5,500 % 150/42/202 309,907 0,06   3,900 N ESCO Holdings II, Inc. USD 5,500 % 150/42/202 309,907 0,06   3,900 N ESCO Holdings II, Inc. USD 5,500 % 150/42/202 309,907 0,06   3,900 N ESCO Holdings II, Inc. USD 5,500 % 150/42/202 309,907 0,06   150/000 Norwell Brands, Inc. USD 5,500 % 150/42/202 309,907 0,06   150/000 Norwell Brands, Inc. USD 5,000 % 100/42/202 309,907 0,06   150/000 Norwell Brands, Inc. USD 5,000 % 100/42/202 309,907 0,06   150/000 Norwell Brands, Inc. USD 5,000 % 100/42/202 114,000 0,000   150/000 Norwell Brands, Inc. USD 5,000 % 150/42/202 114,000 0,000   150/000 Norwell Brands, Inc. USD 5,000 % 150/42/202 115,000 0,000   150/000 Norwell Brands, Inc. USD 6,000 % 150/42/202 115,000 0,000   150/000 Norwell Brands, Inc. USD 7,500 % 150/42/202 115,000 0,000   150/000 Norwell Brands, Inc. USD 7,500 % 150/42/203 115,000 0,000   150/000 Norwel							
88.000 Morgan Stanley — Serie Hi <sup>(0)</sup>		•		•			
145.000 MPH Acqualition Holdings LLC							
1.150.000 MPLX LP 157.000 MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp. 157.000 MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp. 157.000 MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp. 157.000 MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp. 157.000 MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp. 157.000 Mpr Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp. 157.000 Murphy Oil USA. Inc. 157.0000 Murphy Oil USA. Inc. 157.000 Murphy Oil U					•		
157,000 MPT Operating Partnership LP Vis MPT Finance Corp.  GBP 3,375 % 01/08/2029 164,660 0.03 175,000 MPT Operating Partnership LP Vis MPT Finance Corp.  USD 3,500 % 15/03/2031 100,303 0.02 241,116 0.04 110,000 MPT Operating Partnership LP Vis MPT Finance Corp.  USD 3,500 % 15/03/2031 100,303 0.02 155,000 Multiply Oil USA, 164,000 % 15/02/2025 144,100 0.03 340,000 Nationst industries, Inc.  USD 9,000 % 01/02/2025 144,100 0.03 340,000 Nationstar Mortgage Ploidings, Inc.  USD 5,500 % 25/01/2023 104,788 0.02 111,000 Navient Corp.  USD 4,576 % 25/01/2023 104,788 0.02 111,000 Navient Corp.  USD 4,576 % 15/03/2028 401,782 0,077 703,000 Navient Corp.  USD 4,576 % 15/03/2028 401,782 0,077 703,000 Navient Corp.  USD 5,500 % 15/03/2029 684,606 0.13 302,000 NCR Corp.  USD 5,500 % 15/04/2029 306,907 0.06 39,000 Nevell Brands, Inc.  USD 5,500 % 15/04/2029 40,073 0.01 139,000 Nevell Brands, Inc.  USD 5,500 % 15/04/2029 40,073 0.01 139,000 Nevell Brands, Inc.  USD 6,000 % 01/04/2026 148,813 0.03 129,000 Nevell Brands, Inc.  USD 6,000 % 01/04/2026 148,813 0.03 129,000 Nevell Brands, Inc.  USD 6,000 % 01/04/2026 148,813 0.03 129,000 Note Corp. Series EEP  USD 6,076 % 15/07/2027 115,440 0.02 111,000 NFP Corp. Series EEP  USD 6,076 % 15/07/2027 115,440 0.02 115,000 NGL Energy Partners LP Via NGL Energy Finance Corp.  USD 7,500 % 01/14/2023 151,845 0.03 159,000 Note Corp.  USD 7,500 % 01/14/2023 151,845 0.03 159,000 Note Corp.  USD 7,500 % 01/14/2023 151,845 0.03 159,000 Note Corp.  USD 7,500 % 01/14/2023 151,845 0.03 159,000 Note Corp.  USD 7,500 % 01/14/2023 151,845 0.03 159,000 Note Corp.  USD 7,500 % 01/14/2023 151,845 0.03 159,000 Note Corp.  USD 7,500 % 01/14/2023 151,845 0.03 159,000 Note Corp.  USD 7,500 % 01/14/2023 151,845 0.03 159,000 Note Corp.  USD 7,500 % 01/14/2023 151,845 0.03 159,000 Note Corp.  USD 7,500 % 01/14/2023 151,845 0.03 159,000 Note Corp.  USD 7,500 % 01/14/2023 151,845 0.03 159,000 Note Corp.  USD 7,500 % 01/14/2023 151,845 0.03 159,000 Note Corp.  USD 7,500 % 01/14/2023 151,845 0.03 159,000 Note Cor							
175.000 MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.							
10.000 MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.							
145.000 Nabors Industries, Inc.			USD			109.303	0,02
94.00   Nationstar Mortgage Holdings, Inc.	55.000	Murphy Oil USA, Inc.	USD	3,750 %	15/02/2031	53.144	0,01
101 000   Navient Corp.   USD   5.500 %   25.01/2023   104.788   0.02   411.000   Navient Corp.   USD   5.500 %   15/03/2028   401.752   0.07   703.000   Navient Corp.   USD   5.500 %   15/03/2029   608.606   0.13   302.000   NESCO Holdings II, Inc.   USD   5.125 %   15/04/2029   306.907   0.06   30.000   NESCO Holdings II, Inc.   USD   5.500 %   15/04/2029   40.073   0.01   139.000   Newell Brands, Inc.   USD   4.700 %   0.164/2029   40.073   0.01   139.000   Newell Brands, Inc.   USD   4.700 %   0.164/2026   148.813   0.03   129.000   Newell Brands, Inc.   USD   5.625 %   15/04/2026   148.813   0.03   111.000   Nexstar Broadcasting, Inc.   USD   5.625 %   15/07/2027   115.440   0.02   111.000   Nexstar Broadcasting, Inc.   USD   5.625 %   15/07/2027   115.440   0.02   111.000   Nexstar Broadcasting, Inc.   USD   5.625 %   15/07/2027   115.440   0.02   115.000   NCE Lenergy Prinance Corp.   USD   7.500 %   0.102/2026   115.719   0.02   115.000   NCE Lenergy Prinance Corp.   USD   7.500 %   0.102/2026   115.719   0.02   115.000   Notron. Intel. ook, Inc.   USD   5.000 %   15/04/2025   151.429   0.03   15.000   Notron. Intel. ook, Inc.   USD   5.000 %   15/04/2025   151.429   0.03   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000   17.000	145.000	Nabors Industries, Inc.		9,000 %	01/02/2025	148.100	0,03
411.00   Navient Corp.   USD   4,875 %   150/3/2028   401.752   0.07							
302.000   Navient Corp.		·					
302.00 NCR Corp.		•					
39.000 NESCO Holdings II, Inc.		•					
139,000   Newell Brands, Inc.							
129.000   Newslat Broadcasting, Inc.   USD   6,000 %   01/04/2046   160,605   0.03   111.000   Newstata Broadcasting, Inc.   USD   5,625 %   15/07/2027   115,440   0.02   111.000   NFP Corp Serie SEP   USD   6,875 %   15/08/2028   110,168   0.02   115.000   NGL Energy Partners LP Via NGL Energy Finance Corp.   USD   7,500 %   01/02/2026   115,719   0.02   159,000   NGL Energy Partners LP Via NGL Energy Finance Corp.   USD   7,500 %   01/01/2025   151,429   0.03   150,000   NortonLifeLock, Inc.   USD   5,000 %   15/04/2025   151,429   0.03   317,000   Novells Corp.   USD   5,750 %   15/01/2028   26,375   0.00   25,000   NRG Energy, Inc.   USD   5,750 %   15/01/2028   26,375   0.00   25,000   NRG Energy, Inc.   USD   3,375 %   15/01/2028   26,375   0.00   0.00   NRG Energy, Inc.   USD   3,375 %   15/01/2028   26,375   0.00   0.00   NRG Energy, Inc.   USD   3,375 %   15/01/2028   17,625   0.01   112,000   Nuance Communications, Inc.   USD   3,625 %   15/01/2026   115,229   0.02   1.10   1.000   Nustar Logistics LP   USD   5,625 %   15/01/2026   115,229   0.02   1.10   1.000   Nustar Logistics LP   USD   6,625 %   15/01/2026   115,229   0.02   1.10   1.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.00		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					
111.000   Nexstar Broadcasting, Inc.   USD   5,825 %   15/07/2027   115,440   0.02   111.000   NFP Corp. — Serie SEP   USD   6,875 %   15/08/2028   110,1168   0.02   115,000   NGL Energy Operating LLC Via NGL Energy Finance Corp.   USD   7,500 %   01/10/2026   115,719   0.02   159,000   NGL Energy Partners LP Via NGL Energy Finance Corp.   USD   7,500 %   01/11/2023   151,845   0.03   150,000   NortenLifetock, Inc.   USD   5,000 %   15/04/2025   151,429   0.03   317,000   NortenLifetock, Inc.   USD   4,750 %   30/01/2030   321,755   0.06   25,000   NRG Energy, Inc.   USD   4,750 %   30/01/2030   321,755   0.06   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.00   0.0							
115,000   NGL Energy Operating LLC Via NGL Energy Finance Corp.   USD   7,500 %   01/02/2026   115,719   0.02			USD			115.440	0,02
159,000 NGL Energy Partners LP Via NGL Energy Finance Corp.	111.000	NFP Corp. – Serie SEP	USD	6,875 %	15/08/2028	110.168	0,02
150.000   NortonLifeLock, Inc.   USD   5,000 %   15/04/2025   151.429   0,03   317.000   Novelis Corp.   USD   4,750 %   30/01/2030   321.755   0,06   25.000   NRG Energy, Inc.   USD   5,750 %   15/01/2028   26.375   0,00   20.000   NRG Energy, Inc.   USD   3,375 %   15/02/2029   19.400   0,00   20.000   NRG Energy, Inc.   USD   3,625 %   15/02/2029   19.400   0,00   20.000   NRG Energy, Inc.   USD   3,625 %   15/02/2031   47.625   0,01   112.000   Nuance Communications, Inc.   USD   5,625 %   15/12/2026   115.229   0,02   1.010.000   Nustra Logistics LP   USD   6,375 %   0,11/10/2030   1.775.317   0,21   44.000   Cocidental Petroleum Corp.   USD   6,375 %   0,11/10/2030   7.175.317   0,21   45.000   Cocidental Petroleum Corp.   USD   6,625 %   0,109/2030   7.10.525   0,13   100.000   0 neMain Finance Corp.   USD   7,125 %   15/03/2026   112.625   0,02   49.000   0 neMain Finance Corp.   USD   4,000 %   15/09/2030   903.787   0,16   48.000   Oracle Corp.   USD   4,000 %   15/09/2030   903.787   0,16   48.000   Oracle Corp.   USD   4,000 %   15/09/2030   903.787   0,16   48.000   Oracle Corp.   USD   3,600 %   0,104/2050   48.931   0,01   10.000   0 Unifront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp.   USD   3,600 %   0,104/2050   48.931   0,01   10.000   0 News-Brockway Glass Container, Inc.   USD   5,875 %   15/08/2023   105.000   0,02   49.000   Pacific Gas and Electric Co   USD   3,500 %   0,108/2050   46.743   0,01   452.000   Pacific Gas and Electric Co   USD   8,375 %   15/08/2023   105.000   0,02   452.000   Pacific Gas and Electric Co   USD   8,375 %   15/08/2023   105.000   0,02   450.000   Pacific Media Gapital Services, Inc.   USD   5,625 %   0,1002/2029   33.775   0,01   450.000   Pacific Media Gapital Services, Inc.   USD   5,625 %   0,1002/2029   33.775   0,01   450.000   Pacific Media Gapital Services, Inc.   USD   5,625 %   0,1002/2029   39.978   0,01   450.000   Pacific Media Gapital Services, Inc.   USD   5,500 %   15/10/2027   226.418   0,04   240.000   Pacific Media Gapital Service		• • • • • • • • • • • • • • • • • • • •					
317.000   Novelis Corp.   USD   4,750 %   30/01/2030   321.755   0,06							
25.000         NRG Energy, Inc.         USD         5,750 %         15/01/2028         26.375         0.00           20.000         NRG Energy, Inc.         USD         3,375 %         15/02/2029         19.400         0.00           50.000         NRG Energy, Inc.         USD         3,625 %         15/02/2021         47.625         0.01           112.000         Nuance Communications, Inc.         USD         6,825 %         15/12/2026         115.229         0.02           110.000         NuStar Logistics LP         USD         6,375 %         01/10/2030         1.175.317         0,21           464.000         Occidental Petroleum Corp.         USD         8,000 %         15/07/2025         531.280         0,10           586.000         Occidental Petroleum Corp.         USD         6,625 %         01/09/2030         710.525         0,13           100.000         Occidental Petroleum Corp.         USD         4,000 %         15/09/2030         701.525         0,13           100.000         Oracle Corp.         USD         4,000 %         15/09/2030         701.525         0,13           48.000         Oracle Corp.         USD         4,000 %         15/09/2030         903.787         0,16           48							-
20.000         NRG Energy, Inc.         USD         3,375 %         15/02/2029         19.400         0,00           50.000         NRG Energy, Inc.         USD         3,625 %         15/02/2021         47.625         0,01           112.000         Nuance Communications, Inc.         USD         5,625 %         15/12/2026         115.229         0,02           1.101.000         NuStar Logistics LP         USD         6,375 %         01/10/2030         1.175.317         0,21           484.000         Occidental Petroleum Corp.         USD         8,000 %         15/07/2025         531.280         0,10           566.000         Occidental Petroleum Corp.         USD         6,625 %         01/09/2030         71.05.25         0,13           100.000         Oceledatal Petroleum Corp.         USD         7,125 %         15/03/2026         112.625         0,02           939.000         OneMain Finance Corp.         USD         4,000 %         15/03/2026         112.625         0,02           939.000         OneMain Finance Corp.         USD         3,600 %         15/08/2027         111.925         0,02           48.000         Oracle Corp.         USD         3,600 %         15/08/2027         111.925         0,02		•		•			
50.000         NRG Energy, Inc.         USD         3,625 %         15/02/2031         47,625         0,01           112.000         Nuance Communications, Inc.         USD         5,625 %         15/12/2026         115,229         0,02           1.101.000         NuStar Logistics LP         USD         6,375 %         01/10/2030         1.175,317         0,21           484.000         Occidental Petroleum Corp.         USD         8,000 %         15/07/2025         531,280         0,10           586.000         Occidental Petroleum Corp.         USD         6,625 %         01/09/2030         710,525         0,13           100.000         OneMain Finance Corp.         USD         7,125 %         15/03/2026         112,625         0,02           393.000         Oracle Corp.         USD         4,000 %         15/09/2030         937,877         0,16           48.000         Oracle Corp.         USD         4,000 %         15/09/2030         93,787         0,16           48.000         Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp.         USD         3,600 %         01/04/2050         48,931         0,01           100.000         Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp.         USD         5,875 %         15/01/2029 </td <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>							
112.000   Nuance Communications, Inc.   USD   5,625 %   15/12/2026   115.229   0,02		6,7					
1.101.000       NuStar Logistics LP       USD       6,375 %       01/10/2030       1.175.317       0,21         484.000       Occidental Petroleum Corp.       USD       8,000 %       15/07/2025       531.280       0,10         586.000       Occidental Petroleum Corp.       USD       6,625 %       01/09/2030       710.525       0,13         100.000       OneMain Finance Corp.       USD       7,125 %       15/03/2026       112.625       0,02         939.000       OneMain Finance Corp.       USD       4,000 %       15/09/2030       903.787       0,16         48.000       Oracle Corp.       USD       4,000 %       15/09/2030       903.787       0,16         48.000       Oracle Corp.       USD       4,000 %       15/08/2030       903.787       0,16         48.000       Oracle Corp.       USD       3,600 %       01/04/2050       48.931       0,01         10.000       Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp.       USD       4,250 %       15/08/2027       111.925       0,02         49.000       Pacitic Cas and Electric Co.       USD       5,875 %       15/08/2023       105.000       0,02         45.000       Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. Via Pactiv Evergreen Group Issuer				•			
464.000   Occidental Petroleum Corp.   USD   8,000 %   15/07/2025   531.280   0,10							
100.000         OneMain Finance Corp.         USD         7,125 %         15/03/2026         112.625         0,02           939.000         OneMain Finance Corp.         USD         4,000 %         15/09/2030         903.787         0,16           48.000         Oracle Corp.         USD         3,600 %         01/04/2050         48.931         0,01           110.000         Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp.         USD         5,000 %         15/08/2027         111.925         0,02           50.000         Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp.         USD         4,250 %         15/01/2029         48.625         0,01           100.000         Owens-Brockway Glass Container, Inc.         USD         5,875 %         15/08/2023         105.000         0,02           49.000         Pacific Gas and Electric Co.         USD         3,500 %         01/08/2050         46.743         0,01           56.000         Pacific Eas and Electric Co.         USD         4,000 %         15/10/2027         53.970         0,01           452.000         Pactiv Evergreen Group Issuer         USD         4,000 %         15/10/2027         53.970         0,01           452.000         Pactiv LLC         USD         8,375 %	464.000	Occidental Petroleum Corp.	USD	8,000 %	15/07/2025	531.280	0,10
939.000 OneMain Finance Corp. 48.000 Oracle Corp. USD 3,600 % 01/04/2050 48.931 0,01 110.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. USD 5,000 % 15/08/2027 111.925 0,02 50.000 Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. USD 4,250 % 15/08/2027 111.925 0,02 100.000 Owens-Brockway Glass Container, Inc. USD 4,250 % 15/08/2023 105.000 0,02 49.000 Pacific Gas and Electric Co. USD 3,500 % 01/08/2050 46.743 0,01 56.000 Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. Via Pactiv Evergreen Group Issuer LLC Via Reynolds Group Issuer Inc. Via Pactiv Evergreen Group Issuer LLC Via Reynolds Group Issuer USD 4,000 % 15/10/2027 53.970 0,01 452.000 Pactiv LLC USD 8,375 % 15/08/2023 33.775 0,01 66.000 Pattern Energy Operations LP Via Pattern Energy Operations, Inc. USD 4,500 % 15/08/2028 168.905 0,03 160.000 PennyMac Financial Services, Inc. USD 4,500 % 15/10/2025 162.400 0,03 97.000 PennyMac Financial Services, Inc. USD 4,250 % 15/08/2029 89.240 0,02 204.000 Penske Automotive Group, Inc. USD 5,500 % 15/09/2029 200.685 0,04 219.000 Performance Food Group, Inc. USD 5,500 % 15/10/2027 226.418 0,04 280.000 PerkinElmer, Inc. USD 5,500 % 15/09/2029 299.278 0,05 55.000 Pike Corp. USD 4,250 % 15/09/2029 299.278 0,05 55.000 Pike Corp. USD 4,250 % 15/09/2029 299.278 0,05 55.000 Pike Corp. USD 4,250 % 15/09/2029 299.278 0,05 55.000 Pike Corp. USD 4,250 % 15/09/2029 299.278 0,05 55.000 Pike Corp. USD 4,250 % 15/09/2029 299.278 0,05 55.000 Pike Corp. USD 4,250 % 15/09/2029 299.278 0,05 55.000 Pike Corp. USD 4,250 % 15/09/2029 299.278 0,05 55.000 Pike Corp. USD 4,250 % 15/09/2029 299.278 0,05	586.000	Occidental Petroleum Corp.	USD	6,625 %	01/09/2030	710.525	0,13
48.000       Oracle Corp.       USD       3,600 %       01/04/2050       48.931       0,01         110.000       Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp.       USD       5,000 %       15/08/2027       111.925       0,02         50.000       Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp.       USD       4,250 %       15/01/2029       48.625       0,01         100.000       Owens-Brockway Glass Container, Inc.       USD       5,875 %       15/08/2023       105.000       0,02         49.000       Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. Via Pactiv Evergreen Group Issuer       USD       3,500 %       01/08/2050       46.743       0,01         452.000       Pactiv Evergreen Group Issuer       USD       4,000 %       15/10/2027       53.970       0,01         452.000       Pactiv LC       USD Rectiv Evergreen Group Issuer       USD       5,625 %       01/02/2027       499.460       0,09         35.000       Park River Holdings, Inc.       USD       4,500 %       15/10/2027       33.775       0,01         166.000       Pattern Energy Operations LP Via Pattern Energy Operations, Inc.       USD       4,500 %       15/08/2028       168.905       0,03         160.000       PennyMac Financial Services, Inc.       USD       5							
110.000       Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp.       USD       5,000 %       15/08/2027       111.925       0,02         50.000       Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp.       USD       4,250 %       15/01/2029       48.625       0,01         100.000       Owens-Brockway Glass Container, Inc.       USD       5,875 %       15/08/2023       105.000       0,02         49.000       Pacific Gas and Electric Co.       USD       3,500 %       01/08/2050       46.743       0,01         56.000       Pactiv Evergreen Group Issuer       USD       4,000 %       15/10/2027       53.970       0,01         452.000       Pactiv LLC       USD Reprolete Support Suppor		•					
50.000         Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp.         USD         4,250 %         15/01/2029         48.625         0,01           100.000         Owens-Brockway Glass Container, Inc.         USD         5,875 %         15/08/2023         105.000         0,02           49.000         Pacific Gas and Electric Co.         USD         3,500 %         01/08/2050         46.743         0,01           56.000         Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. Via Pactiv Evergreen Group Issuer         USD         4,000 %         15/10/2027         53.970         0,01           452.000         Pactiv LLC         USD         8,375 %         15/04/2027         499.460         0,09           35.000         Park River Holdings, Inc.         USD         5,625 %         01/02/2029         33.775         0,01           166.000         Pattern Energy Operations LP Via Pattern Energy Operations, Inc.         USD         4,500 %         15/08/2028         168.905         0,03           160.000         PennyMac Financial Services, Inc.         USD         5,375 %         15/10/2025         162.400         0,03           97.000         PennyMac Financial Services, Inc.         USD         3,750 %         15/06/2029         200.685         0,04           219.000         Per							
100.000       Owens-Brockway Glass Container, Inc.       USD       5,875 %       15/08/2023       105.000       0,02         49.000       Pacific Gas and Electric Co.       USD       3,500 %       01/08/2050       46.743       0,01         56.000       Pactic Evergreen Group Issuer, Inc. Via Pactiv Evergreen Group Issuer       USD       4,000 %       15/10/2027       53.970       0,01         452.000       Pactiv LLC       USD       8,375 %       15/04/2027       499.460       0,09         35.000       Park River Holdings, Inc.       USD       5,625 %       01/02/2029       33.775       0,01         166.000       Pattern Energy Operations LP Via Pattern Energy Operations, Inc.       USD       4,500 %       15/08/2028       168.905       0,03         160.000       PennyMac Financial Services, Inc.       USD       5,375 %       15/10/2025       162.400       0,03         97.000       PennyMac Financial Services, Inc.       USD       4,250 %       15/06/2029       89.240       0,02         204.000       Penske Automotive Group, Inc.       USD       3,750 %       15/10/2027       226.418       0,04         219.000       Performance Food Group, Inc.       USD       3,300 %       15/09/2029       299.278       0,05 <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>							
49.000       Pacific Gas and Electric Co.       USD       3,500 %       01/08/2050       46.743       0,01         56.000       Pactiv Evergreen Group Issuer       USD       4,000 %       15/10/2027       53.970       0,01         452.000       Pactiv LLC       USD       4,000 %       15/10/2027       499.460       0,09         35.000       Park River Holdings, Inc.       USD       5,625 %       01/02/2029       33.775       0,01         166.000       Pattern Energy Operations LP Via Pattern Energy Operations, Inc.       USD       4,500 %       15/08/2028       168.905       0,03         160.000       PennyMac Financial Services, Inc.       USD       5,375 %       15/10/2025       162.400       0,03         97.000       PennyMac Financial Services, Inc.       USD       4,250 %       15/02/2029       89.240       0,02         204.000       Penske Automotive Group, Inc.       USD       3,750 %       15/06/2029       200.685       0,04         219.000       Performance Food Group, Inc.       USD       5,500 %       15/10/2027       226.418       0,04         280.000       PerkinElmer, Inc.       USD       3,300 %       15/09/2029       299.278       0,05         55.000       Pike Corp.							
56.000 Pactiv Evergreen Group Issuer LLC Via Reynolds Group Issuer LLC Via Reynolds Group Issuer       USD       4,000 %       15/10/2027       53.970       0,01         452.000 Park River Holdings, Inc.       USD       8,375 %       15/04/2027       499.460       0,09         35.000 Park River Holdings, Inc.       USD       5,625 %       01/02/2029       33.775       0,01         166.000 Pattern Energy Operations LP Via Pattern Energy Operations, Inc.       USD       4,500 %       15/08/2028       168.905       0,03         160.000 PennyMac Financial Services, Inc.       USD       5,375 %       15/10/2025       162.400       0,03         97.000 PennyMac Financial Services, Inc.       USD       4,250 %       15/02/2029       89.240       0,02         204.000 Penske Automotive Group, Inc.       USD       3,750 %       15/06/2029       200.685       0,04         219.000 Performance Food Group, Inc.       USD       5,500 %       15/10/2027       226.418       0,04         280.000 Pike Corp.       USD       3,300 %       15/09/2029       299.278       0,05         55.000 Pike Corp.       USD       4,250 %       15/03/2029       109.155       0,02         529.000 Post Holdings, Inc.       USD       4,625 %       15/03/2028       109.155							
LLC Via Reynolds Group Issuer         USD         4,000 %         15/10/2027         53.970         0,01           452.000 Pactiv LLC         USD         8,375 %         15/04/2027         499.460         0,09           35.000 Park River Holdings, Inc.         USD         5,625 %         01/02/2029         33.775         0,01           166.000 Pattern Energy Operations LP Via Pattern Energy Operations, Inc.         USD         4,500 %         15/08/2028         168.905         0,03           160.000 PennyMac Financial Services, Inc.         USD         5,375 %         15/10/2025         162.400         0,03           97.000 PennyMac Financial Services, Inc.         USD         4,250 %         15/02/2029         89.240         0,02           204.000 Penske Automotive Group, Inc.         USD         3,750 %         15/06/2029         200.685         0,04           219.000 Performance Food Group, Inc.         USD         5,500 %         15/10/2027         226.418         0,04           280.000 PerkinElmer, Inc.         USD         3,300 %         15/09/2029         299.278         0,05           55.000 Pike Corp.         USD         5,500 %         01/09/2028         55.619         0,01           114.000 Playtika Holding Corp.         USD         4,250 %         15/04/				0,000			-,-:
35.000       Park River Holdings, Inc.       USD       5,625 %       01/02/2029       33.775       0,01         166.000       Pattern Energy Operations LP Via Pattern Energy Operations, Inc.       USD       4,500 %       15/08/2028       168.905       0,03         160.000       PennyMac Financial Services, Inc.       USD       5,375 %       15/10/2025       162.400       0,03         97.000       PennyMac Financial Services, Inc.       USD       4,250 %       15/06/2029       89.240       0,02         204.000       Penske Automotive Group, Inc.       USD       3,750 %       15/06/2029       200.685       0,04         219.000       Performance Food Group, Inc.       USD       5,500 %       15/10/2027       226.418       0,04         280.000       PerkinElmer, Inc.       USD       3,300 %       15/09/2029       299.278       0,05         55.000       Pike Corp.       USD       5,500 %       01/09/2028       55.619       0,01         114.00       Playtika Holding Corp.       USD       4,250 %       15/03/2029       199.155       0,02         529.000       Post Holdings, Inc.       USD       4,625 %       15/04/2030       523.761       0,09         119.000       Presidio Holdings, Inc.			USD	4,000 %	15/10/2027	53.970	0,01
166.000       Pattern Energy Operations LP Via Pattern Energy Operations, Inc.       USD       4,500 %       15/08/2028       168.905       0,03         160.000       PennyMac Financial Services, Inc.       USD       5,375 %       15/10/2025       162.400       0,03         97.000       PennyMac Financial Services, Inc.       USD       4,250 %       15/02/2029       89.240       0,02         204.000       Penske Automotive Group, Inc.       USD       3,750 %       15/06/2029       200.685       0,04         219.000       Performance Food Group, Inc.       USD       5,500 %       15/10/2027       226.418       0,04         280.000       PerkinElmer, Inc.       USD       3,300 %       15/09/2029       299.278       0,05         55.000       Pike Corp.       USD       5,500 %       01/09/2028       55.619       0,01         114.000       Playtika Holding Corp.       USD       4,250 %       15/03/2029       109.155       0,02         529.000       Post Holdings, Inc.       USD       4,625 %       15/04/2030       523.761       0,09         119.000       Presidio Holdings, Inc.       USD       8,250 %       01/02/2028       123.016       0,02	452.000	Pactiv LLC		8,375 %		499.460	0,09
160.000       PennyMac Financial Services, Inc.       USD       5,375 %       15/10/2025       162.400       0,03         97.000       PennyMac Financial Services, Inc.       USD       4,250 %       15/02/2029       89.240       0,02         204.000       Penske Automotive Group, Inc.       USD       3,750 %       15/06/2029       200.685       0,04         219.000       Performance Food Group, Inc.       USD       5,500 %       15/10/2027       226.418       0,04         280.000       PerkinElmer, Inc.       USD       3,300 %       15/09/2029       299.278       0,05         55.000       Pike Corp.       USD       5,500 %       01/09/2028       55.619       0,01         114.000       Playtika Holding Corp.       USD       4,250 %       15/03/2029       109.155       0,02         529.000       Post Holdings, Inc.       USD       4,625 %       15/04/2030       523.761       0,09         119.000       Presidio Holdings, Inc.       USD       8,250 %       01/02/2028       123.016       0,02		•					
97.000       PennyMac Financial Services, Inc.       USD       4,250 %       15/02/2029       89.240       0,02         204.000       Penske Automotive Group, Inc.       USD       3,750 %       15/06/2029       200.685       0,04         219.000       Performance Food Group, Inc.       USD       5,500 %       15/10/2027       226.418       0,04         280.000       PerkinElmer, Inc.       USD       3,300 %       15/09/2029       299.278       0,05         55.000       Pike Corp.       USD       5,500 %       01/09/2028       55.619       0,01         114.000       Playtika Holding Corp.       USD       4,250 %       15/04/2030       523.761       0,09         529.000       Post Holdings, Inc.       USD       8,250 %       01/02/2028       123.016       0,02							
204.000       Penske Automotive Group, Inc.       USD       3,750 %       15/06/2029       200.685       0,04         219.000       Performance Food Group, Inc.       USD       5,500 %       15/10/2027       226.418       0,04         280.000       PerkinElmer, Inc.       USD       3,300 %       15/09/2029       299.278       0,05         55.000       Pike Corp.       USD       5,500 %       01/09/2028       55.619       0,01         114.000       Playtika Holding Corp.       USD       4,250 %       15/03/2029       109.155       0,02         529.000       Post Holdings, Inc.       USD       4,625 %       15/04/2030       523.761       0,09         119.000       Presidio Holdings, Inc.       USD       8,250 %       01/02/2028       123.016       0,02							
219.000     Performance Food Group, Inc.     USD     5,500 %     15/10/2027     226.418     0,04       280.000     PerkinElmer, Inc.     USD     3,300 %     15/09/2029     299.278     0,05       55.000     Pike Corp.     USD     5,500 %     01/09/2028     55.619     0,01       114.000     Playtika Holding Corp.     USD     4,250 %     15/03/2029     109.155     0,02       529.000     Post Holdings, Inc.     USD     4,625 %     15/04/2030     523.761     0,09       119.000     Presidio Holdings, Inc.     USD     8,250 %     01/02/2028     123.016     0,02							
280.000     PerkinElmer, Inc.     USD     3,300 %     15/09/2029     299.278     0,05       55.000     Pike Corp.     USD     5,500 %     01/09/2028     55.619     0,01       114.000     Playtika Holding Corp.     USD     4,250 %     15/03/2029     109.155     0,02       529.000     Post Holdings, Inc.     USD     4,625 %     15/04/2030     523.761     0,09       119.000     Presidio Holdings, Inc.     USD     8,250 %     01/02/2028     123.016     0,02		•					
55.000     Pike Corp.     USD     5,500 %     01/09/2028     55.619     0,01       114.000     Playtika Holding Corp.     USD     4,250 %     15/03/2029     109.155     0,02       529.000     Post Holdings, Inc.     USD     4,625 %     15/04/2030     523.761     0,09       119.000     Presidio Holdings, Inc.     USD     8,250 %     01/02/2028     123.016     0,02		• *					
114.000     Playtika Holding Corp.     USD     4,250 %     15/03/2029     109.155     0,02       529.000     Post Holdings, Inc.     USD     4,625 %     15/04/2030     523.761     0,09       119.000     Presidio Holdings, Inc.     USD     8,250 %     01/02/2028     123.016     0,02							
119.000 Presidio Holdings, Inc. USD 8,250 % 01/02/2028 123.016 0,02		•					
	529.000	Post Holdings, Inc.	USD	4,625 %	15/04/2030	523.761	0,09
90.000 Prestige Brands, Inc. USD 3,750 % 01/04/2031 86.119 0,02							
	90.000	Prestige Brands, Inc.	USD	3,750 %	01/04/2031	86.119	0,02

Bonos - Continuación	Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
100.000   Princip Security Services Barrower LLC Via Prince Finance, Inc.	Bonos - (con	tinuación)					
150000 Prudented Francisch   Inc.   USD   5,625 %   150002013   150,400   0.03   170,000   Pruce   USD   6,700 %   150002013   150,000   0.02   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000   150,000		•			.=		
80.000   Concess Corp.				,			
85.000   Carego Corp.							
44.000   Radiate Holdoo L.D. Via Radiate Finance, Inc.   USD   5.000 %   150902028   44.600 0.01		· ·					
50.00   Raymond James Financial, Inc.		•					
11.00			USD	5,000 %	15/03/2023	197.437	0,04
2000   Real Hero Merger Sub 2, Inc.				4,650 %	01/04/2030	58.329	0,01
175.000   Realogy Group LCV via Realogy Constanct Corp.   USD   4,875 %   0106/02023   180.250   0.01							
21.000   Realingy Group LLC Vis Realorgy Co-Issuer Corp.   USD   7.625 %   150/05/2025   96.306   0.02   45.000   Rent-A-Centre, Inc.   USD   0.375 %   150/05/2026   96.306   0.02   45.000   Rent-A-Centre, Inc.   USD   0.375 %   150/05/2026   96.306   0.02   45.000   Reprodust American, Inc.   USD   0.375 %   150/05/2026   152/2376   0.03   85.000   Robert Mutigape LLC Vis Robert Mutig							
95.00 Realogy Cronip LLC Vis Realogy Co-Issuer Corp.  45.00 Rennic A-Center, Inc.  USD  5.850 % 15082209 46.153  0.01  125.00 Reynolds American, Inc.  USD  5.850 % 15082201 48.152  226.100 Satine Press Lipseffection LLC  USD  4.00 % 15082201 182.276  0.02  226.100 Satine Press Lipseffection LLC  USD  4.00 % 15082202 182.276  100.00 Satine Press Lipseffection LLC  USD  4.00 % 15082202 1808.200  100.00 Satine Press Lipseffection LLC  USD  4.00 % 15082202 1808.200  100.00 Satine Press Lipseffection LLC  USD  4.00 % 15082202 1808.200  100.00 Satine Press Lipseffection LLC  USD  4.00 % 15082202 1808.200  100.00 Satine Press Lipseffection LLC  USD  4.00 % 15082202 1808.200  100.00 Satine Press Lipseffection LLC  USD  4.00 % 15082202 1808.200  100.00 Satine Press Lipseffection LLC  USD  4.00 % 15082202 1808.200  100.00 Satine Granipal Press Lipseffection LLC  USD  4.00 % 15082202 1808.200  100.00 Satine Finance Corp.  USD  4.00 % 101422027 189.325  0.01  100.00 Satine Finance Corp.  USD  4.00 % 101422027 189.325  0.01  100.00 Satine Finance Corp.  USD  4.00 % 101422027 189.325  0.01  100.00 Satine Finance Corp.  USD  4.00 % 101422027 189.325  0.01  100.00 Satine Finance Corp.  USD  4.00 % 101422027 189.325  0.01  100.00 Satine Finance Corp.  USD  4.00 % 101422027 189.225  100.00 Satine Finance Corp.  USD  4.00 % 101422027 189.225  100.00 Satine Finance Corp.  USD  4.00 % 101422027 189.225  100.00 Satine Finance Corp.  USD  4.00 % 101422027 189.225  100.00 Satine Finance Corp.  USD  4.00 % 101422027 189.225  100.00 Satine Finance Corp.  USD  4.00 % 101422027 189.225  100.00 Satine Finance Corp.  USD  4.00 % 101422027 189.225  100.00 Satine Finance Corp.  USD  4.00 % 101422027 189.225  100.00 Satine Finance Corp.  USD  4.00 % 101422027 189.225  100.00 Satine Finance Corp.  USD  4.00 % 101422027 189.225  100.00 Satine Finance Corp.  USD  4.00 % 101422027 189.225  100.00 Satine Finance Corp.  USD  4.00 % 101422027 189.225  100.00 Satine Finance Corp.  USD  4.00 % 101422027 189.225  100.00 Satine Finance Corp.  USD  4.00 %							
45.000   Ram-k-Centres Inc.							
150.00   Reynolds American, Inc.   USD							
281000 Sabine Pass Liquerfaction LLC							
159.000 Sabre GLBL, Inc.	85.000	Rocket Mortgage LLC Via Rocket Mortgage Co-Issuer, Inc.	USD	3,875 %	01/03/2031	84.749	0,02
65.000 SBA Communications Corp.	281.000	Sabine Pass Liquefaction LLC	USD	4,200 %	15/03/2028	309.586	0,06
110,000 SBA Communications Corp.							
110,000   Scientific Games International, Inc.   USD   8,250 %   150/3/2026   115 706   0.02   307,000   Scotts Mirade-Gro.   USD   4,000 %   150/20231   55.413   0.01   5.000   Scientific Games International   15.413   0.01   5.000   Scientific Games International   15.413   0.01   5.000   Scientific Games International   1.000   Scientific Games International   1.000   Scientific Games International   1.000   Scientific Games International   1.000   Scientific Games International   USD   4,875 %   Perp.   114.448   0.02   Scientific Games International   USD   4,875 %   Perp.   114.448   0.02   Scientific Games International   USD   4,875 %   Perp.   114.448   0.02   Scientific Games International   USD   4,000 %   1505/2031   177.750   0.03   1505/2031   177.750   0.03   1505/2031   185.300   0.11   1505/2031   185.300   0.11   1505/2031   185.300   0.12   1505/2031   185.300   0.12   1505/2031   185.300   0.12   1505/2031   185.300   0.12   1505/2031   185.300   0.12   1505/2031   185.300   0.12   1505/2031   185.300   0.12   1505/2031   185.300   0.12   1505/2031   185.300   0.12   1505/2031   185.300   0.12   1505/2031   185.300   0.12   1505/2031   185.300   0.12   1505/2031   185.300   0.12   1505/2031   185.300   0.12   1505/2031   185.300   0.12   1505/2031   185.300   0.12   1505/2031   185.300   0.12   1505/2031   185.300   0.03   1505/2032   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/2031   1505/20		•					
307.000   Sotts Miracle-Gro Co.   USD		•					
50.000 Scrippe Escow II, Inc.							
Source   Sealed Air Corp.   USD							
30.000 SEG-Holding LLC Via SEG Finance Corp.		• • • • • • • • • • • • • • • • • • • •					
111.000   Select Medical Corp.   USD   6.250 %   15008/2026   116.550   0.02   180.000   Sempta Energy.   USD   3.750 %   15002/2031   177.750   0.03   680.000   Sempta Enterhologies, Inc.   USD   3.750 %   15002/2031   177.750   0.03   680.000   Semica Corp. International   USD   4.000 %   15055/2031   177.750   0.03   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.0000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.000   1500.		•					
188.000   Sempta Enchologies, Inc.   USD   4,875 %   Perp.   114,448   0,02		·					
680.000   Service Corp International   USD   4,000 %   1505/2031   683.400   0,12							
150,000   Sinclair Television Group, Inc.   USD   5,155 %   150/20207   139,125   0,03   124,000   150/40207   233,669   0,05   100,000   150/40207   233,669   0,05   100,000   150/40207   234,000   0,04   138,000   150/40209   243,000   0,04   138,000   150/40209   243,000   0,04   138,000   150/40209   243,000   0,04   138,000   150/40209   243,000   0,04   138,000   150/40209   243,000   0,04   138,000   150/40209   243,000   0,04   138,000   150/40209   140,080   0,03   100,000   150/40209   140,080   0,03   100,000   150/40209   140,080   0,03   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209   150/40209							0,03
249.00   Skr Flags Entertainment Corp.   USD   5,500 %   15/04/2027   253,669   0,05	680.000	Service Corp International	USD	4,000 %	15/05/2031	683.400	0,12
100.000   Skyworks Solutions, Inc.   USD   3,000 %   01/06/2031   102.004   0.02   232.000   Southwestern Energy Co.   USD   5,375 %   01/02/2029   243.020   0.04   136.000   Specially Building Products Holdings LLC Via SBP Finance Corp.   USD   6,375 %   30/09/2026   140.080   0.03   100.000   Special Painds, Inc.   EUR   4,000 %   01/10/2026   140.080   0.03   100.000   Special Painds, Inc.   EUR   4,000 %   01/10/2026   140.080   0.03   160.000   160.000   160.000   160.000   160.000   160.000   160.000   160.000   160.000   160.000   160.000   160.000   160.000   160.000   160.000   160.000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.00000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.00000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.0000   160.00000   160.00000   160.00000   160.00000   160.00000   160.000000   160.00000000000000000000000000000000000	150.000	Sinclair Television Group, Inc.		5,125 %	15/02/2027	139.125	0,03
232.000   Southwestern Energy Co.   USD   5,375 %   01/02/2029   243.020   0.04   136.000   Specialty Building Products Holdings LLC Via SBP Finance Corp.   USD   6,375 %   3009/2026   140.080   0.03   100.000   Specialty Brands, Inc.   USD   4,600 %   15/06/2028   140.080   0.12   329.000   Spirit AeroSystems, Inc.   USD   4,600 %   15/06/2028   487.700   0.12   329.001   Spirit Capital Corp.   USD   8,750 %   15/03/2032   488.154   0.09   100.000   Standard Industries, Inc.   USD   4,750 %   15/03/2032   488.154   0.09   125.000   Starwood Property Trust, Inc.   USD   4,750 %   15/03/2025   300.000   0.02   320.000   Starwood Property Trust, Inc.   USD   4,750 %   15/03/2025   300.000   0.02   320.000   Summit Midstream Holdings LLC Via Summit Midstream Finance Corp.   USD   4,500 %   15/02/2028   847.35   0.02   320.000   Summit Midstream Holdings LLC Via Summit Midstream Finance Corp.   USD   4,500 %   15/05/2029   1.455.081   0.26   55.000   Talgrass Energy Partners LP Via Talgrass Energy Finance Corp.   USD   4,500 %   15/05/2029   1.455.081   0.26   55.000   Targa Resources Partners LP Via Talgras Resources Partners Finance Corp.   USD   4,000 %   15/01/2032   186.300   0.03   63.000   Taylor Morrison Communities, Inc.   USD   4,000 %   15/01/2032   186.300   0.03   63.000   Taylor Morrison Communities, Inc.   USD   4,625 %   15/03/2028   123.000   0.02   25.000   Tenet Healthcare Corp.   USD   4,625 %   15/03/2028   123.000   0.02   25.000   Tenet Healthcare Corp.   USD   4,625 %   15/03/2028   123.000   0.02   25.000   Tenet Media Buyer, Inc.   USD   2,625 %   15/03/2028   1.90 926   0.21   26.000   T-Mobile USA, Inc.   USD   2,625 %   15/03/2028   1.90 926   0.21   27.000   T-Mobile USA, Inc.   USD   2,625 %   15/03/2029   352.842   0.06   27.000   T-Mobile USA, Inc.   USD   4,625 %   15/04/2050   74.031   0.01   27.000   TransDigm, Inc.   USD   4,625 %   15/04/2050   74.031   0.01   27.000   TransDigm, Inc.   USD   4,625 %   15/04/2029   302.867   0.17   27.000   TransDigm, Inc.   USD   4,625 %   1		•					
136.000 Specially Building Products Holdings LLC Via SBP Finance Corp.  880.000 Spectrum Brands, Inc.  880.000 Spectrum Brands, Inc.  880.000 Spirit AeroSystems, Inc.  880.000 Standard Industries, Inc.  880.000 Standard Industries Inc.  880.000 Standard Industr		· ·					
100.000   Spectrum Brands Inc.		•					
B80.000   Spirit Agental Corp.							
329.000 Sprint Capital Corp. 100.000 Standard Industries, Inc. 105		•					
100.000   Standard Industries, Inc.   USD   5,000 %   15/02/2027   102.724   0.02   125.000   Stanwood Property Trust, Inc.   USD   4,750 %   15/03/2028   347.05   0.02   320.000   Stanwood Property Trust, Inc.   USD   4,750 %   15/03/2028   347.35   0.02   320.000   Stanwood Property Trust, Inc.   USD   4,750 %   15/03/2028   347.35   0.02   320.000   Stanwood Property Trust, Inc.   USD   4,500 %   15/03/2029   14,850.81   0.26   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05							
84.000 Slatino Casinos LLC 320.000 Summit Midstream Holdings LLC Via Summit Midstream Finance Corp. USD 5,750 % 15,042/2025 28,5600 0,05 1.467.000 Sumoco LP Via Sunoco Finance Corp. Serie WI USD 4,500 % 15,052/2029 1,455,081 0,28 55.000 Tallgrass Energy Partners LP Via Targa Resources Partners Finance Corp. USD 6,000 % 31/12/2030 54,313 0,01 180.000 Targa Resources Partners LP Via Targa Resources Partners Finance Corp. USD 4,875 % 01/10/2021 70,038 0,01 180.000 Targa Resources Partners LP Via Targa Resources Partners Finance Corp. USD 4,875 % 01/10/2023 186,300 0,03 180.000 Taylor Morrison Communities, Inc. USD 4,000 % 15,017/2032 186,300 0,03 180.000 Tenet Healthcare Corp. USD 4,625 % 15/03/2028 123,000 0,02 25.000 Tenet Healthcare Corp. USD 4,625 % 01/02/2027 25,859 0,00 177.000 Terrier Media Buyer, Inc. USD 4,875 % 15/12/2027 188,062 0,03 1,205.000 Terrier Media Buyer, Inc. USD 2,050 % 15/02/2028 1,190.926 0,21 364.000 T-Mobile USA, Inc. USD 2,050 % 15/02/2028 1,190.926 0,21 364.000 T-Mobile USA, Inc. USD 2,875 % 15/02/2028 1,190.926 0,21 364.000 T-Mobile USA, Inc. USD 2,875 % 15/02/2029 352,842 0,06 70.000 T-Mobile USA, Inc. USD 2,875 % 15/02/2029 352,842 0,06 70.000 T-Mobile USA, Inc. USD 4,500 % 15/04/2050 74,031 0,01 84.000 Townsquare Media, Inc. USD 4,500 % 15/04/2050 74,031 0,01 84.000 Townsquare Media, Inc. USD 6,375 % 15/02/2028 194,079 0,04 721.000 TransDigm, Inc. USD 6,375 % 15/06/2026 194,079 0,04 21.000 TransDigm, Inc. USD 6,375 % 15/06/2026 194,079 0,04 21.000 TransDigm, Inc. USD 6,375 % 15/06/2026 194,079 0,04 21.000 TransDigm, Inc. USD 7,750 % 15/06/2029 774,211 0,14 21.000 Travel & Leisure Co. USD 7,750 % 15/06/2029 774,211 0,14 21.000 Travel & Leisure Co. USD 7,750 % 15/06/2029 774,211 0,14 21.000 Travel & Leisure Co. USD 7,750 % 15/06/2029 14,024 0,00 20.000 Trill Holmes, Inc. USD 7,750 % 15/06/2029 14,024 0,00 20.000 Trill Holmes, Inc. USD 7,750 % 15/06/2029 14,024 0,00 20.000 Trill Holmes, Inc. USD 7,750 % 15/06/2029 14,024 0,00 20.000 Trill Holmes, Inc. USD 7,750 % 15/06/2029 14,024 0,00							
320.000 Summit Midstream Holdings LLC Via Summit Midstream Finance Corp. USD 5,750 % 15/04/2025 28.5.000 (1.467.000 Sunoco LP Via Sunoco Finance Corp. – Serie WI USD 4,500 % 15/05/2029 1.455.081 0,26 (1.465.000 Targa Resources Partners LP Via Targa Resources Partners LP Via Targa Resources Partners Finance Corp. USD 4,875 % 01/02/2031 70.038 0,01 (180.000 Targa Resources Partners LP Via Targa Resources Partners USD 4,875 % 01/02/2031 70.038 0,01 (180.000 Targa Resources Partners LP Via Targa Resources Partners Finance Corp. USD 4,875 % 01/08/2030 (67.725 0,01 (180.000 Targa Resources Partners Finance Corp. USD 4,825 % 01/08/2030 (67.725 0,01 (180.000 Targa Resources Partners Finance Corp. USD 4,825 % 01/08/2030 (67.725 0,01 (180.000 Terple Media Buyer, Inc. USD 4,825 % 01/08/2032 (183.000 0,02 (180.000 Targa Resources Partners Finance Corp. USD 4,825 % 01/08/2032 (183.000 0,02 (180.000 Targa Resources Partners Finance Corp. USD 8,875 % 01/08/2032 (183.000 Targa Resources Partners Finance Corp. USD 4,825 % 01/08/2032 (183.000 Targa Resources Partners Finance Corp. USD 8,875 % 01/08/2027 (188.062 0,03 (180.000 Targa Media, Inc. USD 8,875 % 01/02/2027 (188.062 0,03 (180.000 Targa Partners Media, Inc. USD 2,825 % 01/02/2029 (180.000 Targa Partners Media, Inc. USD 2,875 % 01/02/2029 (180.000 Targa Partners Media, Inc. USD 4,800 % 01/02/2026 (180.000 Targa Partners Media, Inc. USD 4,825 % 01/02/2026 (180.000 Targa Partners Media, Inc. USD 4,825 % 01/02/2026 (180.000 Targa Partners Media, Inc. USD 4,825 % 01/02/2026 (180.000 Targa Partners Media, Inc. USD 4,825 % 01/02/2026 (180.000 Targa Partners Media, Inc. USD 4,825 % 01/02/2026 (180.000 Targa Partners Media, Inc. USD 4,825 % 01/02/2026 (180.000 Targa Partners Media, Inc. USD 4,825 % 01/02/2026 (180.000 Targa Partners Media, Inc. USD 4,825 % 01/02/2026 (180.000 Targa Partners Media, Inc. USD 5,750 % 01/02/2026 (180.000 Targa Partners Media, Inc. USD 5,750 % 01/02/2027 (180.000 Targa Partners Media, Inc. USD 5,750 % 01/02/2027 (180.000 Targa Partners Media, Inc. USD	125.000	Starwood Property Trust, Inc.	USD	4,750 %	15/03/2025	130.000	0,02
1.467.000   Sunco LP Via Suncoo Finance Corp Serie WI	84.000	Station Casinos LLC	USD	4,500 %	15/02/2028	84.735	0,02
55.000         Tallgrass Energy Partners LP Via Tallgrass Energy Finance Corp.         USD         4,875 %         01/02/2031         54.313         0,01           65.000         Targa Resources Partners LP Via Targa Resources Partners Finance Corp.         USD         4,875 %         01/02/2031         70.038         0,01           180.000         Targa Resources Partners LP Via Targa Resources Partners Finance Corp.         USD         4,000 %         15/01/2032         186.300         0,03           63.000         Taylor Morrison Communities, Inc.         USD         5,125 %         01/08/2030         67.725         0,01           123.000         TEGNA, Inc.         USD         6,250 %         01/02/2027         25.859         0,00           177.000         Terrier Media Buyer, Inc.         USD         8,875 %         15/12/2027         188.062         0,03           1.205.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         2,655 %         15/02/2021         119.0926         0,21           384.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         2,875 %         15/02/2031         68.145         0,01           48.000         Tomsquare Media, Inc.         USD         2,875 %         15/04/2050         74.031         0,01           18.900         TransDigm, Inc.         <							
65.000         Targa Resources Partners LP Via Targa Resources Partners Finance Corp.         USD         4,875 %         01/02/2031         70.038         0,01           180.000         Targa Resources Partners LP Via Targa Resources Partners Finance Corp.         USD         5,125 %         01/08/2030         67.725         0,01           123.000         TEGNA, Inc.         USD         4,625 %         15/03/2028         123.000         0,02           25.000         Tentel Healthcare Corp.         USD         6,250 %         01/02/2027         25.859         0,00           177.000         Terrier Media Buyer, Inc.         USD         6,250 %         01/02/2027         25.859         0,00           1205.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         2,950 %         15/02/2028         1.190.926         0,21           364.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         2,965 %         15/02/2028         1.190.926         0,21           40.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         2,875 %         15/04/2050         74.031         0,01           43.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         4,800 %         15/04/2050         74.031         0,01           43.000         Transbiligm, Inc.         USD         6,875 %         15/04		•					
180.000   Targa Resources Partners LP Via Targa Resources Partners Finance Corp.   USD   4,000 %   15/01/2032   186.300   0,03   63.000   Taylor Morrison Communities, Inc.   USD   4,625 %   01/08/2028   123.000   0,02   25.000   TeGNA, Inc.   USD   4,625 %   15/03/2028   123.000   0,02   25.000   Tenet Healthcare Corp.   USD   6,250 %   01/02/2027   25.859   0,00   177.000   Terner Media Buyer, Inc.   USD   8,875 %   15/12/2027   188.062   0,03   1205.000   T-Mobile USA, Inc.   USD   2,625 %   15/02/2028   1.190.926   0,21   1364.000   T-Mobile USA, Inc.   USD   2,825 %   15/02/2028   1.190.926   0,21   1364.000   T-Mobile USA, Inc.   USD   2,875 %   15/02/2029   352.842   0,06   1360.000   T-Mobile USA, Inc.   USD   2,875 %   15/02/2029   352.842   0,06   1360.000   T-Mobile USA, Inc.   USD   4,500 %   15/04/2050   74.031   0,01   1360.000   T-Mobile USA, Inc.   USD   4,500 %   15/04/2050   74.031   0,01   1360.000   T-Mobile USA, Inc.   USD   4,500 %   15/06/2026   87.990   0,02   139.000   TransDigm, Inc.   USD   6,875 %   15/06/2026   87.990   0,02   139.000   TransDigm, Inc.   USD   4,625 %   15/06/2026   194.079   0,04   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.0000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.000   1360.00							
63.000         Taylor Morrison Communities, Inc.         USD         5,125 %         01/08/2030         67.725         0,01           123.000         TecRIA, Inc.         USD         4,625 %         15/03/2028         123.000         0,02           25.000         Tenet Healthcare Corp.         USD         6,250 %         01/02/2027         25.859         0,00           177.000         Terrier Media Buyer, Inc.         USD         8,875 %         15/12/2027         188.062         0,03           1.205.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         2,050 %         15/02/2028         1,190.926         0,21           364.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         2,625 %         15/02/2029         352.842         0,06           70.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         2,875 %         15/02/2029         352.842         0,06           83.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         4,500 %         15/02/2029         352.842         0,06           84.000         Townsquare Media, Inc.         USD         4,500 %         15/04/2050         74.031         0,01           189.000         TransDigm, Inc.         USD         6,875 %         01/02/2026         87.990         0,02           <							
123.000 TeGNA, Inc.							
25.000         Tenet Healthcare Corp.         USD         6,250 %         01/02/2027         25.859         0,00           177.000         Terrier Media Buyer, Inc.         USD         8,875 %         15/12/2027         188.062         0,03           364.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         2,050 %         15/02/2029         352.842         0,06           70.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         2,875 %         15/02/2031         68.145         0,01           63.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         4,500 %         15/04/2050         74.031         0,01           84.000         Townsquare Media, Inc.         USD         6,875 %         01/02/2026         87.990         0,02           189.000         TransDigm, Inc.         USD         6,375 %         15/08/2026         194.079         0,04           721.000         TransDigm, Inc.         USD         4,625 %         15/01/2029         690.357         0,12           787.000         TransDigm, Inc.         USD         4,625 %         15/01/2029         774.211         0,14           21.000         TransDigm, Inc.         USD         4,625 %         15/01/2029         20.2851         0,00           787.000							
177.000       Terrier Media Buyer, Inc.       USD       8,875 %       15/12/2027       188.062       0,03         1.205.000       T-Mobile USA, Inc.       USD       2,050 %       15/02/2028       1.190.926       0,21         364.000       T-Mobile USA, Inc.       USD       2,825 %       15/02/2031       68.145       0,01         63.000       T-Mobile USA, Inc.       USD       4,500 %       15/04/2050       74.031       0,01         84.000       Townsquare Media, Inc.       USD       6,875 %       01/02/2026       87.990       0,02         189.000       TransDigm, Inc.       USD       6,375 %       15/06/2026       194.079       0,04         721.000       TransDigm, Inc.       USD       4,625 %       15/01/2029       690.357       0,12         787.000       TransDigm, Inc.       USD       4,875 %       01/05/2029       774.211       0,14         21.000       TransDigm, Inc.       USD       4,875 %       01/05/2029       774.211       0,14         21.000       TransDigm, Inc.       USD       4,875 %       01/05/2029       774.211       0,14         21.000       TransDigm, Inc.       USD       4,875 %       01/06/2029       774.211       0,14 <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>							
364.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         2,625 %         15/02/2029         352.842         0,06           70.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         2,875 %         15/02/2031         68.145         0,01           63.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         4,500 %         15/04/2050         74.031         0,01           84.000         Townsquare Media, Inc.         USD         6,875 %         01/02/2026         87.990         0,02           189.000         TransDigm, Inc.         USD         6,875 %         15/06/2026         194.079         0,04           721.000         TransDigm, Inc.         USD         4,625 %         15/01/2029         690.357         0,12           787.000         TransDigm, Inc.         USD         4,875 %         01/05/2029         774.211         0,14           21.000         TransDigm, Inc.         USD         4,875 %         01/06/2029         774.211         0,14           21.000         TransDigm, Inc.         USD         4,875 %         01/06/2029         774.211         0,14           21.000         Trivale & Leisure Co.         USD         5,250 %         01/06/2027         929.875         0,17           13.000         Tri Po							
70.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         2,875 %         15/02/2031         68.145         0,01           63.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         4,500 %         15/04/2050         74.031         0,01           84.000         Townsquare Media, Inc.         USD         6,875 %         01/02/2026         87.990         0,02           189.000         TransDigm, Inc.         USD         6,875 %         15/06/2026         194.079         0,04           721.000         TransDigm, Inc.         USD         4,625 %         15/01/2029         690.357         0,12           787.000         TransDigm, Inc.         USD         4,625 %         01/05/2029         774.211         0,14           21.000         Travel & Leisure Co.         USD         6,625 %         31/07/2026         22.851         0,00           865.000         Tri Pointe Homes, Inc.         USD         5,250 %         01/06/2027         929.875         0,17           13.000         Tri Pointe Homes, Inc.         USD         5,700 %         15/06/2028         14.024         0,00           200.000         TriMas Corp.         USD         5,700 %         15/06/2028         14.024         0,00           582.000	1.205.000	T-Mobile USA, Inc.	USD	2,050 %	15/02/2028	1.190.926	0,21
63.000 T-Mobile USA, Inc.  84.000 Townsquare Media, Inc.  84.000 Townsquare Media, Inc.  85.000 USD  86.875 %  85.000 TransDigm, Inc.  86.875 %  85.000 USD  86.875 %  86.900 USD  86.900 USD  86.875 %  86.900 USD  86.875 %  86.900 USD  86.90		·		2,625 %	15/02/2029	352.842	0,06
84.000       Townsquare Media, Inc.       USD       6,875 %       01/02/2026       87.990       0,02         189.000       TransDigm, Inc.       USD       6,375 %       15/06/2026       194.079       0,04         721.000       TransDigm, Inc.       USD       4,625 %       15/01/2029       690.357       0,12         787.000       TransDigm, Inc.       USD       4,875 %       01/05/2029       774.211       0,14         21.000       Travel & Leisure Co.       USD       6,625 %       31/07/2026       22.851       0,00         865.000       Tri Pointe Homes, Inc.       USD       5,250 %       01/06/2027       929.875       0,17         13.000       Tri Pointe Homes, Inc.       USD       5,700 %       15/06/2028       14.024       0,00         200.000       TriMas Corp.       USD       4,125 %       15/04/2029       200.250       0,04         582.000       Triumph Group, Inc.       USD       7,750 %       15/08/2025       582.000       0,10         74.000       Truist Financial Corp. – Serie Q <sup>(d)</sup> USD       5,100 %       Perp.       82.106       0,02         46.000       TTM Technologies, Inc.       USD       3,875 %       15/12/2027       182.437 <td></td> <td>·</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>		·					
189.000       TransDigm, Inc.       USD       6,375 %       15/06/2026       194.079       0,04         721.000       TransDigm, Inc.       USD       4,625 %       15/01/2029       690.357       0,12         787.000       TransDigm, Inc.       USD       4,875 %       01/05/2029       774.211       0,14         21.000       Travel & Leisure Co.       USD       6,625 %       31/07/2026       22.851       0,00         865.000       Tri Pointe Homes, Inc.       USD       5,250 %       01/06/2027       929.875       0,17         13.000       Tri Pointe Homes, Inc.       USD       5,700 %       15/06/2028       14.024       0,00         200.000       Tridas Corp.       USD       4,125 %       15/04/2029       200.250       0,04         582.000       Triumph Group, Inc.       USD       7,750 %       15/08/2025       582.000       0,10         74.000       Truist Financial Corp Serie Q <sup>(d)</sup> USD       5,100 %       Perp.       82.106       0,02         46.000       TTM Technologies, Inc.       USD       3,875 %       15/12/2027       182.437       0,01         175.000       Twitter, Inc.       USD       7,500 %       15/05/2025       106.000							
721.000         TransDigm, Inc.         USD         4,625 %         15/01/2029         690.357         0,12           787.000         TransDigm, Inc.         USD         4,875 %         01/05/2029         774.211         0,14           21.000         Travel & Leisure Co.         USD         6,625 %         31/07/2026         22.851         0,00           865.000         Tri Pointe Homes, Inc.         USD         5,250 %         01/06/2027         929.875         0,17           13.000         Tri Pointe Homes, Inc.         USD         5,700 %         15/06/2028         14.024         0,00           200.000         Trilms Corp.         USD         4,125 %         15/04/2029         200.250         0,04           582.000         Trilmph Group, Inc.         USD         7,750 %         15/08/2025         582.000         0,10           74.000         Truist Financial Corp. – Serie Q <sup>(d)</sup> USD         5,100 %         Perp.         82.106         0,02           46.000         TTM Technologies, Inc.         USD         4,000 %         01/03/2029         44.678         0,01           175.000         Twitter, Inc.         USD         3,875 %         15/10/2027         182.437         0,03           10.000 <td></td> <td>•</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>		•					
787.000         TransDigm, Inc.         USD         4,875 %         01/05/2029         774.211         0,14           21.000         Travel & Leisure Co.         USD         6,625 %         31/07/2026         22.851         0,00           865.000         Tri Pointe Homes, Inc.         USD         5,250 %         01/06/2027         929.875         0,17           13.000         Tri Pointe Homes, Inc.         USD         5,700 %         15/06/2028         14.024         0,00           200.000         TrilMas Corp.         USD         4,125 %         15/04/2029         200.250         0,04           582.000         Triumph Group, Inc.         USD         7,750 %         15/08/2025         582.000         0,10           74.000         Triumph Group, Inc.         USD         5,100 %         Perp.         82.106         0,02           46.000         TTM Technologies, Inc.         USD         4,000 %         01/03/2029         44.678         0,01           175.000         Twitter, Inc.         USD         4,000 %         15/12/2027         182.437         0,03           100.000         Uber Technologies, Inc.         USD         7,500 %         15/05/2025         106.000         0,02           145.000		•					
21.000       Travel & Leisure Co.       USD       6,625 %       31/07/2026       22.851       0,00         865.000       Tri Pointe Homes, Inc.       USD       5,250 %       01/06/2027       929.875       0,17         13.000       Tri Pointe Homes, Inc.       USD       5,700 %       15/06/2028       14.024       0,00         200.000       Tri Mas Corp.       USD       4,125 %       15/04/2029       200.250       0,04         582.000       Triumph Group, Inc.       USD       7,750 %       15/08/2025       582.000       0,10         74.000       Truist Financial Corp. – Serie Q <sup>(d)</sup> USD       5,100 %       Perp.       82.106       0,02         46.000       TTM Technologies, Inc.       USD       4,000 %       01/03/2029       44.678       0,01         175.000       Twitter, Inc.       USD       3,875 %       15/12/2027       182.437       0,03         100.000       Uber Technologies, Inc.       USD       7,500 %       15/05/2025       106.000       0,02         145.000       Uber Technologies, Inc.       USD       6,250 %       15/01/2028       155.512       0,03         40.000       Unisys Corp.       USD       6,875 %       01/11/2027       43.050		•					
865.000       Tri Pointe Homes, Inc.       USD       5,250 %       01/06/2027       929.875       0,17         13.000       Tri Pointe Homes, Inc.       USD       5,700 %       15/06/2028       14.024       0,00         200.000       TrilVas Corp.       USD       4,125 %       15/04/2029       200.250       0,04         582.000       Triumph Group, Inc.       USD       7,750 %       15/08/2025       582.000       0,10         74.000       Truist Financial Corp. – Serie Q <sup>(d)</sup> USD       5,100 %       Perp.       82.106       0,02         46.000       TTM Technologies, Inc.       USD       4,000 %       01/03/2029       44.678       0,01         175.000       Twitter, Inc.       USD       3,875 %       15/12/2027       182.437       0,03         100.000       Uber Technologies, Inc.       USD       7,500 %       15/05/2025       106.000       0,02         145.000       Uber Technologies, Inc.       USD       6,250 %       15/01/2028       155.512       0,03         40.000       United Natural Foods, Inc.       USD       6,750 %       0/11/12/202       43.050       0,01         597.000       United Rentals North America, Inc.       USD       3,750 %       15		•					
13.000       Tri Pointe Homes, Inc.       USD       5,700 %       15/06/2028       14.024       0,00         200.000       TriMas Corp.       USD       4,125 %       15/04/2029       200.250       0,04         582.000       Triumph Group, Inc.       USD       7,750 %       15/08/2025       582.000       0,10         74.000       Truist Financial Corp. – Serie Q <sup>(d)</sup> USD       5,100 %       Perp.       82.106       0,02         46.000       TTM Technologies, Inc.       USD       4,000 %       01/03/2029       44.678       0,01         175.000       Twitter, Inc.       USD       3,875 %       15/12/2027       182.437       0,03         100.000       Uber Technologies, Inc.       USD       7,500 %       15/05/2025       106.000       0,02         145.000       Uber Technologies, Inc.       USD       6,250 %       15/01/2028       155.512       0,03         40.000       Unisys Corp.       USD       6,875 %       01/11/2027       43.050       0,01         587.000       United Natural Foods, Inc.       USD       6,750 %       15/10/2028       62.495       0,01         597.000       United Rentals North America, Inc.       USD       3,750 %       15/01/2032							
582.000         Triumph Group, Inc.         USD         7,750 %         15/08/2025         582.000         0,10           74.000         Truist Financial Corp. – Serie Q <sup>(d)</sup> USD         5,100 %         Perp.         82.106         0,02           46.000         TTM Technologies, Inc.         USD         4,000 %         01/03/2029         44.678         0,01           175.000         Twitter, Inc.         USD         3,875 %         15/12/2027         182.437         0,03           100.000         Uber Technologies, Inc.         USD         7,500 %         15/05/2025         106.000         0,02           145.000         Uber Technologies, Inc.         USD         6,250 %         15/01/2028         155.512         0,03           40.000         Unity Corp.         USD         6,875 %         01/11/2027         43.050         0,01           587.000         United Natural Foods, Inc.         USD         6,750 %         15/10/2028         62.495         0,01           597.000         United Rentals North America, Inc.         USD         3,750 %         15/01/2032         589.537         0,11           1.000.000         Letras del Tesoro de EE. UU.         USD         0,068 %         16/12/2021         999.974         0,18 <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>							
74.000       Truist Financial Corp. – Serie Q <sup>(d)</sup> USD       5,100 %       Perp.       82.106       0,02         46.000       TTM Technologies, Inc.       USD       4,000 %       01/03/2029       44.678       0,01         175.000       Twitter, Inc.       USD       3,875 %       15/12/2027       182.437       0,03         100.000       Uber Technologies, Inc.       USD       7,500 %       15/05/2025       106.000       0,02         145.000       Uber Technologies, Inc.       USD       6,250 %       15/01/2028       155.512       0,03         40.000       Unisys Corp.       USD       6,875 %       01/11/2027       43.050       0,01         58.000       United Natural Foods, Inc.       USD       6,750 %       15/10/2028       62.495       0,01         597.000       United Rentals North America, Inc.       USD       3,750 %       15/01/2032       589.537       0,11         1.000.000       Letras del Tesoro de EE. UU.       USD       0,068 %       16/12/2021       999.974       0,18	200.000	TriMas Corp.	USD	4,125 %	15/04/2029	200.250	0,04
46.000       TTM Technologies, Inc.       USD       4,000 %       01/03/2029       44.678       0,01         175.000       Twitter, Inc.       USD       3,875 %       15/12/2027       182.437       0,03         100.000       Uber Technologies, Inc.       USD       7,500 %       15/05/2025       106.000       0,02         145.000       Uber Technologies, Inc.       USD       6,250 %       15/01/2028       155.512       0,03         40.000       Unisys Corp.       USD       6,875 %       01/11/2027       43.050       0,01         58.000       United Natural Foods, Inc.       USD       6,750 %       15/10/2028       62.495       0,01         597.000       United Rentals North America, Inc.       USD       3,750 %       15/01/2032       589.537       0,11         1.000.000       Letras del Tesoro de EE. UU.       USD       0,068 %       16/12/2021       999.974       0,18				7,750 %	15/08/2025	582.000	0,10
175.000     Twitter, Inc.     USD     3,875 %     15/12/2027     182.437     0,03       100.000     Uber Technologies, Inc.     USD     7,500 %     15/05/2025     106.000     0,02       145.000     Uber Technologies, Inc.     USD     6,250 %     15/01/2028     155.512     0,03       40.000     Unisys Corp.     USD     6,875 %     01/11/2027     43.050     0,01       58.000     United Natural Foods, Inc.     USD     6,750 %     15/10/2028     62.495     0,01       597.000     United Rentals North America, Inc.     USD     3,750 %     15/01/2032     589.537     0,11       1.000.000     Letras del Tesoro de EE. UU.     USD     0,068 %     16/12/2021     999.974     0,18		•					
100.000     Uber Technologies, Inc.     USD     7,500 %     15/05/2025     106.000     0,02       145.000     Uber Technologies, Inc.     USD     6,250 %     15/01/2028     155.512     0,03       40.000     United Natural Foods, Inc.     USD     6,875 %     01/11/2027     43.050     0,01       58.000     United Natural Foods, Inc.     USD     6,750 %     15/10/2028     62.495     0,01       597.000     United Rentals North America, Inc.     USD     3,750 %     15/01/2032     589.537     0,11       1.000.000     Letras del Tesoro de EE. UU.     USD     0,068 %     16/12/2021     999.974     0,18		<b>o</b> ,					
145.000     Uber Technologies, Inc.     USD     6,250 %     15/01/2028     155.512     0,03       40.000     Unitys Corp.     USD     6,875 %     01/11/2027     43.050     0,01       58.000     United Natural Foods, Inc.     USD     6,750 %     15/10/2028     62.495     0,01       597.000     United Rentals North America, Inc.     USD     3,750 %     15/01/2032     589.537     0,11       1.000.000     Letras del Tesoro de EE. UU.     USD     0,068 %     16/12/2021     999.974     0,18							
40.000 Unisys Corp.       USD 6,875 %       01/11/2027       43.050 0,01         58.000 United Natural Foods, Inc.       USD 6,750 %       15/10/2028 62.495 0,01         597.000 United Rentals North America, Inc.       USD 3,750 %       15/01/2032 589.537 0,11         1.000.000 Letras del Tesoro de EE. UU.       USD 0,068 %       16/12/2021 999.974 0,18		•					
58.000 United Natural Foods, Inc.     USD     6,750 %     15/10/2028     62.495     0,01       597.000 United Rentals North America, Inc.     USD     3,750 %     15/01/2032     589.537     0,11       1.000.000 Letras del Tesoro de EE. UU.     USD     0,068 %     16/12/2021     999.974     0,18							
597.000 United Rentals North America, Inc.     USD     3,750 %     15/01/2032     589.537     0,11       1.000.000 Letras del Tesoro de EE. UU.     USD     0,068 %     16/12/2021     999.974     0,18		, ,					
1.000.000 Letras del Tesoro de EE. UU. USD 0,068 % 16/12/2021 999.974 0,18							

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con						
•	os – (continuación)					
	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,410 %	27/01/2022	4.499.720	0,81
	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,450 %	10/02/2022	9.999.157	1,80
	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,470 %	17/02/2022	4.999.485	0,90
	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,490 %	03/03/2022	4.999.393	0,90
	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,480 %	10/03/2022	7.498.969	1,35
	United Wholesale Mortgage LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/04/2029	196.800	0,04
	Urban One, Inc.	USD	7,375 %	01/02/2028 15/02/2029	81.500	0,01
	US Foods, Inc.	USD	4,750 % 6.875 %		203.010	0,04
	USA Compression Partners LP Via USA Compression Finance Corp.	USD USD	-,	01/04/2026	672.805 49.625	0,12 0,01
	Valvoline, Inc. Valvoline, Inc.	USD	4,250 % 3,625 %	15/02/2030 15/06/2031	38.100	0,01
	VeriSign, Inc.	USD	5,250 %	01/04/2025	138.524	0,01
	Verizon Communications, Inc.	USD	4,016 %	03/12/2029	729.131	0,03
	Verizon Communications, Inc.	USD	3,150 %	22/03/2030	344.880	0,06
	Verizon Communications, Inc.	USD	5,250 %	16/03/2037	164.174	0,03
	VICI Properties LP Via VICI Note Co., Inc.	USD	3,500 %	15/02/2025	76.031	0,01
	Walt Disney Co.	USD	3,800 %	22/03/2030	83.112	0,02
	Wells Fargo & Co.	USD	4,300 %	22/07/2027	250.760	0,05
	WESCO Distribution, Inc.	USD	7,250 %	15/06/2028	51.054	0,01
	Williams Cos., Inc. – Serie A	USD	7,500 %	15/01/2031	273.738	0,05
	Williams Scotsman International, Inc.	USD	4,625 %	15/08/2028	35.700	0,01
	Wolverine Escrow LLC	USD	8,500 %	15/11/2024	136.662	0,02
450.000	Xerox Holdings Corp.	USD	5,000 %	15/08/2025	464.062	0,08
	Xerox Holdings Corp.	USD	5,500 %	15/08/2028	50.750	0,01
	Yum! Brands, Inc.	USD	7,750 %	01/04/2025	2.105	0,00
198.000	Yum! Brands, Inc.	USD	4,750 %	15/01/2030	209.385	0,04
457.000	Yum! Brands, Inc.	USD	3,625 %	15/03/2031	443.290	0,08
115.000	Ziff Davis, Inc.	USD	4,625 %	15/10/2030	116.438	0,02
75.000	ZoomInfo Technologies LLC Via ZoomInfo Finance Corp.	USD	3,875 %	01/02/2029	73.313	0,01
		-			117.384.428	21,13
					117.504.420	21,10
TOTAL DE BOI (coste USD 14)					139.916.481	25,19
•						-,
					Valor de mercado	% del
Tenencias	Descripción del valor				Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	Descripción del valor linarias – 29,30 %					
	· ·				en USD	
Acciones ord	· ·					
Acciones ord Australia 181.993	linarias – 29,30 %				en USD	patrimonio
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia	linarias – 29,30 %  Transurban Group				en USD 1.775.756	patrimonio 0,32
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373	linarias – 29,30 %				en USD	patrimonio
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia	linarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp				en USD 1.775.756 2.446.061	0,32 0,44
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584	Inarias – 29,30 % Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A.				en USD 1.775.756 2.446.061 4.107.349	0,32 0,44 0,74
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A.				en USD 1.775.756 2.446.061 4.107.349 1.908.910	0,32 0,44 0,74 0,34
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A.				en USD 1.775.756 2.446.061 4.107.349 1.908.910 1.669.656	0,32 0,44 0,74 0,34 0,30
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281 14.468	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi				en USD 1.775.756 2.446.061 4.107.349 1.908.910	0,32 0,44 0,74 0,34 0,30 0,25
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi Schneider Electric S.E.				en USD 1.775.756 2.446.061 4.107.349 1.908.910 1.669.656	0,32 0,44 0,74 0,34 0,30 0,25
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi				en USD 1.775.756 2.446.061 4.107.349 1.908.910 1.669.656 1.390.416	0,32 0,44 0,74 0,34 0,30 0,25 0,50
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi Schneider Electric S.E.				2.446.061 4.107.349 1.908.910 1.669.656 1.390.416 2.782.218	0,32 0,44 0,74 0,30 0,25 0,50 0,63
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660 36.762	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi Schneider Electric S.E.				1.775.756 2.446.061 4.107.349 1.908.910 1.669.656 1.390.416 2.782.218 3.497.796	0,32 0,44 0,74 0,30 0,25 0,50 0,63
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660 36.762	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi Schneider Electric S.E. Vinci S.A.				1.775.756 2.446.061 4.107.349 1.908.910 1.669.656 1.390.416 2.782.218 3.497.796	0,32 0,44 0,74 0,30 0,25 0,50 0,63 2,76
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660 36.762	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi Schneider Electric S.E.				1.775.756 2.446.061 4.107.349 1.908.910 1.669.656 1.390.416 2.782.218 3.497.796	0,32 0,44 0,74 0,30 0,25 0,50 0,63 2,76
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660 36.762	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi Schneider Electric S.E. Vinci S.A.			_	1.775.756 2.446.061 4.107.349 1.908.910 1.669.656 1.390.416 2.782.218 3.497.796	0,32 0,44 0,74 0,30 0,25 0,50 0,63 2,76
Acciones ord Australia 181.993  Finlandia 205.373  Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660 36.762  Alemania 54.444  Irlanda	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi Schneider Electric S.E. Vinci S.A.			_	1.775.756  2.446.061  4.107.349 1.908.910 1.669.656 1.390.416 2.782.218 3.497.796 15.356.345	0,32 0,44 0,74 0,30 0,25 0,50 0,63 2,76
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660 36.762  Alemania 54.444 Irlanda 3.811	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi Schneider Electric S.E. Vinci S.A.  Vonovia S.E.  Accenture Plc. "A"				1.775.756  2.446.061  4.107.349 1.908.910 1.669.656 1.390.416 2.782.218 3.497.796 15.356.345 3.054.712	0,32 0,44 0,74 0,30 0,25 0,50 0,63 2,76
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660 36.762  Alemania 54.444 Irlanda 3.811	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi Schneider Electric S.E. Vinci S.A.				1.775.756  2.446.061  4.107.349 1.908.910 1.669.656 1.390.416 2.782.218 3.497.796 15.356.345  3.054.712  1.386.061 2.098.141	0,32 0,44 0,74 0,30 0,25 0,50 0,63 2,76 0,55
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660 36.762  Alemania 54.444 Irlanda 3.811	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi Schneider Electric S.E. Vinci S.A.  Vonovia S.E.  Accenture Plc. "A"				1.775.756  2.446.061  4.107.349 1.908.910 1.669.656 1.390.416 2.782.218 3.497.796 15.356.345 3.054.712	0,32 0,44 0,74 0,30 0,25 0,50 0,63 2,76 0,55
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660 36.762  Alemania 54.444 Irlanda 3.811	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi Schneider Electric S.E. Vinci S.A.  Vonovia S.E.  Accenture Plc. "A"				1.775.756  2.446.061  4.107.349 1.908.910 1.669.656 1.390.416 2.782.218 3.497.796 15.356.345  3.054.712  1.386.061 2.098.141	0,32 0,44 0,74 0,30 0,25 0,50 0,63 2,76 0,55
Acciones ord Australia 181.993  Finlandia 205.373  Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660 36.762  Alemania 54.444  Irlanda 3.811 19.249	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi Schneider Electric S.E. Vinci S.A.  Vonovia S.E.  Accenture Plc. "A" Medtronic Plc.				1.775.756  2.446.061  4.107.349 1.908.910 1.669.656 1.390.416 2.782.218 3.497.796 15.356.345  3.054.712  1.386.061 2.098.141 3.484.202	0,32 0,44 0,74 0,30 0,25 0,50 0,63 2,76 0,55
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660 36.762  Alemania 54.444 Irlanda 3.811 19.249  Italia 202.394	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi Schneider Electric S.E. Vinci S.A.  Vonovia S.E.  Accenture Plc. "A" Medtronic Plc.				1.775.756  2.446.061  4.107.349 1.908.910 1.669.656 1.390.416 2.782.218 3.497.796 15.356.345  3.054.712  1.386.061 2.098.141 3.484.202	0,32 0,44 0,74 0,30 0,25 0,50 0,63 2,76 0,55 0,25 0,38
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660 36.762  Alemania 54.444 Irlanda 3.811 19.249  Italia 202.394	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi Schneider Electric S.E. Vinci S.A.  Vonovia S.E.  Accenture Plc. "A" Medtronic Plc.				1.775.756  2.446.061  4.107.349 1.908.910 1.669.656 1.390.416 2.782.218 3.497.796 15.356.345  3.054.712  1.386.061 2.098.141 3.484.202  1.554.255 1.922.004	0,32 0,44 0,74 0,30 0,25 0,50 0,63 2,76 0,55 0,25 0,38 0,63 0,28 0,35
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660 36.762  Alemania 54.444 Irlanda 3.811 19.249  Italia 202.394	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi Schneider Electric S.E. Vinci S.A.  Vonovia S.E.  Accenture Plc. "A" Medtronic Plc.				1.775.756  2.446.061  4.107.349 1.908.910 1.669.656 1.390.416 2.782.218 3.497.796 15.356.345  3.054.712  1.386.061 2.098.141 3.484.202	0,32 0,44 0,74 0,30 0,25 0,50 0,63 2,76 0,55 0,25 0,38 0,63 0,28 0,35
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660 36.762  Alemania 54.444 Irlanda 3.811 19.249  Italia 202.394 158.042	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi Schneider Electric S.E. Vinci S.A.  Vonovia S.E.  Accenture Plc. "A" Medtronic Plc.				1.775.756  2.446.061  4.107.349 1.908.910 1.669.656 1.390.416 2.782.218 3.497.796 15.356.345  3.054.712  1.386.061 2.098.141 3.484.202  1.554.255 1.922.004	0,32 0,44 0,74 0,30 0,25 0,50 0,63 2,76 0,55
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660 36.762  Alemania 54.444 Irlanda 3.811 19.249  Italia 202.394 158.042	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi Schneider Electric S.E. Vinci S.A.  Vonovia S.E.  Accenture Plc. "A" Medtronic Plc.				1.775.756  2.446.061  4.107.349 1.908.910 1.669.656 1.390.416 2.782.218 3.497.796 15.356.345  3.054.712  1.386.061 2.098.141 3.484.202  1.554.255 1.922.004	0,32 0,44 0,74 0,30 0,25 0,50 0,63 2,76 0,55 0,25 0,38 0,63 0,28 0,35
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660 36.762  Alemania 54.444 Irlanda 3.811 19.249  Italia 202.394 158.042  Japón 75.100	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi Schneider Electric S.E. Vinci S.A.  Vonovia S.E.  Accenture Plc. "A" Medtronic Plc.  Enel SpA UniCredit SpA				1.775.756  2.446.061  4.107.349 1.908.910 1.669.656 1.390.416 2.782.218 3.497.796 15.356.345  3.054.712  1.386.061 2.098.141 3.484.202  1.554.255 1.922.004 3.476.259	0,32 0,44 0,74 0,30 0,25 0,50 0,63 2,76 0,55 0,25 0,38 0,63 0,28 0,35 0,63
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660 36.762  Alemania 54.444 Irlanda 3.811 19.249  Italia 202.394 158.042  Japón 75.100 Países Bajos	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi Schneider Electric S.E. Vinci S.A.  Vonovia S.E.  Accenture Plc. "A" Medtronic Plc.  Enel SpA UniCredit SpA  Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.				1.775.756  2.446.061  4.107.349 1.908.910 1.669.656 1.390.416 2.782.218 3.497.796 15.356.345  3.054.712  1.386.061 2.098.141 3.484.202  1.554.255 1.922.004 3.476.259	0,32 0,44 0,74 0,30 0,25 0,50 0,63 2,76 0,55 0,25 0,38 0,63 0,28 0,35 0,63
Acciones ord Australia 181.993 Finlandia 205.373 Francia 65.584 14.033 78.281 14.468 15.660 36.762  Alemania 54.444 Irlanda 3.811 19.249  Italia 202.394 158.042  Japón 75.100 Países Bajos	Inarias – 29,30 %  Transurban Group  Nordea Bank Abp  BNP Paribas S.A. Gecina S.A. Klepierre S.A. Sanofi Schneider Electric S.E. Vinci S.A.  Vonovia S.E.  Accenture Plc. "A" Medtronic Plc.  Enel SpA UniCredit SpA				1.775.756  2.446.061  4.107.349 1.908.910 1.669.656 1.390.416 2.782.218 3.497.796 15.356.345  3.054.712  1.386.061 2.098.141 3.484.202  1.554.255 1.922.004 3.476.259	0,32 0,44 0,74 0,30 0,25 0,50 0,63 2,76 0,55 0,25 0,38 0,63 0,28 0,35 0,63

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del
Acciones ord	inarias – (continuación)		
Países Bajos -	(continuación)		
528.972	Koninklijke KPN NV	1.563.111	0,28
86.174	Royal Dutch Shell Plc. "A"	1.803.075	0,33
		6.107.318	1,10
Singapur 255.960	Singapore Exchange Ltd.	1.678.710	0,30
España		0.010.070	0.54
	Iberdrola S.A.	2.842.079	0,51
Suiza 20.388	Nestlé S.A.	2.647.769	0,48
	Roche Holding AG	2.796.375	0,50
481	SGS S.A.	1.462.429	0,26
28.757	Swiss Re AG	2.707.428	0,49
8.479	Zurich Insurance Group AG	3.510.084	0,63
		13.124.085	2,36
Taiwán 27.839	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.—ADR <sup>(e)</sup>	3.338.175	0,60
Reino Unido	Tallian Sumonassian Managasian g Soi, Eta. 7.27	0.0000	0,00
	AstraZeneca Plc.	4.377.273	0,79
713.302	BP Plc.	3.095.612	0,56
12.405	Ferguson Plc.	1.924.062	0,34
	Linde Plc.	2.833.825	0,51
	National Grid Plc.	2.612.465	0,47
	Reckitt Benckiser Group Plc. Rio Tinto Plc.	2.277.461	0,41
35.340	RIO TITILO PIC.	2.205.767	0,40
Estados Unido	s	19.326.465	3,48
24.740	Ameren Corp.	2.078.655	0,37
	American Tower Corp.	2.848.300	0,51
	Amgen, Inc.	863.042	0,16
	AT&T, Inc.	2.309.114	0,42
	AvalonBay Communities, Inc. Boston Properties, Inc.	2.252.164 1.473.393	0,41 0,26
	Bristol-Myers Squibb Co.	3.113.695	0,56
	Chevron Corp.	2.993.714	0,54
	Cisco Systems, Inc.	3.808.427	0,69
41.644	Coca-Cola Co.	2.222.540	0,40
	Cognizant Technology Solutions Corp. "A"	1.182.464	0,21
	CVS Health Corp.	1.321.484	0,24
	Eaton Corp., Plc.	2.759.419	0,50
	Ecolab, Inc. Fidelity National Information Services, Inc.	2.707.720 2.576.338	0,49 0,46
	Home Depot, Inc.	2.576.336	0,46
	Honeywell International, Inc.	3.103.744	0,56
	Illinois Tool Works, Inc.	2.650.236	0,48
	International Business Machines Corp.	931.998	0,17
39.011	International Paper Co.	1.801.918	0,32
	Johnson & Johnson	3.400.533	0,61
	JP Morgan Chase & Co.	5.338.705	0,96
	KLA Corp.	1.530.643	0,28
	KyndrylHoldings, Inc. M&T Bank Corp.	24.347 2.191.968	0,00 0,39
	McDonald's Corp.	2.191.966	0,38
	Microsoft Corp.	6.696.144	1,21
	Morgan Stanley – Serie E—Preferente	57.386	0,01
	Noble Corp.	112.028	0,02
18.605	Procter & Gamble Co.	2.752.238	0,50
15.815	Prologis, Inc.	2.419.695	0,44
	QUALCOMM, Inc.	2.138.428	0,38
	Qwest Corp. – Preferente	27.331	0,00
	Republic Services, Inc.	1.957.485	0,35
	Texas Instruments, Inc.	2.783.232	0,50
32.894	Ventas, Inc.	1.600.622	0,29

Tenencias	Descripción del valor				Valor de mercado en USD	% de
Acciones ord	linarias – (continuación)					
Estados Unido	os – (continuación)					
13.128	Walmart, Inc.				1.861.025	0,3
32.175	Xcel Energy, Inc.				2.094.271	0,3
TOTAL DE AC	CIONES ORDINARIAS				84.773.765	15,20
(coste USD 15	CIONES ORDINARIAS i8.902.295)				162.799.654	29,30
Derechos - 0	9,04 %					
Alemania 54 444	Vonovia S.E.—Derechos				201.707	0,04
TOTAL DE DEI					201.707	0,0
(coste USD 0)					201.707	0,04
Fondos de in Alemania	versión – 9,00 %					
	iShares EURO STOXX Banks 30-15 UCITS ETF				4.721.804	0,8
Luxemburgo						
	Goldman Sachs Funds - Emerging Markets Debt Local Portfolio (Clase de accio Goldman Sachs Funds - Emerging Markets Debt Portfolio (Clase de acciones de		′		23.450.354 21.835.122	4,2; 3,9;
2.202.707	Goldman Sachs Funds - Emerging Markets Debt Fortiono (Clase de acciones de	uistribuci	on io).	_		
TOTAL DE FO	NDOS DE INVERSIÓN				45.285.476	8,1
(coste USD 52	.301.169)				50.007.280	9,00
VALORES OF					352.925.122	62.5
(coste USD 35	11.232.033)					63,5
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de patrimonio
Valores mobi Bonos – 19,4 Bermudas	lliarios negociados en otro mercado regulado 9 %					
	NCL Corp., Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,625 %	15/12/2024	468.050	0,0
Canadá						
	Air Canada 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	15/08/2026	185.694	0,03
	GFL Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	01/08/2028	894.340	0,10
	GFL Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	15/08/2029	850.937	0,1
	Glencore Finance Canada Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,900 %	15/11/2037	175.049	0,03
	Masonite International Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,500 %	15/02/2030	679.274	0,12
	MEG Energy Corp. 144A <sup>(c)</sup> NOVA Chemicals Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,125 %	01/02/2027	474.137 423.938	0,09
	Open Text Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	15/05/2029		
1.075.000	Open rext Corp. 144A	020	3,875 %	01/12/2029	1.664.531 5.347.900	0,30
Islas Caimán					3.347.900	0,50
175.000	Avolon Holdings Funding Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,250 %	15/02/2027	179.025	0,03
35.000	Avolon Holdings Funding Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD	2,528 %	18/11/2027	34.151	0,0
451.318	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd. Via HawaiianMiles Loyalty Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,750 %	20/01/2026	468.243	0,08
587.000	Transocean, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	11,500 %	30/01/2027	557.650	0,10
Francis					1.239.069	0,22
Francia 510.000	BNP Paribas S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,323 %	13/01/2027	498.311	0,09
	BPCE S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	12/09/2028	1.144.680	0,2
	SPCM S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,375 %	15/03/2030	276.950	0,0
200.000		200	0,010 /0	10,00,2000	1.919.941	0,3
Irlanda						
200 000	Castlelake Aviation Finance DAC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	15/04/2027	386.100	0,0
	1077 Nocurition 1100: 1440W	USD	4,375 %	15/01/2029	625.511	0,1
611.000	Jazz Securities DAC 144A <sup>(c)</sup>					
611.000	LCPR Senior Secured Financing DAC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,125 %	15/07/2029	779.974	0,14
611.000		USD	5,125 %	15/07/2029	779.974 1.791.585	0,14
611.000 779.000 Italia		USD	5,125 %	15/07/2029 26/06/2024		

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del
Bonos - (con						·
Luxemburgo	illiadololly					
-	Altice Financing S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	15/01/2028	649.037	0,12
200.000	Intelsat Jackson Holdings S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,000 %	15/02/2024	204.250	0,04
	ION Trading Technologies SARL 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,750 %	15/05/2028	351.230	0,06
041.000	Total Trading Teenhologies of the 14470	COD		10/00/2020	1.204.517	0,22
Países Bajos						
-	Deutsche Telekom International Finance BV 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	21/06/2028	295.864	0,05
215.000	Elastic NV 144A	USD	4,125 %	15/07/2029	211.238	0,04
310 000	JAB Holdings BV 144A <sup>(c)</sup>	USD	2,200 %	23/11/2030	304.671	0,06
0.0000	J. D. Holdings D. V. F. M.	002	2,200 70	20.1.12000	811.773	0,15
Supranacional	es					-,,,-
•	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp. Via Atlas					
	Luxco 4 SARL 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	01/06/2028	236.731	0,04
	American Airlines, Inc. Via AAdvantage Loyalty IP Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,750 %	20/04/2029	241.788	0,04
540.000	Ardagh Packaging Finance Plc. Via Ardagh Holdings USA, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,250 %	15/08/2027	533.925	0,10
					1.012.444	0,18
Suiza	Cradit Suigno Croup AC 144A(C)(d)	HCD	4.404.0/	04/04/0004	075 077	0.05
Reino Unido	Credit Suisse Group AG 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	4,194 %	01/04/2031	275.377	0,05
	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	15/06/2028	201.500	0,04
	TechnipFMC Plc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,500 %	01/02/2026	865.375	0,15
	·				1.066.875	0,19
Estados Unido						
	Acrisure LLC Via Acrisure Finance, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	15/02/2029	704.055	0,13
305.000	Acrisure LLC Via Acrisure Finance, Inc. 144A(c)	USD	6,000 %	01/08/2029	292.800	0,05
1.289.000	AdaptHealth LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,125 %	01/03/2030	1.282.555	0,23
516.000	ADT Security Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	01/08/2029	503.100	0,09
515.000	AG Issuer LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,250 %	01/03/2028	533.669	0,10
259.000	Albertsons Cos., Inc. Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via Albertsons LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,500 %	15/03/2029	257.705	0,05
245.000	Allen Media LLC Via Allen Media Co-Issuer, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	10,500 %	15/02/2028	263.988	0,05
	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,625 %	15/07/2026	134.225	0,02
	American Builders & Contractors Supply Co., Inc. 144A(c)	USD	3,875 %	15/11/2029	278.588	0,05
	APi Escrow Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/10/2029	256.334	0,05
1.575.000	APi Group DE, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	15/07/2029	1.551.375	0,28
483.000	APX Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,750 %	15/07/2029	473.944	0,08
978.000	Arcosa, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	15/04/2029	991.447	0,18
	Aretec Escrow Issuer, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,500 %	01/04/2029	113.163	0,02
	Arko Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,125 %	15/11/2029	967.637	0,17
	Asbury Automotive Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	15/11/2029	348.881	0,06
	Asbury Automotive Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	15/02/2032	193.388	0,03
	Ashland LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,375 %	01/09/2031	734.450	0,13
	Atkore, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Avantor Funding, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 % 3,875 %	01/06/2031 01/11/2029	845.292 1.462.650	0,15 0,26
	BCPE Empire Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,625 %	01/05/2027	156.390	0,28
	Boyne USA, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/05/2029	590.366	0,03
	Broadcom, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,469 %	15/04/2034	148.778	0,03
	Broadcom, Inc. 144A(c)	USD	3,137 %	15/11/2035	431.814	0,08
	BroadStreet Partners, Inc. 144A(c)	USD	5,875 %	15/04/2029	408.600	0,07
255.000	Buckeye Partners LP 144A(c)	USD	4,500 %	01/03/2028	250.219	0,04
340.000	Builders FirstSource, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	01/03/2030	360.400	0,06
	Cargo Aircraft Management, Inc. 144A(c)	USD	4,750 %	01/02/2028	50.813	0,01
	Carvana Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	01/09/2029	749.675	0,13
	Castle US Holding Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	9,500 %	15/02/2028	609.875	0,11
	Catalent Pharma Solutions, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,500 %	01/04/2030	643.387	0,12
	CCO Holdings LLC Via CCO Holdings Capital Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	01/03/2030	735.750	0,13
	CCO Holdings LLC Via CCO Holdings Capital Corp. 144A <sup>(c)</sup> CD&R Smokev Buyer. Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	15/08/2030	673.130	0,12 0,02
	Century Communities, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,750 % 3,875 %	15/07/2025 15/08/2029	121.438 1.030.631	0,02
	Chemours Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	15/11/2029	544.600	0,10
	Cheniere Energy Partners LP 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,250 %	31/01/2032	864.794	0,16
	CHS Via Community Health Systems, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,125 %	01/04/2030	110.831	0,02
	Civitas Resources, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	15/10/2026	302.713	0,05
305.000						-,50
	Clarivate Science Holdings Corp. 144A(c)	USD	3,875 %	01/07/2028	643.850	0,12
652.000		USD USD	3,875 % 4,875 %	01/07/2028 01/07/2029	643.850 615.625	0,12 0,11

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con	<u> </u>		· ·			·
•	s – (continuación)					
	CNX Midstream Partners LP 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/04/2030	262.184	0,05
480.000	CP Atlas Buyer, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,000 %	01/12/2028	465.600	0,08
	CQP Holdco LP Via BIP-V Chinook Holdco LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/06/2031	596.700	0,11
	CSC Holdings LLC 144A(c)	USD	5,000 %	15/11/2031	1.352.098	0,24
	DCP Midstream Operating LP 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,750 %	15/09/2037	829.687	0,15
	Dealer Tire LLC Via DT Issuer LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,000 %	01/02/2028	664.200	0,12
	DISH DBS Corp. 144A <sup>(c)</sup> DT Midstream, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	5,250 % 4,375 %	01/12/2026 15/06/2031	293.525 1.049.965	0,05 0,19
	Dycom Industries, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	15/04/2029	468.060	0,19
	Endure Digital, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,000 %	15/02/2029	700.177	0,00
	EQT Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,625 %	15/05/2031	789.426	0,14
	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	01/05/2028	686.312	0,12
	Foundation Building Materials, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,000 %	01/03/2029	91.438	0,02
	Freedom Mortgage Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,625 %	15/01/2027	272.600	0,05
	Gap, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,625 %	01/10/2029	269.500	0,05
280.000	Gap, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	01/10/2031	269.500	0,05
220.000	Getty Images, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	9,750 %	01/03/2027	232.375	0,04
690.000	Glatfelter Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/11/2029	698.625	0,13
1.212.000	Global Infrastructure Solutions, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,625 %	01/06/2029	1.227.150	0,22
207.000	Group 1 Automotive, Inc. 144A(c)	USD	4,000 %	15/08/2028	204.930	0,04
	GYP Holdings III Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	01/05/2029	323.537	0,06
	H&E Equipment Services, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	15/12/2028	601.370	0,11
	HealthEquity, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	01/10/2029	238.590	0,04
	Hess Midstream Operations LP 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	15/02/2030	258.044	0,05
	H-Food Holdings LLC Via Hearthside Finance Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,500 %	01/06/2026	338.165	0,06
	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	01/05/2031	155.000	0,03
721.000	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC Via Hilton Grand Vacations Borrower Escrow 144A(c)	HED	E 000 %	01/06/2020	717 205	0.12
1 462 000		USD	5,000 % 4,875 %	01/06/2029 01/06/2029	717.395 1.384.364	0,13 0,25
	HLF Financing SARL LLC Via Herbalife International, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Imola Merger Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	15/05/2029	1.103.987	0,20
	Iron Mountain, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,250 %	15/07/2030	1.057.800	0,20
	ITT Holdings LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,500 %	01/08/2029	675.887	0,13
	Jane Street Group Via JSG Finance, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	15/11/2029	933.800	0,12
	LCM Investments Holdings II LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	01/05/2029	1.079.032	0,19
	LD Holdings Group LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,125 %	01/04/2028	492.281	0,09
	Level 3 Financing, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,750 %	15/07/2029	1.072.879	0,19
	LGI Homes, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	15/07/2029	1.149.837	0,21
	Lions Gate Capital Holdings LLC 144A(c)	USD	5,500 %	15/04/2029	319.495	0,06
302.000	Lithia Motors, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	01/06/2029	306.530	0,05
1.366.000	LPL Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	15/05/2031	1.383.075	0,25
1.289.000	Madison IAQ LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	30/06/2028	1.258.386	0,23
53.000	Madison IAQ LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,875 %	30/06/2029	51.145	0,01
	Marriott Ownership Resorts, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	15/06/2029	68.688	0,01
	MasTec, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	15/08/2028	652.837	0,12
	Match Group Holdings II LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,625 %	01/10/2031	1.436.387	0,26
	Mattel, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,750 %	01/04/2029	705.892	0,13
	Meritor, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	15/12/2028	183.365	0,03
	Metis Merger Sub LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,500 %	15/05/2029	87.331	0,02
	Michaels Cos., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,875 %	01/05/2029	273.315	0,05
	Midcap Financial Issuer Trust 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,500 %	01/05/2028 15/05/2032	814.481 426.776	0,15
	Molina Healthcare, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %			0,08
	Mozart Debt Merger Sub, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Mozart Debt Merger Sub, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 % 5,250 %	01/04/2029 01/10/2029	727.975 517.400	0,13 0,09
	MSCI, Inc. 144A(c)	USD	3,625 %	01/11/2031	248.880	0,09
	Mueller Water Products, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	15/06/2029	154.530	0,03
	Murphy Oil USA, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,750 %	15/02/2031	237.698	0,04
	Nabors Industries, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,375 %	15/05/2027	847.875	0,15
	Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,125 %	15/12/2030	640.485	0,11
	NESCO Holdings II, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/04/2029	1.450.830	0,26
401.000	Netflix, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	15/06/2030	463.406	0,08
827.000	News Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	15/05/2029	815.629	0,15
490.000	NFP Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	15/08/2028	482.650	0,09
329.000	NFP Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,875 %	15/08/2028	326.533	0,06
203.000	NGL Energy Operating LLC Via NGL Energy Finance Corp. 144A(c)	USD	7,500 %	01/02/2026	204.269	0,04
	Nielsen Finance LLC Via Nielsen Finance Co. 144A(c)	USD	4,500 %	15/07/2029	271.950	0,05
	Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	30/04/2028	199.000	0,04
	Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,125 %	30/04/2031	204.000	0,04
	Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	15/03/2030	180.255	0,03
505.000	Pactiv Evergreen Group Issuer LLC Via Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc.	1105	4.075.01	4514010222	100.05=	2.25
000 000	144A(c)	USD	4,375 %	15/10/2028	493.637	0,09
208.000	PennyMac Financial Services, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	15/02/2029	191.360	0,03

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con			·			·
Estados Unido	es – (continuación)					
485.000	Performance Food Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	01/08/2029	471.663	0,08
1.000.000	PGT Innovations, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	01/10/2029	992.500	0,18
703.000	Pike Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	01/09/2028	710.909	0,13
343.000	Presidio Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,250 %	01/02/2028	354.576	0,06
	Real Hero Merger Sub 2, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,250 %	01/02/2029	128.640	0,02
	Rent-A-Center, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,375 %	15/02/2029	1.427.670	0,26
	ROBLOX Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	01/05/2030	1.091.781	0,20
	Rocket Mortgage LLC Via Rocket Mortgage Co-Issuer, Inc. 144A(c)	USD	3,875 %	01/03/2031	279.174	0,05
	Scotts Miracle-Gro Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	01/04/2031	522.600	0,09
	Scotts Miracle-Gro Co. 144A(c)	USD	4,375 %	01/02/2032	764.225	0,14
	Scripps Escrow II, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,375 %	15/01/2031	392.890	0,07
	Sealed Air Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,875 %	15/07/2033	128.018	0,02
	SeaWorld Parks & Entertainment, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,250 %	15/08/2029	630.000	0,11
	Sensata Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,750 %	15/02/2031	934.175	0,17
	Sirius XM Radio, Inc. 144A(c)	USD	3,125 %	01/09/2026	206.588	0,04
	Sirius XM Radio, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	01/09/2031	553.556	0,10
	Sonic Automotive, Inc. 144A <sup>(C)</sup>	USD	4,625 %	15/11/2029	347.160	0,06
	Sonic Automotive, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	15/11/2031	393.820	0,07
	Square, Inc. 144A <sup>(c)</sup> SRS Distribution, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,500 % 4,625 %	01/06/2031 01/07/2028	848.509 475.069	0,15 0,09
		USD	6,125 %	01/07/2029	809.522	0,09
	SRS Distribution, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Standard Industries, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,375 %	15/01/2031	1.199.700	0,13
	Suburban Propane Partners LP Via Suburban Energy Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	01/06/2031	168.088	0,22
		USD	8,500 %	15/10/2026	902.137	0,03
	Summit Midstream Holdings LLC Via Summit Midstream Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup> Sunoco LP Via Sunoco Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	30/04/2030	1.212.750	0,16
	SWF Escrow Issuer Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,500 %	01/10/2029	476.438	0,22
	Tallgrass Energy Partners LP Via Tallgrass Energy Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,000 %	01/09/2031	799.500	0,09
	Targa Resources Partners LP Via Targa Resources Partners Finance Corp.	OOD	0,000 /0	01/03/2001	755.500	0,14
203.000	144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	15/01/2032	212.175	0,04
475.000	Tempur Sealy International, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	15/10/2031	460.750	0,08
	Tenet Healthcare Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	01/06/2029	513.175	0,09
	Thor Industries, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	15/10/2029	730.100	0,13
	Townsquare Media, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,875 %	01/02/2026	230.450	0,04
1.074.000	Travel & Leisure Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	01/12/2029	1.055.205	0,19
	TTM Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	01/03/2029	1.255.826	0,23
202.000	Uber Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,250 %	15/01/2028	216.645	0,04
1.115.000	Uber Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	15/08/2029	1.109.425	0,20
220.000	Unifrax Escrow Issuer Corp. 144A(c)	USD	5,250 %	30/09/2028	217.250	0,04
140.000	United Airlines, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	15/04/2026	141.750	0,03
180.000	United Airlines, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	15/04/2029	179.775	0,03
590.000	US Foods, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	01/06/2030	592.950	0,11
800.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC 144A(c)	USD	4,125 %	15/08/2031	821.500	0,15
475.000	Vertiv Group Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	15/11/2028	476.188	0,09
920.000	Vistra Operations Co., LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	01/05/2029	902.750	0,16
775.000	Waste Pro USA, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/02/2026	771.125	0,14
518.000	Wolverine Escrow LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,500 %	15/11/2024	488.215	0,09
	WR Grace Holdings LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	15/06/2027	129.968	0,02
1.105.000	WR Grace Holdings LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,625 %	15/08/2029	1.110.525	0,20
402.000	Xerox Holdings Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/08/2028	408.030	0,07
1.496.000	ZoomInfo Technologies LLC Via ZoomInfo Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	01/02/2029	1.462.340	0,26
	NO.				92.884.723	16,72
(coste USD 10					108.263.288	19,49
Tenencias	Descripción del valor				Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	inarias – 0,01 %					
Estados Unido 3.746	<b>os</b> Delphi Financial Group, Inc.—Preferente <sup>(d)</sup>				88.967	0,01
TOTAL DE ACC	CIONES ORDINARIAS (349)				88.967	0,01
TOTAL DE VAL	ORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO				108 252 255	
(coste USD 10	3.32 1.030)				108.352.255	19,50

				Val	or de mercado en	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	USD	% del patrimonio
Otros valores						
Bonos – 1,80 Estados Unido						
	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp. 144A(c)	USD	6,000 %	01/06/2029	309.156	0,06
	Ambience Merger Sub, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	15/07/2028	273.700	0,0
	Ambience Merger Sub, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,125 %	15/07/2029	265.375	0,05
175.000	Beacon Roofing Supply, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	15/05/2029	173.687	0,03
	Broadcom, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,187 %	15/11/2036	325.888	0,06
	CCO Holdings LLC Via CCO Holdings Capital Corp. 144A	USD	4,250 %	15/01/2034	1.142.719	0,21
	Compass Group Diversified Holdings LLC 144A(c)	USD	5,250 %	15/04/2029	587.100	0,11
	DIRECTV Holdings LLC Via DIRECTV Financing Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,875 %	15/08/2027	453.900	0,08
	Glencore Funding LLC 144A <sup>(c)</sup> Jefferies Finance LLC Via JFIN Co-Issuer Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	2,850 % 5,000 %	27/04/2031 15/08/2028	1.080.454 1.053.150	0,19 0,19
	Nabors Industries, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	9,000 %	01/02/2025	449.975	0,08
	Penn National Gaming, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	01/07/2029	1.189.112	0,21
	PennyMac Financial Services, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,375 %	15/10/2025	169.505	0,03
	Playtika Holding Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	15/03/2029	906.752	0,16
	Rocket Mortgage LLC Via Rocket Mortgage Co-Issuer, Inc. 144A(c)	USD	2,875 %	15/10/2026	752.680	0,13
	Rocket Mortgage LLC Via Rocket Mortgage Co-Issuer, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	15/10/2033	795.600	0,14
	Wheel Pros, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,500 %	15/05/2029	92.447	0,02
					10.021.200	1,80
TOTAL DE BO (coste USD 10					10.021.200	1,80
TOTAL DE OT	ROS VALORES MOBILIARIOS					
(coste USD 10	RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS				10.021.200	1,80
(coste USD 47					471.298.577	84,83
Contratos de	futuros - 0,41 %					
					B1 1'	
Número de				Compromiso Valor de mercado	Plusvalía latente	% de
contratos	Descripción del valor			USD	en USD	patrimonio
	CAD					
1						
	Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022		Larga	110.928	2.545	0,00
	EUR					
11	<b>EUR</b> Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/		Larga	1.407.402	1.940	0,00
11	EUR					0,00
11	<b>EUR</b> Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/		Larga	1.407.402	1.940	0,00
11 17	EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/F		Larga Larga	1.407.402 2.623.747 4.031.149	1.940 1.229 3.169	0,00 0,00 0,00
11 17 55	EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Federal de Alemani	12/2021	Larga Larga Larga	1.407.402 2.623.747 4.031.149 5.200.352	1.940 1.229 3.169 33.963	0,00 0,00 0,00
11 17 55	EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/F	12/2021	Larga Larga	1.407.402 2.623.747 4.031.149	1.940 1.229 3.169	0,00 0,00 0,00
11 17 55	EUR Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Federal de Alemani	12/2021	Larga Larga Larga	1.407.402 2.623.747 4.031.149 5.200.352	1.940 1.229 3.169 33.963	0,000 0,000 0,000 0,01 0,01
11 17 55 7	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/FeDEP Futuros sobre el FTSE 100 Index 17/12/2021 Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/202	12/2021	Larga Larga Larga	1.407.402 2.623.747 4.031.149 5.200.352 1.185.228	1.940 1.229 3.169 33.963 15.831	0,00 0,00 0,00 0,00
11 17 55 7	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Futuros sobre el FTSE 100 Index 17/12/2021 Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/202.  USD Futuros sobre el E-Mini S&P 500 Index 17/12/2021	12/2021	Larga Larga Larga	1.407.402 2.623.747 4.031.149 5.200.352 1.185.228 6.385.580 70.850.475	1.940 1.229 3.169 33.963 15.831 49.794	0,00 0,00 0,00 0,00 0,01 0,01
11 17 55 7 306 25	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/FEDERA DE LA CONTRO DEL CONTRO DEL CONTRO DE LA CONTRO DEL CONTRO DEL CONTRO DE LA CONTRO DEL CONTRO DE LA CONTRO DEL CONTRO DE LA CONTRO D	12/2021	Larga Larga Larga Larga Larga	1.407.402 2.623.747 4.031.149 5.200.352 1.185.228 6.385.580 70.850.475 4.049.219	1.940 1.229 3.169 33.963 15.831 49.794 2.726.592 98.585	0,00 0,00 0,00 0,01 0,00 0,01
11 17 55 7 306 25 540	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/FEDERA DE LA CONTRO DEL CONTRO DE LA CONTRO DEL CONTRO DE LA CONTRO DEL CONTRO DEL CONTRO DE LA CONTRO DE LA CONTRO DE LA CONTRO DE LA CONTRO DEL CONTRO DE LA CONTRO DEL CONTRO	12/2021	Larga Larga Larga Larga	1.407.402 2.623.747 4.031.149 5.200.352 1.185.228 6.385.580 70.850.475 4.049.219 70.773.750	1.940 1.229 3.169 33.963 15.831 49.794 2.726.592 98.585 841.341	0,00 0,00 0,00 0,01 0,01 0,02 0,02 0,02
11 17 55 7 306 25 540 94	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Futuros sobre el FTSE 100 Index 17/12/2021 Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022  Futuros sobre el E-Mini S&P 500 Index 17/12/2021 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022	12/2021	Larga Larga Larga Larga Larga Larga Larga Larga	1.407.402 2.623.747 4.031.149 5.200.352 1.185.228 6.385.580 70.850.475 4.049.219 70.773.750 20.588.203	1.940 1.229 3.169 33.963 15.831 49.794 2.726.592 98.585 841.341 62.779	0,000 0,000 0,000 0,01 0,01 0,48 0,02 0,02 0,15
11 17 55 7 306 25 540 94 31	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/FUTUROS SOBRE EL TONO INDES EL TONO	2	Larga	1.407.402 2.623.747 4.031.149 5.200.352 1.185.228 6.385.580 70.850.475 4.049.219 70.773.750 20.588.203 3.772.555	1.940 1.229 3.169 33.963 15.831 49.794 2.726.592 98.585 841.341 62.779 38.196	0,000 0,000 0,000 0,01 0,000 0,01 0,48 0,022 0,18 0,01 0,01
11 17 55 7 306 25 540 94 31	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Futuros sobre el FTSE 100 Index 17/12/2021 Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022  Futuros sobre el E-Mini S&P 500 Index 17/12/2021 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022	2	Larga Larga Larga Larga Larga Larga Larga Larga	1.407.402 2.623.747 4.031.149 5.200.352 1.185.228 6.385.580 70.850.475 4.049.219 70.773.750 20.588.203	1.940 1.229 3.169 33.963 15.831 49.794 2.726.592 98.585 841.341 62.779	0,00 0,00 0,00 0,01 0,00 0,01 0,49 0,02 0,15 0,01
11 17 55 7 306 25 540 94 31	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/FUTUROS SOBRE EL TONO INDES EL TONO	2	Larga	1.407.402 2.623.747 4.031.149 5.200.352 1.185.228 6.385.580 70.850.475 4.049.219 70.773.750 20.588.203 3.772.555	1.940 1.229 3.169 33.963 15.831 49.794 2.726.592 98.585 841.341 62.779 38.196	0,00 0,00 0,00 0,00 0,01 0,49 0,02 0,15 0,01 0,04 0,72
11 17 55 7 306 25 540 94 31 39	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/FUTUROS SOBRE EL TONO INDES EL TONO	2	Larga	1.407.402 2.623.747 4.031.149 5.200.352 1.185.228 6.385.580 70.850.475 4.049.219 70.773.750 20.588.203 3.772.555 7.790.250	1.940 1.229 3.169 33.963 15.831 49.794 2.726.592 98.585 841.341 62.779 38.196 226.714	0,000 0,000 0,001 0,001 0,001 0,49 0,022 0,15 0,01 0,01
11 17 55 7 306 25 540 94 31 39	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Futuros sobre el FTSE 100 Index 17/12/2021 Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022  Futuros sobre el E-Mini S&P 500 Index 17/12/2021 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a va plazo 22/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a va plazo 22/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2020	2	Larga	1.407.402 2.623.747 4.031.149 5.200.352 1.185.228 6.385.580 70.850.475 4.049.219 70.773.750 20.588.203 3.772.555 7.790.250	1.940 1.229 3.169 33.963 15.831 49.794 2.726.592 98.585 841.341 62.779 38.196 226.714 3.994.207	0,00 0,00 0,00 0,01 0,01 0,02 0,15 0,01 0,01 0,04 0,02 0,72
11 17 55 7 306 25 540 94 31 39 PLUSVALÍA Li	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Futuros sobre el FTSE 100 Index 17/12/2021 Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/202 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/202 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/202  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS  Descripción del valor	2	Larga	1.407.402 2.623.747 4.031.149 5.200.352 1.185.228 6.385.580 70.850.475 4.049.219 70.773.750 20.588.203 3.772.555 7.790.250 177.824.452 Compromiso Valor de mercado USD	1.940 1.229 3.169 33.963 15.831 49.794 2.726.592 98.585 841.341 62.779 38.196 226.714 3.994.207 4.049.715 Minusvalía latente en USD	0,00 0,00 0,00 0,01 0,01 0,02 0,02 0,01 0,01
11 17 55 7 306 25 540 94 31 39 PLUSVALÍA Li	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/ Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/  GBP Futuros sobre el FTSE 100 Index 17/12/2021 Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/202  USD Futuros sobre el E-Mini S&P 500 Index 17/12/2021 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/202  Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/203  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS	2	Larga	1.407.402 2.623.747 4.031.149 5.200.352 1.185.228 6.385.580 70.850.475 4.049.219 70.773.750 20.588.203 3.772.555 7.790.250 177.824.452 Compromiso Valor de mercado	1.940 1.229 3.169 33.963 15.831 49.794 2.726.592 98.585 841.341 62.779 38.196 226.714 3.994.207 4.049.715	0,00 0,00 0,00 0,01 0,01 0,02 0,15 0,01 0,01 0,04 0,02 0,72
11 17 55 7 306 25 540 94 31 39 PLUSVALÍA Li Número de contratos	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Futuros sobre el FTSE 100 Index 17/12/2021 Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/202 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/202 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/202  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS  Descripción del valor	2 22 22	Larga	1.407.402 2.623.747 4.031.149 5.200.352 1.185.228 6.385.580 70.850.475 4.049.219 70.773.750 20.588.203 3.772.555 7.790.250 177.824.452 Compromiso Valor de mercado USD	1.940 1.229 3.169 33.963 15.831 49.794 2.726.592 98.585 841.341 62.779 38.196 226.714 3.994.207 4.049.715 Minusvalía latente en USD	0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,01 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00
11 17 55 7 306 25 540 94 31 39 PLUSVALÍA Li Número de contratos	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Futuros sobre el FTSE 100 Index 17/12/2021 Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/202 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/202 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/202  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS  Descripción del valor  EUR Futuros sobre el Euro STOXX 50 Index 17/12/2021	2 22 22	Larga	1.407.402 2.623.747 4.031.149 5.200.352 1.185.228 6.385.580 70.850.475 4.049.219 70.773.750 20.588.203 3.772.555 7.790.250 177.824.452 Compromiso Valor de mercado USD	1.940 1.229 3.169 33.963 15.831 49.794 2.726.592 98.585 841.341 62.779 38.196 226.714 3.994.207 4.049.715 Minusvalía latente en USD	0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,02 0,14 0,02 0,04 0,02 0,04 0,02 0,04 0,02 0,04 0,02 0,04 0,02 0,04 0,02 0,04 0,02 0,04 0,02 0,04 0,05 0,06 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07
11 17 55 7 306 25 540 94 31 39 PLUSVALÍA Li Número de contratos	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Futuros sobre el FTSE 100 Index 17/12/2021 Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/202 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/202 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/202  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS  Descripción del valor  EUR Futuros sobre el Euro STOXX 50 Index 17/12/2021	2 22 22	Larga	1.407.402 2.623.747 4.031.149 5.200.352 1.185.228 6.385.580 70.850.475 4.049.219 70.773.750 20.588.203 3.772.555 7.790.250 177.824.452 Compromiso Valor de mercado USD	1.940 1.229 3.169 33.963 15.831 49.794 2.726.592 98.585 841.341 62.779 38.196 226.714 3.994.207 4.049.715 Minusvalia latente en USD (198.300) (1.434)	0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,72 0,73 % de patrimonio (0,04 (0,04
11 17 55 7 306 25 540 94 31 39 PLUSVALÍA L	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/Futuros sobre el FTSE 100 Index 17/12/2021 Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/202 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/203  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS  Descripción del valor  EUR Futuros sobre el Euro STOXX 50 Index 17/12/2021 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años 08	2 22 22	Larga	1.407.402 2.623.747 4.031.149 5.200.352 1.185.228 6.385.580 70.850.475 4.049.219 70.773.750 20.588.203 3.772.555 7.790.250 177.824.452 Compromiso Valor de mercado USD	1.940 1.229 3.169 33.963 15.831 49.794 2.726.592 98.585 841.341 62.779 38.196 226.714 3.994.207 4.049.715 Minusvalia latente en USD (198.300) (1.434)	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,1 0,0 0,0 0,7 0,7 % depatrimonic

Número de contratos	Descripción del valor				Compromiso Valor de mercado USD	Minusvalía latente en USD	% de patrimonio
	USD				,		
17	Futuros sobre el E-Mini S&P 500 Index 17/12	/2021		Larga	3.936.138	(2.187)	(0,00
(225)	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU	. a 10 años 22/03/2022		Corta	(29.489.063)	(463.499)	(0,08
(129)	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU	. a muy largo plazo a 10 a	años 22/03/2022	Corta	(18.960.984)	(386.726)	(0,07
					(44.513.909)	(852.412)	(0,15
MINUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTURO	s				(1.756.853)	(0,32
Contratos de	divisas a plazo - 0,04 %						
					Fecha	Plusvalía latente	% de
Divisa	Compra Divisa	Ven			de vencimiento	en USD	patrimonio
JSD	2.347.787 SEK	20.223.30			20/01/2022	100.751	0,02
JSD	20.110.557 GBP	14.655.3			21/01/2022	514.831	0,09
JSD	13.741.738 CHF	12.560.13			25/01/2022	664	0,00
JSD	1.368.964 AUD	1.848.5	57		31/01/2022	44.232	0,0
JSD	1.555.106 SGD	2.098.8	72		07/02/2022	16.509	0,00
PLUSVALÍA LA	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A	PLAZO				676.987	0,12
					Fecha	Minusvalía latente	% de
Divisa	Compra Divisa	Ven	ta		de vencimiento	en USD	patrimonio
JSD	2.685.127 TWD	74.496.00	00		12/01/2022	(14.786)	(0,00
JSD	43.984.910 EUR	38.917.12	22		10/02/2022	(397.781)	(0,07
JSD	2.247.049 JPY	255.537.85	56		16/02/2022	(24.969)	(0,01
	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS	A					
						(437.536)	(0,08
PLAZO						(1111111)	
PLAZO Contratos de	divisas a plazo específicos de una clase	e de acciones - (0,53 %	%)				
	divisas a plazo específicos de una clase	e de acciones – (0,53 %	%)		Forha	Plusvalía	% de
Contratos de	divisas a plazo específicos de una clase	e de acciones – (0,53 %	,		Fecha de vencimiento		% de
Contratos de		•	ta			Plusvalía latente	
Contratos de Divisa USD	Compra Divisa	<b>Ven</b> 4.089.00	nta 00	DBERTURA	de vencimiento	Plusvalía latente en USD	patrimonio
Contratos de Divisa USD	Compra Divisa 3.008.001 AUD	<b>Ven</b> 4.089.00	nta 00	DBERTURA	de vencimiento 15/12/2021	Plusvalía latente en USD 79.076 79.076 Minusvalía	patrimonio 0,02 0,02
Contratos de Divisa JSD PLUSVALÍA LA	Compra Divisa 3.008.001 AUD	<b>Ven</b> 4.089.00	ota DO CON FINES DE CO	DBERTURA	de vencimiento	Plusvalía latente en USD 79.076	patrimonio 0,02
Contratos de Divisa USD PLUSVALÍA LA	Compra Divisa 3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa	Ven 4.089.00 A PLAZO CELEBRADOS Ven	ota DO CON FINES DE CO	BERTURA	de vencimiento 15/12/2021  Fecha de vencimiento	Plusvalia latente en USD 79.076 79.076 Minusvalia latente en USD	patrimonio 0,02 0,02 % de patrimonio
Contratos de Divisa USD PLUSVALÍA LA Divisa	Compra Divisa 3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa 72.751.000 USD	Ven 4.089.00 A PLAZO CELEBRADOS  Ven 53.647.8:	ota  CON FINES DE CO  nta	DBERTURA	de vencimiento 15/12/2021  Fecha de vencimiento 15/12/2021	Plusvalia latente en USD 79.076 79.076 Minusvalia latente en USD (1.536.737)	patrimonio 0,02 0,02
Contratos de Divisa  JSD  PLUSVALÍA LA  Divisa  AUD  EUR	Compra Divisa 3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa  72.751.000 USD 25.699.106 USD	Ven 4.089.00 A PLAZO CELEBRADOS Ven 53.647.8: 30.394.9:	con FINES DE CO	DBERTURA	de vencimiento 15/12/2021  Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021	Plusvalia latente en USD 79.076 79.076 Minusvalia latente en USD (1.536.737) (1.140.172)	patrimonio 0,02 0,02 % de patrimonio (0,27 (0,21
Contratos de  Divisa  JSD  PLUSVALÍA LA  Divisa  AUD  EUR  GBP	Compra Divisa 3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa 72.751.000 USD 25.699.106 USD 8.685.854 USD	Ven 4.089.00 A PLAZO CELEBRADOS Ven 53.647.8: 30.394.9: 11.976.1-	con FINES DE CO	DBERTURA	Fecha de vencimiento  15/12/2021  Fecha de vencimiento  15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021	Plusvalia latente en USD 79.076 79.076 Minusvalia latente en USD (1.536.737) (1.140.172) (369.932)	% de patrimonie (0,27 (0,21 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,07 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0,05 (0
Contratos de  Divisa  USD  PLUSVALÍA LA  Divisa  AUD  EUR  EBP  EGD	Compra Divisa  3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa  72.751.000 USD 25.699.106 USD 8.685.854 USD 251.000 USD	Ven 4.089.00 A PLAZO CELEBRADOS Ven 53.647.8 30.394.9 11.976.1 186.7	ota CON FINES DE CO ta 24 33 40 01	DBERTURA	Fecha de vencimiento  15/12/2021  Fecha de vencimiento  15/12/2021  15/12/2021  15/12/2021	Plusvalia latente en USD 79.076 79.076 Minusvalia latente en USD (1.536.737) (1.140.172) (369.932) (2.661)	patrimonio 0,02 0,02 % de patrimonio (0,27 (0,21 (0,07 (0,00
Contratos de  Divisa  JSD  PLUSVALÍA LA  Divisa  AUD  EUR  BBP  GGD  JSD	Compra Divisa 3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa 72.751.000 USD 25.699.106 USD 8.685.854 USD	Ven 4.089.00 A PLAZO CELEBRADOS Ven 53.647.8; 30.394.9; 11.976.1- 186.7( 7.00	ota CON FINES DE CO nta 24 33 40 01		Fecha de vencimiento  15/12/2021  Fecha de vencimiento  15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021	Plusvalia latente en USD 79.076 79.076 Minusvalia latente en USD (1.536.737) (1.140.172) (369.932)	% de patrimonie (0,27 (0,02 (0,00 (0,00 (0,00
Contratos de  Divisa  USD  PLUSVALÍA LA  Divisa  AUD  EUR  GBP  SGD  USD	Compra Divisa  3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa  72.751.000 USD 25.699.106 USD 8.685.854 USD 251.000 USD 5.116 SGD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS	Ven 4.089.00 A PLAZO CELEBRADOS Ven 53.647.8; 30.394.9; 11.976.1- 186.7( 7.00	ota CON FINES DE CO nta 24 33 40 01		Fecha de vencimiento  15/12/2021  Fecha de vencimiento  15/12/2021  15/12/2021  15/12/2021	Plusvalia latente en USD 79.076 79.076 Minusvalia latente en USD (1.536.737) (1.140.172) (369.932) (2.661) (17)	patrimonio 0,02 0,02 % de patrimonio (0,27 (0,21 (0,07 (0,00
Contratos de  Divisa  JSD  PLUSVALÍA LA  Divisa  AUD  EUR  GBP  GGD  JSD	Compra Divisa  3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa  72.751.000 USD 25.699.106 USD 8.685.854 USD 251.000 USD 5.116 SGD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS	Ven 4.089.00 A PLAZO CELEBRADOS Ven 53.647.8; 30.394.9; 11.976.1- 186.7( 7.00	ota CON FINES DE CO nta 24 33 40 01		Fecha de vencimiento  15/12/2021  Fecha de vencimiento  15/12/2021  15/12/2021  15/12/2021	Plusvalia latente en USD 79.076 79.076 Minusvalia latente en USD (1.536.737) (1.140.172) (369.932) (2.661) (17)	% de patrimonie (0,27 (0,02 (0,00 (0,00 (0,00
Contratos de Divisa USD PLUSVALÍA LA Divisa AUD EUR EBP EBP SGD USD	Compra Divisa  3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa  72.751.000 USD 25.699.106 USD 8.685.854 USD 251.000 USD 5.116 SGD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS	Ven 4.089.00 A PLAZO CELEBRADOS Ven 53.647.8; 30.394.9; 11.976.1- 186.7( 7.00	ota CON FINES DE CO nta 24 33 40 01		de vencimiento  15/12/2021  Fecha de vencimiento  15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021	Plusvalia latente en USD 79.076 79.076 Minusvalia latente en USD (1.536.737) (1.140.172) (369.322) (2.661) (17) (3.049.519) Valor de mercado en	% de patrimonie (0,27 (0,02 (0,00 (0,00 (0,00
Contratos de Divisa USD PLUSVALÍA LA Divisa AUD EUR GBP GGD USD MINUSVALÍA L	Compra Divisa 3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa  72.751.000 USD 25.699.106 USD 8.685.854 USD 251.000 USD 5.116 SGD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS  0,03 %)  Descripción del valor  Opciones suscritas	Ven 4.089.00 A PLAZO CELEBRADOS Ven 53.647.8; 30.394.9; 11.976.1- 186.7( 7.00	ota CON FINES DE CO nta 24 33 40 01		Fecha de vencimiento  15/12/2021  Fecha de vencimiento  15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 Plusvalia /(minusvalia) latente	Plusvalia latente en USD 79.076 79.076 Minusvalia latente en USD (1.536.737) (1.140.172) (369.322) (2.661) (17) (3.049.519) Valor de mercado en	patrimonio 0,03  % de patrimoni (0,27 (0,21 (0,07 (0,00 (0,00) (0,55
Contratos de Divisa USD PLUSVALÍA LA Divisa AUD EUR EBP EGD USD MINUSVALÍA L Opciones – (6	Compra Divisa 3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa  72.751.000 USD 25.699.106 USD 8.685.854 USD 251.000 USD 5.116 SGD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS 0,03 %)  Descripción del valor  Opciones suscritas EUR	Ven 4.089.00 A PLAZO CELEBRADOS  Ven 53.647.8: 30.394.9: 11.976.1- 186.70 7.00 A PLAZO CELEBRADOS	ota CON FINES DE CO  nta 24 33 40 01 00 S CON FINES DE C	OBERTURA	de vencimiento 15/12/2021  Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021	Plusvalia latente en USD 79.076 79.076 Minusvalia latente en USD (1.536.737) (1.140.172) (36.932) (2.661) (17) (3.049.519)  Valor de mercado en USD	patrimonio 0,02 0,02 % de patrimonio (0,27 (0,21 (0,07 (0,00 (0,00 (0,55)
Contratos de Divisa USD PLUSVALÍA LA Divisa AUD EUR BBP JSD MINUSVALÍA L Opciones – (0	Compra Divisa  3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa  72.751.000 USD 25.699.106 USD 8.685.854 USD 251.000 USD 5.116 SGD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS 0,03 %)  Descripción del valor  Opciones suscritas EUR Call DJ EURO STOXX 50 Index	Vence 03/12/2021	con FINES DE CO  nta 24 33 40 01 00 S CON FINES DE CO	<b>OBERTURA</b> 4.425,00	### Recharate	Plusvalia latente en USD 79.076  79.076  Minusvalia latente en USD (1.536.737) (1.140.172) (369.932) (2.661) (17)  (3.049.519)  Valor de mercado en USD (887)	patrimonio 0,02 0,02 % de patrimonio (0,27 (0,21 (0,07 (0,00 (0,00 (0,55)
Contratos de Divisa USD PLUSVALÍA LA Divisa AUD EUR BBP GGD USD MINUSVALÍA L Opciones — (0 1.560) (1.600)	Compra Divisa  3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa  72.751.000 USD 25.699.106 USD 8.685.854 USD 251.000 USD 5.116 SGD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS  0,03 %)  Descripción del valor  Opciones suscritas EUR Call DJ EURO STOXX 50 Index Call DJ EURO STOXX 50 Index	Vence 03/12/2021 Vence 07/12/2021	ota CON FINES DE CO  nta 24 33 40 01 00 S CON FINES DE CO  Precio de ejercicio e Precio de ejercicio e	<b>OBERTURA</b> 4.425,00 4.425,00 4.450,00	## de vencimiento ### 15/12/2021    Fecha de vencimiento   15/12/2021   15/12/2021   15/12/2021   15/12/2021   15/12/2021     ### 15/12/2021   15/12/2021     Plusvalía /(minusvalía) latente USD   34.962   35.317	Plusvalia latente en USD 79.076  79.076  Minusvalia latente en USD (1.536.737) (1.140.172) (369.932) (2.661) (17)  (3.049.519)  Valor de mercado en USD (887) (1.821)	patrimonio 0,02 0,02 (0,27 (0,21 (0,07 (0,00 (0,00 (0,55) % del patrimonio (0,00 (0,00 (0,00)
Contratos de Divisa USD PLUSVALÍA LA Divisa AUD EUR BBP GGD USD MINUSVALÍA L Opciones — (0 1.560) (1.600)	Compra Divisa  3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa  72.751.000 USD 25.699.106 USD 8.685.854 USD 251.000 USD 5.116 SGD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS 0,03 %)  Descripción del valor  Opciones suscritas EUR Call DJ EURO STOXX 50 Index	Vence 03/12/2021	con FINES DE CO  nta 24 33 40 01 00 S CON FINES DE CO	<b>OBERTURA</b> 4.425,00 4.425,00 4.450,00	### Recharate	Plusvalia latente en USD 79.076  79.076  Minusvalia latente en USD (1.536.737) (1.140.172) (369.932) (2.6661) (17)  (3.049.519)  Valor de mercado en USD (887)	patrimonio 0,02 0,02 % de patrimonio (0,27 (0,21 (0,07 (0,00 (0,00 (0,55)
Contratos de Divisa USD PLUSVALÍA LA Divisa AUD EUR BBP GGD JISD MINUSVALÍA L Opciones – (0 1.560) (1.600)	Compra Divisa  3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa  72.751.000 USD 25.699.106 USD 8.685.854 USD 251.000 USD 5.116 SGD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS  0,03 %)  Descripción del valor  Opciones suscritas EUR Call DJ EURO STOXX 50 Index Call DJ EURO STOXX 50 V2 Index	Vence 03/12/2021 Vence 07/12/2021	ota CON FINES DE CO  nta 24 33 40 01 00 S CON FINES DE CO  Precio de ejercicio e Precio de ejercicio e	<b>OBERTURA</b> 4.425,00 4.425,00 4.450,00	## de vencimiento ### 15/12/2021    Fecha de vencimiento   15/12/2021   15/12/2021   15/12/2021   15/12/2021   15/12/2021     ### 15/12/2021   15/12/2021     Plusvalía /(minusvalía) latente USD   34.962   35.317	Plusvalia latente en USD 79.076  79.076  Minusvalia latente en USD (1.536.737) (1.140.172) (369.932) (2.661) (17)  (3.049.519)  Valor de mercado en USD (887) (1.821)	patrimoni 0,0 0,0 0,0 % de patrimoni (0,27 (0,21 (0,07 (0,00 (0,00 (0,55) % del patrimoni (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00
Contratos de Divisa USD PLUSVALÍA LA Divisa UUD UUR GGD USD MINUSVALÍA L Dociones — (6 enencias (1.560) (1.600) (1.580)	Compra Divisa  3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa  72.751.000 USD 25.699.106 USD 8.685.854 USD 251.000 USD 5.116 SGD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS  0,03 %)  Descripción del valor  Opciones suscritas EUR Call DJ EURO STOXX 50 Index Call DJ EURO STOXX 50 Index Call DJ EURO STOXX 50 W2 Index	Vence 03/12/2021 Vence 10/12/2021	Precio de ejercicio e Precio e Precio de ejercicio e Precio e Pr	<b>OBERTURA</b> 4.425,00 4.450,00 4.450,00	de vencimiento  15/12/2021  Fecha de vencimiento  15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021  Plusvalia /(minusvalia) latente USD  34.962 35.317 31.346 101.625	Plusvalia latente en USD 79.076  79.076  Minusvalia latente en USD (1.536.737) (1.140.172) (369.932) (2.661) (17)  Valor de mercado en USD (887) (1.821) (899) (3.607)	patrimonio 0,02 0,02 (0,27 (0,21 (0,07 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00
Contratos de Divisa USD PLUSVALÍA LA Divisa RUD SUR GBP GGD USD MINUSVALÍA L Opciones — (6 1.560) (1.560) (1.580)	Compra Divisa  3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa  72.751.000 USD 25.699.106 USD 8.685.854 USD 251.000 USD 5.116 SGD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS  0,03 %)  Descripción del valor  Opciones suscritas EUR Call DJ EURO STOXX 50 Index Call DJ EURO STOXX 50 W2 Index  GBP Call FTSE 100 Index	Vence 03/12/2021 Vence 07/12/2021	ota CON FINES DE CO  nta 24 33 40 01 00 S CON FINES DE CO  Precio de ejercicio e Precio de ejercicio e	<b>OBERTURA</b> 4.425,00 4.450,00 4.450,00	de vencimiento  15/12/2021  Fecha de vencimiento  15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021  Plusvalia /(minusvalia) latente USD  34.962 35.317 31.346	Plusvalia latente en USD 79.076  79.076  Minusvalia latente en USD (1.536.737) (1.140.172) (369.932) (2.661) (17)  (3.049.519)  Valor de mercado en USD (887) (1.821) (899)	patrimoni 0,0 0,0 0,0 % de patrimoni (0,27 (0,21 (0,07 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00
Contratos de Divisa USD PLUSVALÍA LA Divisa UUD UUR GGD USD MINUSVALÍA L Dociones — (6 enencias (1.560) (1.600) (1.580)	Compra Divisa  3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa  72.751.000 USD 25.699.106 USD 8.685.854 USD 251.000 USD 5.116 SGD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS  0,03 %)  Descripción del valor  Opciones suscritas EUR Call DJ EURO STOXX 50 Index Call DJ EURO STOXX 50 Index Call DJ EURO STOXX 50 W2 Index	Vence 03/12/2021 Vence 10/12/2021	Precio de ejercicio e Precio e Precio de ejercicio e Precio e Pr	<b>OBERTURA</b> 4.425,00 4.450,00 4.450,00	de vencimiento  15/12/2021  Fecha de vencimiento  15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021  Plusvalia /(minusvalia) latente USD  34.962 35.317 31.346 101.625	Plusvalia latente en USD 79.076  79.076  Minusvalia latente en USD (1.536.737) (1.140.172) (369.932) (2.661) (17)  Valor de mercado en USD (887) (1.821) (899) (3.607)	patrimonio 0,02 % de patrimoni (0,27 (0,21 (0,07 (0,00 (0,05) % del patrimonio (0,00 (0,00 (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
Contratos de Divisa USD PLUSVALÍA LA Divisa UUD UUR GGD USD MINUSVALÍA L Opciones — (0 enencias (1.560) (1.600) (1.580)	Compra Divisa  3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa  72.751.000 USD 25.699.106 USD 8.685.854 USD 251.000 USD 5.116 SGD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS  0,03 %)  Descripción del valor  Opciones suscritas EUR Call DJ EURO STOXX 50 Index Call DJ EURO STOXX 50 Index Call DJ EURO STOXX 50 W2 Index  GBP Call FTSE 100 Index  JPY	Vence 03/12/2021 Vence 10/12/2021	con FINES DE CO  nta  24  33  40  01  00  S CON FINES DE CO  Precio de ejercicio de	4.425,00 4.450,00 4.450,00 7.400,00 ejercicio	de vencimiento  15/12/2021  Fecha de vencimiento  15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021  Plusvalia /(minusvalia) latente USD  34.962 35.317 31.346 101.625	Plusvalia latente en USD 79.076  79.076  Minusvalia latente en USD (1.536.737) (1.140.172) (369.932) (2.661) (17)  (3.049.519)  Valor de mercado en USD (887) (1.821) (899) (3.607)	patrimoni 0,0 0,0 0,0 % de patrimoni (0,27 (0,21 (0,07 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00) (0,00 (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
ivisa SD LUSVALÍA L  ivisa UD UR BBP GD SD IINUSVALÍA I  Opciones — (6 enencias  (1.560) (1.580)	Compra Divisa  3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa  72.751.000 USD 25.699.106 USD 8.685.854 USD 251.000 USD 5.116 SGD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS  0,03 %)  Descripción del valor  Opciones suscritas EUR Call DJ EURO STOXX 50 Index Call DJ EURO STOXX 50 W2 Index  GBP Call FTSE 100 Index	Vence 17/12/2021	con FINES DE CO  nta  24  33  40  01  00  S CON FINES DE CO  Precio de ejercicio de	4.425,00 4.450,00 4.450,00 7.400,00	de vencimiento 15/12/2021  Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021  Plusvalia /(minusvalia) latente USD  34.962 35.317 31.346 101.625	Plusvalia latente en USD 79.076  79.076  Minusvalia latente en USD (1.536.737) (1.140.172) (369.932) (2.661) (17)  Valor de mercado en USD (887) (1.821) (899) (3.607)	patrimoni 0,0 0,0 0,0 % de patrimoni (0,27 (0,21 (0,07 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00
Contratos de Divisa USD PLUSVALÍA LA DIVISA UUD GUR GGD USD MINUSVALÍA L Dipciones — (0 enencias (1.560) (1.580)	Compra Divisa  3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa  72.751.000 USD 25.699.106 USD 8.685.854 USD 251.000 USD 5.116 SGD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS  0,03 %)  Descripción del valor  Opciones suscritas EUR Call DJ EURO STOXX 50 Index Call DJ EURO STOXX 50 Index Call DJ EURO STOXX 50 W2 Index  GBP Call FTSE 100 Index  JPY	Vence 17/12/2021	con FINES DE CO  nta  24  33  40  01  00  S CON FINES DE CO  Precio de ejercicio de	4.425,00 4.450,00 4.450,00 7.400,00 ejercicio	de vencimiento 15/12/2021  Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021  Plusvalia /(minusvalia) latente USD  34.962 35.317 31.346 101.625	Plusvalia latente en USD 79.076  79.076  Minusvalia latente en USD (1.536.737) (1.140.172) (369.932) (2.661) (17)  (3.049.519)  Valor de mercado en USD (887) (1.821) (899) (3.607)	patrimoni 0,0 0,0 0,0 % de patrimoni (0,27 (0,21 (0,07 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00 (0,00) (0,00 (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
Contratos de Divisa USD PLUSVALÍA LA DIVISA USD USON USON USON USON USON USON USON USON	Compra Divisa  3.008.001 AUD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A  Compra Divisa  72.751.000 USD 25.699.106 USD 8.685.854 USD 251.000 USD 5.116 SGD  ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS  0,03 %)  Descripción del valor  Opciones suscritas EUR Call DJ EURO STOXX 50 Index Call DJ EURO STOXX 50 W2 Index  GBP Call FTSE 100 Index  JPY  Call NIKKEI 225 Index	Vence 17/12/2021	con FINES DE CO  nta  24  33  40  01  00  S CON FINES DE CO  Precio de ejercicio de	4.425,00 4.450,00 4.450,00 7.400,00 ejercicio 0.000,00	de vencimiento 15/12/2021  Fecha de vencimiento 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021  Plusvalia /(minusvalia) latente USD  34.962 35.317 31.346 101.625	Plusvalia latente en USD 79.076  79.076  Minusvalia latente en USD (1.536.737) (1.140.172) (369.932) (2.661) (17)  (3.049.519)  Valor de mercado en USD (887) (1.821) (899) (3.607)	patrimoni

#### Opciones - (continuación)

Tenencias	Descripción del valor			Plusvalía /(minusvalía) latente USD	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	Opciones suscritas – (c	continuación)				
	USD – (continuación)	•				
(5.300)	Call S&P 500 Index	Vence 15/12/2021	Precio de ejercicio 4.790,00	73.298	(31.005)	(0,01)
(5.400)	Call S&P 500 Index	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 4.790,00	55.337	(68.310)	(0,01
				318.333	(117.323)	(0,02)
TOTAL DE OPO	CIONES SUSCRITAS 11.882))				(137.507)	(0,03)
TOTAL DE OPO					(137.507)	(0,03)
Contratos de	permutas financieras – (	0.00 %				
Importe teórico		7			Plusvalía latente en	% del
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	USD	patrimonio
	Permutas de incumplia crediticio (CDS)	miento				
35.000	Fijo 1,000 %	Variable (Transocean, Inc.)	USD	20/12/2022	1.957	0,00
PLUSVALÍA LA	ATENTE SOBRE PERMUTA	S DE INCUMPLIMIENTO CREDITICIO (	CDS)		1.957	0,00
TOTAL DE PLU	JSVALÍA LATENTE SOBRE	CONTRATOS DE PERMUTAS FINANC	IERAS		1.957	0,00
VALOR DE ME (coste USD 47	RCADO DE LAS INVERSIO 0.635.016)	DNES			470.724.897	84,72
OTROS ACTIV	OS Y PASIVOS				84.851.144	15,28
PATRIMONIO					555.576.041	100,00
TOTAL DE INV	ERSIONES			Va	lor de mercado en USD	% de
Total inversione	es excluyendo derivados (cos	ste USD 471.346.898)			471.298.577	84,83
	e sobre contratos de futuros	•			4.049.715	0,73
Minusvalía later	nte sobre contratos de futuro	os			(1.756.853)	(0,32)
Plusvalía latent	e sobre contratos de divisas	a plazo			676.987	0,12
Minusvalía later	nte sobre contratos de divisa	is a plazo			(437.536)	(0,08)
Plusvalía latent	e sobre contratos de divisas	a plazo celebrados con fines de cobertur	ra e		79.076	0,02
		is a plazo celebrados con fines de cobert	ura		(3.049.519)	(0,55)
	do de opciones suscritas (co	* **			(137.507)	(0,03
	e sobre contratos de permut	as financieras			1.957 84.851.144	0,00 15.28
Otros activos y	μασίνυς					
Patrimonio					555.576.041	100,00

El Comisionista de futuros fue Credit Suisse Securities (USA) LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Deutsche Bank AG, Morgan Stanley & Co., Inc. y State Street Bank & Trust.

La contraparte de los contratos de opciones fue Morgan Stanley & Co., Inc.

La contraparte de los contratos de permutas financieras fue Credit Suisse.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,73 %.

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- $^{(d)}$  Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (e) Los títulos se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional)).
- (f) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de patrimonio
Valores mobilia	rios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial					
Bonos – 12,92 %	6					
Estados Unidos						
	Beazer Homes USA, Inc.	USD	5,875 %	15/10/2027	3.133.125	1,37
	CalAtlantic Group, Inc.	USD	5,875 %	15/11/2024	1.609.093	0,71
	Griffon Corp.	USD	5,750 %	01/03/2028	977.778	0,43
	M/I Homes, Inc.	USD	4,950 %	01/02/2028 01/08/2029	518.750	0,23
	Masco Corp. Masco Corp.	USD USD	7,750 % 6,500 %	15/08/2032	1.889.886 71.990	0,83 0,03
	MDC Holdings, Inc.	USD	3,850 %	15/01/2030	2.106.250	0,00
	MDC Holdings, Inc.	USD	2,500 %	15/01/2031	655.350	0,29
	Meritage Homes Corp.	USD	5,125 %	06/06/2027	2.200.000	0,96
1.000.000	MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.	USD	5,000 %	15/10/2027	1.050.410	0,46
3.000.000	PulteGroup, Inc.	USD	7,875 %	15/06/2032	4.286.250	1,88
2.650.000	Toll Brothers Finance Corp.	USD	4,875 %	15/11/2025	2.901.750	1,27
3.000.000	Toll Brothers Finance Corp.	USD	3,800 %	01/11/2029	3.183.972	1,40
	TRI Pointe Group, Inc. Via TRI Pointe Homes, Inc.	USD	5,875 %	15/06/2024	3.142.875	1,38
	Tri Pointe Homes, Inc.	USD	5,250 %	01/06/2027	1.182.500	0,52
517.000	Tri Pointe Homes, Inc.	USD	5,700 %	15/06/2028	557.714	0,24
TOTAL DE BONO	92				29.467.693	12,92
(coste USD 26.40		,			29.467.693	12,92
Tenencias	Descripción del valor				Valor de mercado en USD	% de
Acciones ordina	· · ·					patrimoni
Estados Unidos	arias – 50,10 /0					
14.958	American Tower Corp.				3.987.354	1,75
57.504	Americold Realty Trust				1.858.529	0,81
16.386	AvalonBay Communities, Inc.				3.924.283	1,72
24.693	Camden Property Trust				4.163.981	1,83
	Century Communities, Inc.				869.253	0,38
	CoreSite Realty Corp.				1.609.953	0,71
	CubeSmart				2.965.934	1,30
	CyrusOne, Inc.				1.374.059	0,60
	DR Horton, Inc. Duke Realty Corp.				6.012.806 2.253.946	2,64 0,99
	EastGroup Properties, Inc.				2.311.060	1,01
	Equinix, Inc.				4.264.583	1,87
	Equity LifeStyle Properties, Inc.				2.869.275	1,26
	Essex Property Trust, Inc.				3.847.449	1,69
	Extra Space Storage, Inc.				2.116.879	0,93
18.040	Gibraltar Industries, Inc.				1.270.738	0,56
24.196	Highwoods Properties, Inc.				1.044.541	0,46
	Home Depot, Inc.				2.387.669	1,05
	Invitation Homes, Inc.				2.148.416	0,94
	Lennar Corp. "A"				5.890.981	2,58
	Life Storage, Inc.				2.514.072	1,10
	Martin Marietta Materials, Inc.				1.870.276	0,82
	Meritage Homes Corp. MGM Growth Properties LLC "A"				2.122.467 1.617.936	0,93 0,71
	NVR, Inc.				3.401.319	1,49
	Prologis, Inc.				5.997.447	2,63
	PulteGroup, Inc.				4.798.829	2,10
	RLJ Lodging Trust				1.868.184	0,82
	Ryman Hospitality Properties, Inc.				2.112.513	0,93
	Taylor Morrison Home Corp.				805.932	0,35
	Terreno Realty Corp.				1.201.723	0,53
42.661	Toll Brothers, Inc.			_	2.765.286	1,21
					88.247.673	38,70
	ONES ORDINARIAS					

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés		Valor de mercado USD	% de patrimonio
Acciones prefe	erentes – 1,11 %					
Estados Unidos						
100.00	10 Public Storage – Serie E – Preferente	USD	4,900 %		2.525.000	1,11
TOTAL DE ACCI (coste USD 2.35	ONES PREFERENTES 8.000)				2.525.000	1,11
Tenencias	Descripción del valor				Valor de mercado USD	% de
	ersión – 9,50 %					patimoni
rlanda 21 664 05	io Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones	de distribu	ción X)(c)(d)		21.664.950	9,50
TOTAL DE FONI	DOS DE INVERSIÓN	uc diotribu	5101174)***			
(coste USD 21.6	(64.950) DRES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VA	I OBES OF	CIAI		21.664.950	9,5
coste USD 100.		LUKES UF	ICIAL		141.905.316	62,23
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado USD	% de patrimonio
	arios negociados en otro mercado regulado					
Bonos – 18,58 Canadá	76					
1.100.000	Brookfield Residential Properties, Inc. Via Brookfield Residential US LLC	HOD	0.050.0/	45/00/0007	4 440 405	0.5
2.531.000	144A <sup>(e)</sup> Brookfield Residential Properties, Inc. Via Brookfield Residential US LLC	USD	6,250 %	15/09/2027	1.148.125	0,5
	144A <sup>(e)</sup>	USD	4,875 %	15/02/2030	2.549.983	1,1
	GFL Environmental, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	3,500 %	01/09/2028	669.080	0,2
	Mattamy Group Corp. 144A(e)	USD	5,250 %	15/12/2027	1.092.000	0,4
2.868.000	Mattamy Group Corp. 144A <sup>(e)</sup>	USD	4,625 %	01/03/2030	2.864.415 8.323.603	3,6
Estados Unidos						
	American Builders & Contractors Supply Co., Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	3,875 %	15/11/2029	657.858	0,2
220.000	ANGI Group LLC 144A <sup>(e)</sup>	USD	3,875 %	15/08/2028	209.275	0,0
	Brookfield Property REIT, Inc. Via BPR Cumulus LLC Via BPR Nimbus LLC					
	Via GGSI Sellco LL 144A <sup>(e)</sup> Builders FirstSource, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD USD	5,750 % 6,750 %	15/05/2026 01/06/2027	2.069.047 1.874.790	0,9 0,8
	Builders FirstSource, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	5,000 %	01/03/2030	4.147.780	1,8
	Cornerstone Building Brands, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	6,125 %	15/01/2029	2.257.612	0,9
	Forterra Finance LLC Via FRTA Finance Corp. 144A <sup>(e)</sup>	USD	6,500 %	15/07/2025	971.125	0,4
	Foundation Building Materials, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	6,000 %	01/03/2029	211.750	0,0
	GYP Holdings III Corp. 144A <sup>(e)</sup>	USD	4,625 %	01/05/2029	237.458	0,1
445.000	H&E Equipment Services, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	3,875 %	15/12/2028	434.431	0,1
1.487.000	Howard Hughes Corp. 144A <sup>(e)</sup>	USD	5,375 %	01/08/2028	1.561.350	0,6
750.000	Installed Building Products, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	5,750 %	01/02/2028	783.750	0,3
	JELD-WEN, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	6,250 %	15/05/2025	906.120	0,4
	JELD-WEN, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	4,625 %	15/12/2025	2.018.043	0,8
	JELD-WEN, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	4,875 %	15/12/2027	1.141.250	0,5
	LGI Homes, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	4,000 %	15/07/2029	584.581	0,2
	Manitowoc Co., Inc. 144A(e)	USD	9,000 %	01/04/2026	1.060.000	0,4
	Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 144A <sup>(e)</sup> Park River Holdings, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	6,000 %	15/01/2027	675.188	0,3
	Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp. 144A <sup>(e)</sup>	USD USD	5,625 % 4,875 %	01/02/2029 01/06/2023	1.018.075 360.500	0,4 0,1
	Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp. 144A <sup>(e)</sup>	USD	7,625 %	15/06/2025	788.375	0,1
	Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp. 144A <sup>(e)</sup>	USD	9,375 %	01/04/2027	1.790.250	0,3
	Specialty Building Products Holdings LLC Via SBP Finance Corp. 144A <sup>(e)</sup>	USD	6,375 %	30/09/2026	2.088.840	0,9
	SRS Distribution, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	6,125 %	01/07/2029	175.547	0,0
	Standard Industries, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	4,750 %	15/01/2028	3.237.836	1,4
	Summit Materials LLC Via Summit Materials Finance Corp. 144A <sup>(e)</sup>	USD	5,250 %	15/01/2029	1.813.350	0,8
416.000	VICI Properties LP Via VICI Note Co., Inc. 144A(e)	USD	3,500 %	15/02/2025	421.720	0,1
540.000	Waste Pro USA, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	5,500 %	15/02/2026	537.300	0,2
					34.033.201	14,9
TOTAL DE BON						

enencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado USD	% de patrimonio
bligaciones stados Unido	con garantía de activos emitidos o garantizados por agencias – 3,98 %	)				
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	2,300 %	25/08/2033	504.651	0,2
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	3,050 %	25/08/2033	210.988	0,0
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	2,100 %	25/12/2033	140.681	0,0
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	3,450 %	25/10/2041	407.993	0,1
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	3,698 %	25/11/2041	100.678	0,0
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	3,342 %	25/07/2049	507.997	0,2
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	3,842 %	25/08/2050	389.639	0,1
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	3,242 %	25/09/2050	25.169	0,0
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	5,342 %	25/09/2050	121.739	0,0
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	4,850 %	25/10/2050	2.287.359	1,0
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	2,650 %	25/11/2050	58.687	0,0
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	4,050 %	25/11/2050	750.981	0,3
1.080.000	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	1,850 %	25/01/2051	1.083.278	0,4
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	2,700 %	25/01/2051	2.106.426	0,9
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(f)</sup>	USD	4,492 %	25/01/2024	171.327	0,0
	Federal National Mortgage Association (FNMA) 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	3,350 %	25/11/2041	211.338	0,0
	,				9.078.931	3,9
	IGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O					
ARANTIZADO coste USD 8.9	DS POR AGENCIAS 30.115)				9.078.931	3,9
bligaciones	con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias –	11,24 %				
stados Unido						
	34 Alternative Loan Trust 2006-23CB "1A6"	USD	6,000 %	25/08/2036	110.072	0,0
729.8	03 Alternative Loan Trust 2006-OA1 "2A1"(f)	USD	0,511 %	20/03/2046	623.076	0,2
300.0	00 Banc of America Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 "D" 144A <sup>(e)</sup>	USD	3,000 %	15/07/2049	278.282	0,
493.2	01 Banc of America Funding 2006-H Trust "6A1"(f)	USD	0,471 %	20/10/2036	436.226	0,
120.0	00 Bank 2017-BNK8 "D" 144A <sup>(e)</sup>	USD	2,600 %	15/11/2050	106.287	0,0
500.0	00 Bank 2018-BNK13 "D" 144A <sup>(e)</sup>	USD	3,000 %	15/08/2061	434.076	0,
100.0	00 Benchmark Mortgage Trust 2018-B1 "D" 144A(e)	USD	2,750 %	15/01/2051	87.958	0,0
250.0	00 CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C6"D" 144A(e)(f)	USD	4,338 %	10/11/2049	228.311	0,
	90 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-HYB3 "2A1A"(f)	USD	3,103 %	20/05/2036	679.920	0,3
	00 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2007-14 "A19"	USD	6,000 %	25/09/2037	874.909	0,3
	00 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-GC36 "C"(f)	USD	4,908 %	10/02/2049	155.035	0,0
	75 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R03 "1M2" 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	2,242 %	25/09/2031	15.373	0,0
	21 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01 "1M2" 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	2,142 %	25/01/2040	60.327	0,0
	00 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01 "1B1" 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	3,150 %	25/10/2041	528.875	0,2
	00 CSMC 2014-USA OA LLC "E" 144A <sup>(e)</sup>	USD	4,373 %	15/09/2037	225.842	0,
	00 DBJPM 17-C6 Mortgage Trust "D" 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	3,227 %	10/06/2050	467.790	0,
	27 GSAMP Trust 2007-H1 "A2C" <sup>(f)</sup>	USD	0,392 %	25/01/2047	1.883.436	0,2
				25/08/2035		
	02 IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR11 "A4" <sup>(f)</sup>	USD	2,956 %		778.853	0,3
	31 JP Morgan Alternative Loan Trust 2006-A2 "2A1"(1)	USD	2,922 %	25/05/2036	907.200	0,4
	97 JP Morgan Alternative Loan Trust 2006-A7 "1A1"(f)	USD	0,412 %	25/12/2036	2.041.365	0,8
	00 JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2017-JP5 "D" 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	4,754 %	15/03/2050	151.112	0,0
	45 Lehman XS Trust Series 2007-2N "3A3" <sup>(f)</sup>	USD	0,262 %	25/02/2037	5.367.206	2,3
	71 Luminent Mortgage Trust 2007-2 "1A2"(†)	USD	0,652 %	25/05/2037	446.984	0,2
	53 MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2006-OA2 "1A1"(†)	USD	0,883 %	25/12/2046	314.713	0,
	50 MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2006-OA2 "4A1A"(f)	USD	0,933 %	25/12/2046	29.755	0,
	51 MASTR Asset Backed Securities Trust 2006-HE5 "A2"(f)	USD	0,192 %	25/11/2036	2.061.626	0,9
	49 Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2007-NC3 "A2B"(f)	USD	0,232 %	25/05/2037	3.048.166	1,
100.0	00 Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C23 "D" 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	4,282 %	15/07/2050	99.912	0,
100.0	00 Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 "D" 144A(e)	USD	3,060 %	15/10/2048	95.670	0,
500.0	00 Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C34 "D" 144A(e)	USD	2,700 %	15/11/2052	441.082	0,
662.7	83 RALI Series 2006-QO7 Trust "3A2" <sup>(f)</sup>	USD	0,502 %	25/09/2046	685.007	0,
	14 Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust Series 2005-22 "1A4"(f)	USD	2,704 %	25/12/2035	992.611	0,4
250.0	00 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C37 "D" 144A(e)(f)	USD	3,342 %	15/12/2049	233.213	0,
	00 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C42 "D" 144A <sup>(e)(f)</sup>	USD	2,800 %	15/12/2050	135.402	0,0
	00 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RB1 "D" 144A <sup>(e)</sup>	USD	3,401 %	15/03/2050	93.220	0,0
	00 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RC1 "D" 144A <sup>(e)</sup>	USD	3,250 %	15/01/2060	514.917	0,2
555.0					25.633.809	11,2
OTAL DE OBI	LIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS NO EMITIDOS NI GARANTIZAD 354.735)	OOS POR	AGENCIAS		25.633.809	11,2
					20.000.003	11,2
DE VAI	ORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO					

Tenencias	Descripción del valor			Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado USD	% del
Otros valores r	mobiliarios							
Bonos – 0,30 %								
Estados Unidos 680.00	<b>s</b> 00 Beacon Roofing Supply, Inc	c. 144A <sup>(e)</sup>		USD	4,125 %	15/05/2029	674.900	0,30
TOTAL DE BONG	ios				,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,		674.900	0,30
TOTAL DE OTRO	OS VALORES MOBILIARIOS							
	RCADO DE LAS INVERSIONE	S EXCLUYENDO	DERIVADOS				674.900	0,30
	futuros – (0,09 %)						219.649.760	96,33
Número de contratos	Descripción del valor					Valor de mercado de la asignación en USD	Plusvalía latente en USD	% de patrimonio
	USD							
	2 Futuros sobre bonos del Te		• .		Larga	323.938	7.887	0,00
	<ul> <li>26 Futuros sobre pagarés del</li> <li>13 Futuros sobre pagarés del</li> </ul>				Larga Larga	5.694.609 13.751.570	16.382 139.231	0,01 0,06
	Futuros sobre pagares del     Futuros sobre bonos del Te			22	Larga	199.750	4.836	0,00
1	13 Futuros sobre pagarés del	Tesoro de EE. UU	. a muy largo plazo a 10			4 0 4 0 7 0 7	00.404	0.00
	años 22/03/2022				Larga	1.910.797	39.464	0,02
DI LICVALÍA I AT	TENTE SOBRE CONTRATOS	DE EUTUROS				21.880.664	207.800	0,09
PLUSVALIA LAI	TENTE SOBRE CONTRATOS	DE FUTUROS					207.000	0,09
						Valor de mercado de la asignación en USD	Minusvalía latente en USD	% del
Número de contratos	Descripción del valor					005		
contratos	USD							
contratos (197	USD 7) Futuros sobre pagarés del		. a 10 años 22/03/2022		Corta	(25.819.312)	(405.819)	, , ,
contratos (197 MINUSVALÍA LA	USD 7) Futuros sobre pagarés del ATENTE SOBRE CONTRATOS	S DE FUTUROS			Corta		(405.819) (405.819)	, , ,
contratos (197 MINUSVALÍA LA	USD 7) Futuros sobre pagarés del	S DE FUTUROS			Corta	(25.819.312)	(405.819) Plusvalía	(0,18)
contratos (197 MINUSVALÍA LA	USD 7) Futuros sobre pagarés del ATENTE SOBRE CONTRATOS divisas a plazo específicos	S DE FUTUROS		nta	Corta		(405.819)	(0,18) % de
(197 MINUSVALÍA LA Contratos de d Divisa USD	USD 7) Futuros sobre pagarés del 'ATENTE SOBRE CONTRATOS divisas a plazo específicos  Compra 5.141	S DE FUTUROS de una clase d Divisa GBP	e acciones – 0,09 %  Ver  3.8	44	Corta	(25.819.312)  Fecha de vencimiento 21/01/2022	(405.819)  Plusvalía latente en USD	% de patrimonio
(197 MINUSVALÍA LA Contratos de d Divisa USD EUR	USD 7) Futuros sobre pagarés del ATENTE SOBRE CONTRATOS divisas a plazo específicos  Compra 5.141 20.932.950	S DE FUTUROS de una clase de Divisa GBP USD	e acciones – 0,09 %  Ver  3.8  23.637.3	44 38		(25.819.312)  Fecha de vencimiento	Plusvalia latente en USD 1 235.461	(0,18)  % del patrimonio 0,00 0,11
(197 MINUSVALÍA LA Contratos de d Divisa USD EUR	USD 7) Futuros sobre pagarés del 'ATENTE SOBRE CONTRATOS divisas a plazo específicos  Compra 5.141	S DE FUTUROS de una clase de Divisa GBP USD	e acciones – 0,09 %  Ver  3.8  23.637.3	44 38		(25.819.312)  Fecha de vencimiento 21/01/2022	(405.819)  Plusvalía latente en USD	(0,18) (0,18)  % del patrimonic 0,00 0,11
(197 MINUSVALÍA LA Contratos de d Divisa USD EUR	USD 7) Futuros sobre pagarés del ATENTE SOBRE CONTRATOS divisas a plazo específicos  Compra 5.141 20.932.950	S DE FUTUROS de una clase de Divisa GBP USD	e acciones – 0,09 %  Ver  3.8  23.637.3	44 38		(25.819.312)  Fecha de vencimiento 21/01/2022 10/02/2022	(405.819)  Plusvalia latente en USD  1 235.461  235.462	% del patrimonic 0,00 0,11
(197 MINUSVALÍA LA Contratos de d Divisa USD EUR	USD 7) Futuros sobre pagarés del 7 ATENTE SOBRE CONTRATOS divisas a plazo específicos Compra 5.141 20.932.950 TENTE SOBRE CONTRATOS	S DE FUTUROS de una clase de Divisa GBP USD	e acciones – 0,09 %  Ver  3.8  23.637.3	44 38 N FINES DE (		(25.819.312)  Fecha de vencimiento 21/01/2022	(405.819)  Plusvalía latente en USD  1 235.461	(0,18)  % del patrimonic 0,00 0,11  0,11
(197 MINUSVALÍA LA Contratos de d Divisa USD EUR PLUSVALÍA LAT Divisa GBP	USD 7) Futuros sobre pagarés del ' ATENTE SOBRE CONTRATOS divisas a plazo específicos  Compra 5.141 20.932.950  TENTE SOBRE CONTRATOS  Compra 457.267	S DE FUTUROS de una clase de Divisa GBP USD DE DIVISAS A PI Divisa USD	e acciones – 0,09 %  Ver 3.8 23.637.3  LAZO CELEBRADOS COI  Ver 628.9	44 38 N FINES DE ( nta 01		Fecha de vencimiento 21/01/2022 Fecha de vencimiento 21/01/2022 10/02/2022	Plusvalía latente en USD 1 235.461 235.462 Minusvalía latente en	% de patrimonic 0,00 0,11 0,11 % de patrimonic
(197 MINUSVALÍA LA Contratos de d  Divisa USD EUR PLUSVALÍA LAT  Divisa GBP SGD	USD 7) Futuros sobre pagarés del 'ATENTE SOBRE CONTRATOS divisas a plazo específicos  Compra 5.141 20.932.950  TENTE SOBRE CONTRATOS  Compra 457.267 3.335.001	S DE FUTUROS de una clase de Divisa GBP USD DE DIVISAS A PI Divisa USD USD	ver 628.9 2.470.9	44 38 N FINES DE 0 nta 01 08		Fecha de vencimiento 21/01/2022 10/02/2022 Fecha de vencimiento 21/01/2022 07/02/2022 07/02/2022	(405.819)  Plusvalía latente en USD  1 235.461  235.462  Minusvalía latente en USD  (17.487) (26.155)	(0,18) % de patrimonic 0,000 0,111 0,111 % de patrimonic (0,000 (0,002)
(197 MINUSVALÍA LA Contratos de d  Divisa USD EUR PLUSVALÍA LAT  Divisa GBP SGD USD	USD 7) Futuros sobre pagarés del 'ATENTE SOBRE CONTRATOS divisas a plazo específicos  Compra 5.141 20.932.950  TENTE SOBRE CONTRATOS  Compra 457.267 3.335.001 37.130	Divisa  Divisa  Divisa  Divisa  Divisa  Divisa  Divisa  DE DIVISAS A Pl  Divisa  USD  USD  USD  USD  USD  USD  USD  US	Ver 3.8. 23.637.3 LAZO CELEBRADOS COI  Ver 628.9 2.470.9 33.0	444 338  N FINES DE 0  nta 01 08 339	COBERTURA	Fecha de vencimiento 21/01/2022 Fecha de vencimiento 21/01/2022 10/02/2022	(405.819)  Plusvalia latente en USD  1 235.461  235.462  Minusvalia latente en USD  (17.487) (26.155) (549)	(0,18)  % de patrimonic  0,00 0,11  0,11  % de patrimonic  (0,00 (0,02 (0,00)
(197 MINUSVALÍA LA Contratos de d  Divisa USD EUR PLUSVALÍA LAT  Divisa GBP SGD USD	USD 7) Futuros sobre pagarés del 'ATENTE SOBRE CONTRATOS divisas a plazo específicos  Compra 5.141 20.932.950  TENTE SOBRE CONTRATOS  Compra 457.267 3.335.001	Divisa  Divisa  Divisa  Divisa  Divisa  Divisa  Divisa  DE DIVISAS A Pl  Divisa  USD  USD  USD  USD  USD  USD  USD  US	Ver 3.8. 23.637.3 LAZO CELEBRADOS COI  Ver 628.9 2.470.9 33.0	444 338  N FINES DE 0  nta 01 08 339	COBERTURA	Fecha de vencimiento 21/01/2022 10/02/2022 Fecha de vencimiento 21/01/2022 07/02/2022 07/02/2022	(405.819)  Plusvalía latente en USD  1 235.461  235.462  Minusvalía latente en USD  (17.487) (26.155)	(0,18)  % de patrimonic  0,00 0,11  0,11  % de patrimonic  (0,00 (0,02 (0,00)
MINUSVALÍA LAT  Divisa  PLUSVALÍA LAT  Divisa  GBP  SGD  USD  MINUSVALÍA LA  Contratos de p	USD 7) Futuros sobre pagarés del 'ATENTE SOBRE CONTRATOS divisas a plazo específicos  Compra 5.141 20.932.950  TENTE SOBRE CONTRATOS  Compra 457.267 3.335.001 37.130	Divisa  Divisa  Divisa  Divisa  Divisa  Divisa  USD  USD  USD  USD  USD  USD  USD  US	Ver 3.8. 23.637.3 LAZO CELEBRADOS COI  Ver 628.9 2.470.9 33.0	444 338  N FINES DE 0  nta 01 08 339	COBERTURA	Fecha de vencimiento 21/01/2022 10/02/2022 Fecha de vencimiento 21/01/2022 07/02/2022 07/02/2022	(405.819)  Plusvalia latente en USD  1 235.461  235.462  Minusvalia latente en USD  (17.487) (26.155) (549)	(0,18)  % de patrimonic  0,00 0,11  0,11  % de patrimonic  (0,00 (0,02 (0,00)
MINUSVALÍA LA Contratos de d  Divisa USD EUR PLUSVALÍA LAT  Divisa GBP SGD USD MINUSVALÍA LA Contratos de p	USD 7) Futuros sobre pagarés del ' ATENTE SOBRE CONTRATOS divisas a plazo específicos  Compra 5.141 20.932.950  TENTE SOBRE CONTRATOS  Compra 457.267 3.335.001 37.130  ATENTE SOBRE CONTRATOS	Divisa  Divisa  Divisa  Divisa  Divisa  Divisa  USD  USD  USD  USD  USD  USD  USD  US	Ver 3.8. 23.637.3 LAZO CELEBRADOS COI  Ver 628.9 2.470.9 33.0	444 338  N FINES DE 0  nta 01 08 339	COBERTURA	Fecha de vencimiento 21/01/2022 10/02/2022 Fecha de vencimiento 21/01/2022 07/02/2022 07/02/2022	(405.819)  Plusvalía latente en USD  1 235.461  235.462  Minusvalía latente en USD  (17.487) (26.155) (549)  (44.191)	(0,18)  % del patrimonio  0,000 0,111  0,111  % del patrimonio  (0,00) (0,02) (0,00)
MINUSVALÍA LAT  Divisa  PLUSVALÍA LAT  Divisa  GBP  SGD  USD  MINUSVALÍA LA  Contratos de p	USD 7) Futuros sobre pagarés del ' ATENTE SOBRE CONTRATOS divisas a plazo específicos  Compra 5.141 20.932.950  TENTE SOBRE CONTRATOS  Compra 457.267 3.335.001 37.130  ATENTE SOBRE CONTRATOS	Divisa  Divisa  Divisa  DE DIVISAS A PI  DIVISAS A PI	Ver 3.8. 23.637.3 LAZO CELEBRADOS COI  Ver 628.9 2.470.9 33.0	444 338  N FINES DE 0  nta 01 08 339	COBERTURA	Fecha de vencimiento 21/01/2022 10/02/2022 Fecha de vencimiento 21/01/2022 07/02/2022 07/02/2022	(405.819)  Plusvalia latente en USD  1 235.461  235.462  Minusvalia latente en USD  (17.487) (26.155) (549)	(0,18) % del patrimonic (0,00) (0,02) (0,02) % del
Contratos  (197 MINUSVALÍA LA Contratos de d  Divisa USD EUR PLUSVALÍA LAT  Divisa GBP SGD USD MINUSVALÍA LA  Contratos de p	USD 7) Futuros sobre pagarés del 'ATENTE SOBRE CONTRATOS divisas a plazo específicos  Compra 5.141 20.932.950  TENTE SOBRE CONTRATOS  Compra 457.267 3.335.001 37.130  ATENTE SOBRE CONTRATOS  Dermutas financieras – 0,07  A pagar  Permutas de incumplimie	S DE FUTUROS de una clase de Divisa GBP USD DE DIVISAS A PI  Divisa USD USD EUR S DE DIVISAS A II 7 %	Ver	444 338  N FINES DE 0  nta 01 08 339	COBERTURA	Fecha de vencimiento 21/01/2022 10/02/2022 10/02/2022 10/02/2022 10/02/2022 10/02/2022 10/02/2022 10/02/2022	(405.819)  Plusvalia latente en USD  1 235.461  235.462  Minusvalia latente en USD  (17.487) (26.155) (549)  (44.191)	(0,18) % del patrimonic (0,00) (0,02) (0,02) % del
MINUSVALÍA LAT  Divisa  BEUR  PLUSVALÍA LAT  Divisa  GBP  SGD  USD  MINUSVALÍA LAT  Contratos de p  Importe teórico local neto	USD 7) Futuros sobre pagarés del ' ATENTE SOBRE CONTRATOS divisas a plazo específicos  Compra 5.141 20.932.950  TENTE SOBRE CONTRATOS  Compra 457.267 3.335.001 37.130  ATENTE SOBRE CONTRATOS  Dermutas financieras – 0,07  A pagar  Permutas de incumplimie crediticio (CDS)	Divisa  Divisa  Divisa  Divisa  Divisa  USD  USD  USD  USD  USD  USD  USD  US	Ver 3.8 23.637.3 LAZO CELEBRADOS COI Ver 628.9 2.470.9 33.0 PLAZO CELEBRADOS CO	444 338  N FINES DE 0  nta 01 08 339	COBERTURA  COBERTURA  Divisa	Fecha de vencimiento  21/01/2022 10/02/2022  Fecha de vencimiento 21/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 Fecha de vencimiento	(405.819)  Plusvalía latente en USD  1 235.461  235.462  Minusvalía latente en USD  (17.487) (26.155) (549)  (44.191)  Plusvalía latente en USD	(0,18) % de patrimonic 0,00 0,11 0,11 % de patrimonic (0,00) (0,02) (0,00) % del patrimonic
Contratos  (197 MINUSVALÍA LA Contratos de d Divisa USD EUR PLUSVALÍA LAT  Divisa GBP SGD USD MINUSVALÍA LA Contratos de p Importe teórico local neto	USD 7) Futuros sobre pagarés del 'ATENTE SOBRE CONTRATOS divisas a plazo específicos  Compra 5.141 20.932.950  TENTE SOBRE CONTRATOS  Compra 457.267 3.335.001 37.130  ATENTE SOBRE CONTRATOS  Dermutas financieras – 0,07  A pagar  Permutas de incumplimie crediticio (CDS) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index)	S DE FUTUROS de una clase de Divisa GBP USD DE DIVISAS A PI  Divisa USD USD EUR S DE DIVISAS A II  7 % A II ento	Ver	444 338  N FINES DE 0  nta 01 08 339	COBERTURA	Fecha de vencimiento 21/01/2022 10/02/2022 10/02/2022 10/02/2022 10/02/2022 10/02/2022 10/02/2022 10/02/2022	(405.819)  Plusvalia latente en USD  1 235.461  235.462  Minusvalia latente en USD  (17.487) (26.155) (549)  (44.191)	(0,18) % del patrimonic (0,00) (0,02) (0,02) % del
MINUSVALÍA LAT  Divisa  BEUR  PLUSVALÍA LAT  Divisa  GBP  SGD  USD  MINUSVALÍA LAT  Contratos de p  Importe teórico local neto	USD 7) Futuros sobre pagarés del ' ATENTE SOBRE CONTRATOS divisas a plazo específicos  Compra 5.141 20.932.950  TENTE SOBRE CONTRATOS  Compra 457.267 3.335.001 37.130  ATENTE SOBRE CONTRATOS  Dermutas financieras – 0,07  A pagar  Permutas de incumplimie crediticio (CDS) Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index)	S DE FUTUROS de una clase de Divisa GBP USD DE DIVISAS A PI  Divisa USD USD EUR S DE DIVISAS A II  7 % A II ento	Ver 3.8 23.637.3 LAZO CELEBRADOS COI Ver 628.9 2.470.9 33.0 PLAZO CELEBRADOS CO	444 338  N FINES DE 0  nta 01 08 339	COBERTURA  COBERTURA  Divisa	Fecha de vencimiento  21/01/2022 10/02/2022  Fecha de vencimiento 21/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 Fecha de vencimiento	(405.819)  Plusvalía latente en USD  1 235.461  235.462  Minusvalía latente en USD  (17.487) (26.155) (549)  (44.191)  Plusvalía latente en USD	(0,18) % del patrimonio 0,00 0,111 0,111 % del patrimonio (0,00) (0,02) (0,00) (0,02) % del patrimonio
Contratos  (197 MINUSVALÍA LA Contratos de d Divisa USD EUR PLUSVALÍA LAT  Divisa GBP SGD USD MINUSVALÍA LA Contratos de p Importe teórico local neto	USD 7) Futuros sobre pagarés del ' ATENTE SOBRE CONTRATOS divisas a plazo específicos  Compra 5.141 20.932.950  TENTE SOBRE CONTRATOS  Compra 457.267 3.335.001 37.130  ATENTE SOBRE CONTRATOS  Dermutas financieras – 0,07  A pagar  Permutas de incumplimie crediticio (CDS) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) Variable (The Markit CMBX Variable (The Markit CMBX CMBX CMBX)	S DE FUTUROS de una clase de  Divisa GBP USD DE DIVISAS A PI  Divisa USD USD EUR S DE DIVISAS A I  7 % A I  Onto ( North Fij	Ver	444 338  N FINES DE 0  nta 01 08 339	COBERTURA  COBERTURA  Divisa	Fecha de vencimiento  21/01/2022 10/02/2022  Fecha de vencimiento 21/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 10/02/2022 10/02/2022	(405.819)  Plusvalia latente en USD  1 235.461  235.462  Minusvalia latente en USD (17.487) (26.155) (549)  (44.191)  Plusvalia latente en USD	(0,18) % de patrimonic 0,00 0,11 0,11 % de patrimonic (0,00 (0,02) (0,00) (0,02) % del patrimonic 0,04
MINUSVALÍA LAT  Divisa USD EUR  PLUSVALÍA LAT  Divisa GBP SGD USD  MINUSVALÍA LAT  Contratos de p Importe teórico local neto	USD 7) Futuros sobre pagarés del ' ATENTE SOBRE CONTRATOS divisas a plazo específicos  Compra 5.141 20.932.950  TENTE SOBRE CONTRATOS  Compra 457.267 3.335.001 37.130  ATENTE SOBRE CONTRATOS  Dermutas financieras – 0,07  A pagar  Permutas de incumplimie crediticio (CDS) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) 1 Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index)	S DE FUTUROS de una clase de  Divisa GBP USD DE DIVISAS A PI  Divisa USD USD EUR S DE DIVISAS A II  7 % A II  Ponto ( North Fij	Ver	444 338  N FINES DE 0  nta 01 08 339	COBERTURA  COBERTURA  Divisa  USD USD	Fecha de vencimiento 21/01/2022 10/02/2022  Fecha de vencimiento 21/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 10/02/2022 10/02/2024  Fecha de vencimiento 18/11/2054	(405.819)  Plusvalía latente en USD  1 235.461  235.462  Minusvalía latente en USD  (17.487) (26.155) (549)  (44.191)  Plusvalía latente en USD  94.558  16.896	(0,18)  % de patrimonic  0,00 0,11  0,11  % de patrimonic  (0,00) (0,02) (0,02)  % del patrimonic  0,04 0,01 0,00
MINUSVALÍA LAT  Divisa  GBP SGD USD  MINUSVALÍA LAT  Divisa  GBP SIGD USD  MINUSVALÍA LA  Contratos de pl Importe teórico local neto	USD 7) Futuros sobre pagarés del ' ATENTE SOBRE CONTRATOS divisas a plazo específicos  Compra 5.141 20.932.950  TENTE SOBRE CONTRATOS  Compra 457.267 3.335.001 37.130  ATENTE SOBRE CONTRATOS  Dermutas financieras – 0,07  A pagar  Permutas de incumplimie crediticio (CDS) Variable (The Markit CMBX America BBB- 11 Index) Variable (The Markit CMBX America BBB- 8 Index) Variable (The Markit CMBX America BBB- 8 Index) Variable (The Markit CMBX America BBB- 8 Index)	S DE FUTUROS de una clase de  Divisa GBP USD DE DIVISAS A PI  Divisa USD USD EUR S DE DIVISAS A II  7 % A II  Conto C North Fij C North Fij C North Fij	Ver	444 338  N FINES DE 0  nta 01 08 339	COBERTURA  COBERTURA  Divisa  USD USD USD	Fecha de vencimiento  21/01/2022 10/02/2022  Fecha de vencimiento 21/01/2022 07/02/2022 10/02/2022 10/02/2022 10/02/2024  Fecha de vencimiento  18/11/2054 18/11/2054	(405.819)  Plusvalia latente en USD  1 235.461  235.462  Minusvalia latente en USD (17.487) (26.155) (549)  (44.191)  Plusvalia latente en USD  94.558 16.896 2.984	(0,18)  % del patrimonio  0,000 0,111  0,111  % del patrimonio (0,00) (0,02) (0,00)  % del patrimonio

Contratos d	e permutas i	financieras – (	(continuación)
-------------	--------------	-----------------	----------------

Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% del
- Iocai fieto		A recibil	Divisa	recha de vencimiento	035	patrinonio
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS) – (continuación)					
600.000	Variable (The Markit CMBX North	Fijo 3,000 %	USD	17/11/2059	35.176	0,02
	America BBB- 10 Index)					
200.000	Variable (The Markit CMBX North	Fijo 3,000 %	USD	17/11/2059	6.265	0,00
	America BBB- 10 Index)					
PLUSVALÍA LATE	ENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMP	LIMIENTO CREDITICIO (CDS)			180.706	0,08
TOTAL DE DI LIEV	VALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS	DE DEDMITAS EINANCIEDAS				
TOTAL DE PLOS	VALIA LATENTE SOBRE CONTRATOS	DE PERMUTAS FINANCIERAS			180.706	0,08
Importe					Minusvalía	
teórico			B		latente en	% del
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	USD	patrimonio
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)					
500.000	Variable (The Markit CMBX North	Fijo 3,000 %	USD	18/11/2054	(7.988)	(0,01)
	America BBB- 11 Index)					
1.000.000	Variable (The Markit CMBX North	Fijo 3,000 %	USD	17/11/2059	(6.766)	(0,00)
MINIISVALÍA LAT	America BBB- 10 Index)  ENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUM	PI IMIENTO CREDITICIO (CDS)			(14.754)	(0,01)
	SVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATO				(14.754)	(0,01)
		3 DE PERINDIAS I INANCIERAS			. ,	
VALOR DE MERO (coste USD 172.9	SADO DE LAS INVERSIONES 92.906)				219.808.964	96,40
OTROS ACTIVOS	Y PASIVOS				8.203.303	3,60
PATRIMONIO					228.012.267	100,00
					Valor de mercado	
TOTAL DE INVER	SIONES				en USD	% del patrimonio
Total inversiones e	excluyendo derivados (coste USD 172.9	92.906)			219.649.760	96,33
Plusvalía latente s	obre contratos de futuros				207.800	0,09
	sobre contratos de futuros				(405.819)	(0,18)
	obre contratos de divisas a plazo celebr				235.462	0,11
	sobre contratos de divisas a plazo celel	orados con fines de cobertura			(44.191)	(0,02)
	obre contratos de permutas financieras				180.706	0,08
	sobre contratos de permutas financiera	S			(14.754)	(0,01)
Otros activos y pa	SIVUS				8.203.303	3,60
Patrimonio					228.012.267	100,00

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Australia & New Zealand Banking Group Ltd., Barclays Bank Plc., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., State Street Bank & Trust y UBS AG.

La contraparte de los contratos de permutas financieras fue Morgan Stanley & Co. International Plc.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,09 %.

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- $^{\rm (d)}~$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.
- (e) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (f) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.

## Goldman Sachs Funds—Emerging Markets Total Return Bond Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del
Bonos - 82,42	arios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial %					
Angola 200.000	) Bonos internacionales del Estado de Angola	USD	8,000 %	26/11/2029	185.305	0,11
Argentina			······			
-	Arcor SAIC	USD	6,000 %	06/07/2023	176.597	0,11
83.113	Bonos internacionales del Estado de Argentina	USD	1,000 %	09/07/2029	27.926	0,02
485.865	5 Bonos internacionales del Estado de Argentina <sup>(c)</sup>	USD	1,125 %	09/07/2035	138.229	0,08
134.000	Cia General de Combustibles S.A.	USD	9,500 %	08/03/2025	131.969	0,08
270.000	) IRSA Propiedades Comerciales S.A.	USD	8,750 %	23/03/2023	258.508	0,16
Armenia					733.229	0,45
	) Bono internacional de Armenia	USD	3,600 %	02/02/2031	248.596	0,15
Australia						
	Santos Finance Ltd.	USD	4,125 %	14/09/2027	276.866	0,17
420.000	Santos Finance Ltd.	USD	5,250 %	13/03/2029	472.475 749.341	0,29
Azerbaiyán					749.341	0,46
-	D Bonos internacionales de Azerbaiyán	USD	3,500 %	01/09/2032	830.347	0,51
Baréin	N. Danie international and Estado (1. S. //		= 00= °′	10/05/053		
470.000	) Bonos internacionales del Estado de Baréin	USD	5,625 %	18/05/2034	443.563	0,27
860 000	) Bonos internacionales del Estado de Benín	EUR	4,875 %	19/01/2032	936.963	0,57
	Denos internacionales del Estado de Benín	EUR	4,950 %	22/01/2035	1.227.237	0,75
	Donos internacionales del Estado de Borini	2011	1,000 70	22/01/2000	2.164.200	1,32
Bermudas						
270.000	) Bonos internacionales del Estado de Bermudas	USD	3,375 %	20/08/2050	266.085	0,16
240.000	Geopark Ltd.	USD	5,500 %	17/01/2027	228.628	0,14
250.000	Sagicor Financial Co., Ltd.	USD	5,300 %	13/05/2028	259.000	0,16
1.240.000	Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	USD	2,625 %	15/08/2025	1.248.990	0,76
630.000	Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	USD	3,250 %	15/08/2030	623.070 2.625.773	0,38 1,60
Brasil					2.023.773	1,00
	) Banco do Brasil S.A. <sup>(d)</sup>	USD	6,250 %	Perp.	1.087.568	0,66
820.000	BRF S.A.	USD	4,875 %	24/01/2030	806.495	0,49
270.000	BRF S.A.	USD	5,750 %	21/09/2050	254.491	0,15
200.000	) Samarco Mineracao S.A.	USD	4,125 %	01/11/2022	126.631	0,08
400.000	) Samarco Mineracao S.A.	USD	5,750 %	24/10/2023	272.195	0,17
					2.547.380	1,55
Islas Vírgenes E	Británicas					
	Central American Bottling Corp.	USD	5,750 %	31/01/2027	1.137.325	0,70
	Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	USD	4,750 %	27/04/2027	232.875	0,14
	Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	USD	3,750 %	29/05/2024	199.000	0,12
	Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	USD	3,375 %	24/02/2030	233.125	0,14
	Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	USD	3,625 %	30/09/2030	226.200	0,14
	Huarong Finance II Co., Ltd. Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	5,000 %	19/11/2025	358.750	0,22
	Huarong Finance II Co., Ltd. Huarong Finance II Co., Ltd.	USD USD	4,625 % 4,875 %	03/06/2026 22/11/2026	233.450 234.025	0,14 0,14
	Peak RE Bvi Holding Ltd. <sup>(d)</sup>	USD	5,350 %	22/11/2026 Perp.	206.000	0,14
200.000	on country 2 to	002	0,000 70	. о.р.	3.060.750	1,87
Camerún						
920.000 Islas Caimán	) Bonos internacionales de Camerún	EUR	5,950 %	07/07/2032	972.891	0,59
	DP World Crescent Ltd.	USD	4,848 %	26/09/2028	449.000	0,27
1.280.000	DP World Salaam <sup>(d)</sup>	USD	6,000 %	Perp.	1.382.200	0,84
490.000	Dubai DOF Sukuk Ltd.	USD	2,763 %	09/09/2030	494.900	0,30
1.030.000	Grupo Aval Ltd.	USD	4,750 %	26/09/2022	1.050.326	0,64
290.000	) iQIYI, Inc.	USD	2,000 %	01/04/2025	246.308	0,15
30.000	) iQIYI, Inc.	USD	4,000 %	15/12/2026	24.814	0,02
	Modern Land China Co., Ltd.	USD	11,950 %	04/03/2024	58.000	0,04
200.000	NagaCorp Ltd.	USD	7,950 %	06/07/2024	199.599	0,12

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del
Bonos – (conti	•	,				
Islas Caimán – (						
	Sharjah Sukuk Program Ltd.	USD	3,234 %	23/10/2029	761.183	0,46
200.000	VLL International, Inc.	USD	7,250 %	20/07/2027	209.890	0,13
					4.876.220	2,97
Chile						
	Bonos de la Tesorería de la República en pesos 144A <sup>(e)</sup>	CLP	4,700 %	01/09/2030	107.411	0,07
	CAP S.A.	USD	3,900 %	27/04/2031	443.563	0,27
752.960	GNL Quintero S.A.	USD	4,634 %	31/07/2029	802.194	0,49
					1.353.168	0,83
Colombia	Banco Davivienda S.A. <sup>(d)</sup>	USD	6,650 %	Pern	327.962	0,20
	Banco de Bogota S.A.	USD	5,375 %	Perp. 19/02/2023	606.962	0,20
	Banco de Bogota S.A.	USD	6,250 %	12/05/2026	1.556.912	0,95
	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	4,500 %	15/03/2029	245.336	0,15
	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	4,125 %	15/05/2051	161.643	0,10
	TES de Colombia – Serie B	COP	7,250 %	18/10/2034	226.413	0,14
720.000	Empresas Publicas de Medellin ESP	USD	4,250 %	18/07/2029	683.075	0,41
					3.808.303	2,32
Chipre						·
980.000	MHP S.E.	USD	7,750 %	10/05/2024	1.009.157	0,62
República Chec						
8.750.000	Bonos del Estado de la República Checa – Serie 125	CZK	1,500 %	24/04/2040	325.414	0,20
República Domi	nicana					
•	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI S.A.	USD	6,750 %	30/03/2029	364.014	0,22
	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	6,600 %	28/01/2024	675.800	0,41
1.360.000	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	5,950 %	25/01/2027	1.504.359	0,92
280.000	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	4,500 %	30/01/2030	279.245	0,17
560.000	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	4,875 %	23/09/2032	558.852	0,34
					3.382.270	2,06
Ecuador 214 414	Bonos internacionales del Estado de Ecuador	USD	6,932 %	31/07/2030	119.536	0,07
	Bollos illicitacionales del Estado de Estado		0,002 70	0110112000	110.000	
<b>Egipto</b> 590 000	Bonos internacionales del Estado de Egipto	USD	8,875 %	29/05/2050	511.825	0,31
	Bonos internacionales del Estado de Egipto	USD	7,500 %	16/02/2061	372.600	0,23
.00.000	20100 111011120011200 201 201220 20 29,610	002	- 1,000 70	10/02/2001	884.425	0,54
Gabón					004.420	0,04
	Bonos internacionales del Estado de Gabón	USD	6,625 %	06/02/2031	394.990	0,24
Ghana						
380.000	Bonos internacionales del Estado de Ghana	USD	8,125 %	26/03/2032	299.060	0,18
Guatemala						
800.000	Banco Industrial S.A. <sup>(d)</sup>	USD	4,875 %	29/01/2031	796.500	0,49
760.000	Bonos del Estado de Guatemala	USD	5,750 %	06/06/2022	775.365	0,47
1.400.000	Bonos del Estado de Guatemala	USD	4,900 %	01/06/2030	1.502.704	0,92
400.000	Bonos del Estado de Guatemala	USD	6,125 %	01/06/2050	446.623	0,27
					3.521.192	2,15
Hungría	OTD Deals Newf(d)	EUD	0.075.0/	45/07/0000		
1.340.000	OTP Bank Nyrt <sup>(d)</sup>	EUR	2,875 %	15/07/2029	1.580.944	0,96
India						
200.000	Yes Bank Ifsc Banking Unit Branch	USD	3,750 %	06/02/2023	197.443	0,12
Indonesia						
	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	USD	3,541 %	27/04/2032	249.531	0,15
200.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	USD	4,745 %	09/06/2051	203.500	0,12
	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	EUR	1,100 %	12/03/2033	109.660	0,07
	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	3,050 %	12/03/2051	443.900	0,27
720.000	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	4,450 %	15/04/2070	828.900	0,51
320.000	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	3,350 %	12/03/2071	303.600	0,18
250.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III	USD	4,150 %	29/03/2027	278.088	0,17

Tenenc	ias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos	- (contir	nuación)					
		Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance Plc. (d)	USD	5,950 %	15/04/2030	777.700	0,48
	1.080.000	Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc. (d)	USD	7,500 %	05/10/2027	1.082.360	0,66
	200.000	Eurotorg LLC Via Bonitron DAC	USD	9,000 %	22/10/2025	201.000	0,12
	1.030.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC	USD	3,050 %	23/01/2025	1.054.462	0,64
	510.000	Tinkoff Bank JSC Via TCS Finance Ltd. (d)	USD	6,000 %	Perp.	497.250	0,30
						3.612.772	2,20
Isla de		Cohl Conitol Ltd	USD	4.250 %	24/04/2027	977 200	0,53
		Gohl Capital Ltd. Sasol Financing International Ltd.	USD	4,250 % 4,500 %	24/01/2027 14/11/2022	877.309 812.000	0,53
	000.000	Sasor marcing international Etc.	OOD	4,300 70	14/11/2022	1.689.309	1,03
Israel						1.009.309	1,03
	1.280.000	Bank Leumi Le-Israel BM 144A(d)(e)	USD	3,275 %	29/01/2031	1.284.600	0,78
		Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 212	ILS	(0,260 %)	02/02/2022	898.288	0,55
	525.000	Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 412	ILS	(0,140 %)	06/04/2022	166.913	0,10
		Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 622	ILS	(0,120 %)	08/06/2022	190.758	0,12
		Leviathan Bond Ltd. 144A <sup>(e)</sup>	USD	5,750 %	30/06/2023	645.971	0,39
		Leviathan Bond Ltd. 144A <sup>(e)</sup>	USD	6,750 %	30/06/2030	336.986	0,21
		Mizrahi Tefahot Bank Ltd. (d)	USD	3,077 %	07/04/2031	555.940	0,34
						4.079.456	2,49
Costa	de Marfil						
		Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	EUR	5,250 %	22/03/2030	959.665	0,59
	850.000	Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	EUR	4,875 %	30/01/2032	907.298	0,55
		Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	USD	6,125 %	15/06/2033	205.278	0,13
		Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	EUR	6,625 %	22/03/2048	1.056.758	0,64
						3.128.999	1,91
Japón							
		SoftBank Group Corp.	USD	5,125 %	19/09/2027	199.250	0,12
	350.000	SoftBank Group Corp. (d)	USD	6,000 %	Perp.	343.000	0,21
						542.250	0,33
Kenia	790.000	Bonos internacionales del Estado de Kenia	USD	7,250 %	28/02/2028	834.437	0,51
Líbano							
		Bonos internacionales del Estado de Líbano	USD	6,100 %	04/10/2022	20.700	0,01
Luxem	-	O	HOD	7 000 0/	40/00/0007	400.075	0.00
		Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.	USD	7,288 %	16/08/2037	132.875	0,08
		Guara Norte SARL	USD	5,198 %	15/06/2034	282.730	0,17
		JSM Global SARL	USD	4,750 %	20/10/2030	314.335	0,19
		Rede D'or Finance SARL	USD	4,500 %	22/01/2030	252.470	0,16
	280.000	Tupy Overseas S.A.	USD	4,500 %	16/02/2031	255.317	0,16
						1.237.727	0,76
Malasia		Axiata Spv5 Labuan Ltd.	USD	3,064 %	19/08/2050	198,279	0,12
		Genm Capital Labuan Ltd.	USD	3,882 %	19/04/2031	534.168	0,33
						732.447	0,45
Mauric	io						
		HTA Group Ltd.	USD	7,000 %	18/12/2025	330.675	0,20
		India Airport Infrastructure	USD	6,250 %	25/10/2025	246.752	0,15
		India Green Power Holdings	USD	4,000 %	22/02/2027	462.300	0,28
		MTN Mauritius Investments Ltd.	USD	4,755 %	11/11/2024	320.072	0,20
	950.000	MTN Mauritius Investments Ltd.	USD	6,500 %	13/10/2026	1.053.825	0,64
	740.000	UPL Corp., Ltd.	USD	4,625 %	16/06/2030	785.701	0,48
		UPL Corp., Ltd. <sup>(d)</sup>	USD	5,250 %	Perp.	201.968	0,12
						3.401.293	2,07
México		Ranco Mercantil del Norte S A (d)	Hen	E 7E0 0/	04/40/0004	506.376	0.04
		Banco Mercantil del Norte S.A. (d)	USD	5,750 % 6,750 %	04/10/2031		0,31
		Banco Mercantil del Norte S.A. (d)	USD	6,750 %	Perp.	693.014	0,42
		Banco Mercantil del Norte S.A. (d)	USD	7,625 %	Perp.	215.281	0,13
	42U.UUU	Banco Santander Mexico S.A. Institucion de Banca Multiple Grupo	HED	E 0E0 0/	04/40/2020	444 704	0.07
	800 000	Financiero Santander <sup>(d)</sup> BBVA Bancomer S.A. <sup>(d)</sup>	USD USD	5,950 % 5,125 %	01/10/2028 18/01/2033	444.724 906.465	0,27
	090.000	DDVA DailCUIIICI 3.A.\-/	บอบ	ე, 1∠ე %	10/01/2033	900.405	0,55

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de	% del
Bonos - (con	· ·					
México - (con	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					
200.000	Cemex SAB de CV	USD	7,375 %	05/06/2027	218.840	0,13
400.000	Cemex SAB de CV	USD	5,200 %	17/09/2030	421.530	0,26
330.000	Cemex SAB de CV <sup>(d)</sup>	USD	5,125 %	Perp.	334.744	0,21
1.650.000	Mexico City Airport Trust	USD	4,250 %	31/10/2026	1.738.725	1,06
600.000	Mexico City Airport Trust	USD	3,875 %	30/04/2028	616.868	0,38
422.000	Mexico City Airport Trust	USD	5,500 %	31/07/2047	407.652	0,25
970.000	Bonos internacionales del Estado de México	USD	2,659 %	24/05/2031	935.592	0,57
200.000	Bonos internacionales del Estado de México	EUR	2,250 %	12/08/2036	216.618	0,13
210.000	Bonos internacionales del Estado de México	USD	3,750 %	19/04/2071	183.859	0,11
210.000	Petroleos Mexicanos	USD	6,490 %	23/01/2027	215.649	0,13
270.000	Petroleos Mexicanos	USD	6,500 %	13/03/2027	277.090	0,17
					8.333.027	5,08
Mongolia						
410.000	Bonos internacionales del Estado de Mongolia	USD	5,125 %	07/04/2026	420.250	0,26
Marruecos			0.075.0/	45/40/0007	040.000	0.40
	Bonos internacionales del Estado de Marruecos	USD	2,375 %	15/12/2027	310.200	0,19
	Bonos internacionales del Estado de Marruecos	USD	3,000 %	15/12/2032	933.750	0,57
	Bonos internacionales del Estado de Marruecos	USD	4,000 %	15/12/2050	333.450	0,20
	OCP S.A.	USD	3,750 %	23/06/2031	193.500	0,12
300.000	OCP S.A.	USD	5,125 %	23/06/2051	283.395	0,17
					2.054.295	1,25
Países Bajos	FILE LANGE HALVE FRANCE		0.005.0/	07/10/0005	040.500	0.40
	First Bank of Nigeria Ltd. Via FBN Finance Co., BV	USD	8,625 %	27/10/2025	213.500	0,13
	IHS Netherlands Holdco BV	USD	8,000 %	18/09/2027	211.254	0,13
	Lukoil International Finance BV	USD	4,750 %	02/11/2026	1.194.303	0,73
	Lukoil Securities BV	USD	3,875 %	06/05/2030	215.408	0,13
	Metinvest BV	USD	7,750 %	23/04/2023	204.442	0,12
	Metinvest BV	USD	7,650 %	01/10/2027	195.422	0,12
	Mong Duong Finance Holdings BV	USD	5,125 %	07/05/2029	409.480	0,25
	MV24 Capital BV	USD	6,748 %	01/06/2034	823.620	0,50
	Prosus NV	USD	3,680 %	21/01/2030	836.779	0,51
100.000	Prosus NV	EUR	2,031 %	03/08/2032	112.363	0,07
200.000	Vivo Energy Investments BV	USD	5,125 %	24/09/2027	210.163	0,13
					4.626.734	2,82
Nigeria						
	Access Bank Plc.	USD	6,125 %	21/09/2026	904.312	0,55
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	6,500 %	28/11/2027	536.937	0,33
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	7,143 %	23/02/2030	589.000	0,36
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	7,625 %	28/11/2047	231.188	0,14
710.000	SEPLAT Energy Plc.	USD	7,750 %	01/04/2026	713.550	0,43
Manadaula dal	Manda				2.974.987	1,81
Macedonia del 720.000	Bonos internacionales del Estado de Macedonia del Norte	EUR	2,750 %	18/01/2025	842.409	0,51
	Bonos internacionales del Estado de Macedonia del Norte	EUR	3,675 %	03/06/2026	831.242	0,51
000.000	Bottos internacionales del Estado de Masedonia del Norte	Lon	0,070 70	00/00/2020	1.673.651	1,02
Noruega					1.073.031	1,02
-	DNO ASA 144A <sup>(e)</sup>	USD	8,375 %	29/05/2024	1.414.196	0,86
Omán						
810.000	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	5,625 %	17/01/2028	833.287	0,51
340.000	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	6,500 %	08/03/2047	320.875	0,19
					1.154.162	0,70
Pakistán						
1.310.000	Bonos internacionales del Estado de Pakistán	USD	6,000 %	08/04/2026	1.296.900	0,79
300.000	Bonos internacionales del Estado de Pakistán	USD	7,375 %	08/04/2031	291.750	0,18
200.000	Bonos internacionales del Estado de Pakistán	USD	8,875 %	08/04/2051	194.500	0,12
					1.783.150	1,09
Panamá						
	Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.	USD	4,000 %	11/08/2041	213.097	0,13
560.000	Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.	USD	5,125 %	11/08/2061	580.381	0,36
690.000	AES Panama Generation Holdings SRL	USD	4,375 %	31/05/2030	705.163	0,43
520.000	Banco Latinoamericano de Comercio Exterior S.A.	USD	2,375 %	14/09/2025	526.672	0,32

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (cont	,					
Panamá – (con	•	1100	4.500.0/	00/04/0000	4 000 540	0.05
	Cable Onda S.A. Panamá Notas del Tesoro 144A <sup>(e)</sup>	USD USD	4,500 % 3,750 %	30/01/2030 17/04/2026	1.069.513 424.447	0,65 0,26
400.000	Falialia Notas del Tesoro 144A(*)	03D	3,730 %	17/04/2020		
					3.519.273	2,15
Paraguay						
	Bonos internacionales del Estado de Paraguay	USD	5,000 %	15/04/2026	1.132.117	0,69
	Bonos internacionales del Estado de Paraguay	USD	2,739 %	29/01/2033	376.626	0,23
	Bonos internacionales del Estado de Paraguay	USD	6,100 %	11/08/2044	1.320.497	0,80
	Bonos internacionales del Estado de Paraguay	USD	5,600 %	13/03/2048	223.342	0,14
	Bonos internacionales del Estado de Paraguay Telefonica Celular del Paraguay S.A.	USD USD	5,400 %	30/03/2050	573.865	0,35
730.000	Telefonica Celular dei Paraguay S.A.	090	5,875 %	15/04/2027	757.061	0,46
					4.383.508	2,67
Perú						
	Consorcio Transmantaro S.A.	USD	4,700 %	16/04/2034	938.187	0,57
	Corp. Lindley S.A.	USD	4,625 %	12/04/2023	596.546	0,36
	Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru InRetail Consumer	USD USD	6,375 % 3,250 %	01/06/2028 22/03/2028	586.397 1.091.130	0,36 0,67
	Bonos del Estado de Perú	PEN	5,400 %	12/08/2034	308.217	0,07
	Bonos internacionales del Estado de Perú	USD	2,780 %	01/12/2060	50.712	0,03
	Bonos internacionales del Estado de Perú	USD	3,230 %	28/07/2121	115.353	0,07
					3.686.542	2,25
Catar						, -
	Qatar Energy	USD	3,125 %	12/07/2041	1.165.220	0,71
	Qatar Energy	USD	3,300 %	12/07/2051	1.119.294	0,68
					2.284.514	1,39
Rumanía						
50.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,875 %	11/03/2029	60.235	0,04
120.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,500 %	08/02/2030	137.395	0,08
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	3,624 %	26/05/2030	296.228	0,18
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	1,750 %	13/07/2030	321.215	0,20
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	USD	3,000 %	14/02/2031	296.250	0,18
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR EUR	2,124 %	16/07/2031	501.821	0,31
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,000 % 2,000 %	28/01/2032 14/04/2033	285.330 476.959	0,17 0,29
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,625 %	02/12/2040	272.850	0,17
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	3,375 %	28/01/2050	53.372	0,03
650.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	USD	4,000 %	14/02/2051	634.156	0,39
					3.335.811	2,04
Rusia			<del>-</del>			
1.400.000	Bonos extranjeros rusos – Eurobono	EUR	1,125 %	20/11/2027	1.576.264	0,96
200.000	Bonos extranjeros rusos – Eurobono	EUR	2,650 %	27/05/2036	229.505	0,14
200.000	Bonos extranjeros rusos – Eurobono	USD	5,250 %	23/06/2047	253.550	0,16
					2.059.319	1,26
Arabia Saudí	5	1100	0.750.0/	04/04/0055	400.000	0.00
	Bonos internacionales del Estado saudí	USD	3,750 %	21/01/2055	422.300	0,26
Senegal 920.000	Bonos internacionales del Estado de Senegal	EUR	5,375 %	08/06/2037	967.002	0,59
Serbia	<u> </u>					
	Bonos internacionales de Serbia	EUR	3,125 %	15/05/2027	503.883	0,31
	Bonos internacionales de Serbia	EUR	1,500 %	26/06/2029	107.669	0,07
100.000	Bonos internacionales de Serbia	EUR	1,650 %	03/03/2033	101.411	0,06
220.000	Bonos internacionales de Serbia	EUR	2,050 %	23/09/2036	218.410	0,13
					931.373	0,57
Singapur						
• .	Innovate Capital Pte Ltd. – Serie MCB(d)	USD	6,000 %	11/12/2024	3.633	0,00
421.449	LLPL Capital Pte Ltd.	USD	6,875 %	04/02/2039	482.256	0,29
205.031	Tiger Holdco Pte Ltd. 144A <sup>(e)</sup>	USD	13,000 %	10/06/2023	209.260	0,13
					695.149	0,42
Sudáfrica						
320.000	Absa Group Ltd. (d) Growthpoint Properties International Pty Ltd.	USD USD	6,375 % 5,872 %	Perp. 02/05/2023	325.600 518.637	0,20 0,32

	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de patrimonio
Bonos – (cont	tinuación)					
Sudáfrica – (co	•					
	Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2030	ZAR	8,000 %	31/01/2030	1.300.169	0,79
	Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2032	ZAR	8,250 %	31/03/2032	981.069	0,60
	Bonos del Estado de Sudáfrica – Serie 2037	ZAR	8,500 %	31/01/2037	525.412	0,32
840.000	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	4,300 %	12/10/2028	4.487.004	2,74
España					4.467.004	2,74
•	International Airport Finance S.A.	USD	12,000 %	15/03/2033	322.381	0,20
Supranacionale	es					
400.000	African Export-Import Bank	USD	2,634 %	17/05/2026	401.224	0,25
540.000	African Export-Import Bank	USD	3,798 %	17/05/2031	548.743	0,33
350.000	ATP Tower Holdings LLC Via Andean Tower Partners Colombia		4.050.0/	07/04/0000	0.40.740	
4 000 000	SAS Via Andean Telecom Partners	USD	4,050 %	27/04/2026	346.748	0,21
	Black Sea Trade & Development Bank	USD	3,500 %	25/06/2024	1.342.848	0,82
	Eastern & Southern African Trade & Development Bank	USD	5,375 %	14/03/2022	453.962	0,28
2.450.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank	USD	4,875 %	23/05/2024	2.526.685 5.620.210	1,54 3,43
Tailandia					5.020.210	3,43
	PTT Treasury Center Co., Ltd.	USD	3,700 %	16/07/2070	485.872	0,30
Túnez						
	Bonos internacionales del Banco Central de Túnez	USD	5,750 %	30/01/2025	151.500	0,09
Turquía 1 820 000	Anadolu Efes Biracilik ve Malt Sanayii AS	USD	3,375 %	29/06/2028	1.792.700	1,09
	Coca-Cola Icecek AS	USD	4,215 %	19/09/2024	1.289.815	0,79
	Limak Iskenderun Uluslararasi Liman Isletmeciliqi AS	USD	9,500 %	10/07/2036	499.151	0,31
	Mersin Uluslararasi Liman Isletmeciligi AS	USD	5,375 %	15/11/2024	671.797	0,41
	Bonos del Estado de Turquía	TRY	11,700 %	13/11/2030	268.448	0,16
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	6,125 %	24/10/2028	580.563	0,35
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	6,500 %	20/09/2033	405.350	0,25
	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO	USD	5,250 %	05/02/2025	889.605	0,54
	Yapi ve Kredi Bankasi AS(d)	USD	7,875 %	22/01/2031	1.388.850	0,85
	Yapi ve Kredi Bankasi AS(d)	USD	13,875 %	Perp.	440.000	0,27
					8.226.279	5,02
Ucrania						
	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	EUR	6,750 %	20/06/2026	509.473	0,31
	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	7,750 %	01/09/2026	150.181	0,09
	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	6,876 %	21/05/2029	1.044.400	0,64
1.409.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania <sup>(d)</sup>	USD	0,000 %	31/05/2040	1.271.552	0,78
					2.975.606	1,82
Emiratos Árabe	es unidos DP World Plc.	USD	5,625 %	25/09/2048	244.750	0,15
	DP World Pic. 144A <sup>(e)</sup>	USD	5,625 % 6,850 %	02/07/2037	131.625	0,18
	Bonos internacionales del Estado del Emirato de Dubái	USD	3,900 %	09/09/2050	377.000	0,23
	Finance Department Government of Sharjah	USD	3.625 %	10/03/2033	399.750	0,25
	Finance Department Government of Sharjah	USD	4,000 %	28/07/2050	740.050	0,45
	National Central Cooling Co., PJSC	USD	2,500 %	21/10/2027	964.075	0,59
	NBK Tier 1 Financing 2 Ltd. <sup>(d)</sup>	USD	4,500 %	Perp.	1.609.972	0,98
					4.467.222	2,73
Reino Unido	40					
	Gazprom PJSC Via Gaz Finance Plc.(d)	USD	4,599 %	Perp.	653.600	0,40
	Vedanta Resources Finance II Plc.	USD	8,950 %	11/03/2025	251.202	0,15
200.000	Vedanta Resources Ltd.	USD	6,125 %	09/08/2024	172.633	0,11
					1.077.435	0,66
Estados Unidos	s Austin BidCo, Inc.	USD	7,125 %	15/12/2028	102.375	0,06
100.000	Kosmos Energy Ltd.	USD	7,125 %	04/04/2026	477.500	0,00
500 000	**			01/05/2027		0,28
	Kosmos Energy I td	HSD				
710.000	Kosmos Energy Ltd.  Resorts World Las Vegas LLC Via RWLV Capital Inc.	USD	7,750 % 4 625 %		668.287 200.986	
710.000 200.000	Kosmos Energy Ltd. Resorts World Las Vegas LLC Via RWLV Capital, Inc. Sasol Financing USA LLC	USD USD USD	7,750 % 4,625 % 5,875 %	06/04/2031 27/03/2024	200.986 528.488	0,13 0,32

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor o	
Bonos - (con	tinuación)					
Uzbekistán						
270.000	National Bank of Uzbekistan	USD	4,850 %	21/10/2025	274.5	25 0,17
1.620.000	Bonos internacionales del Estado de Venezuela	USD	7,650 %	21/04/2025	162.0	0,10
<b>Zambia</b> 200.000	Bonos internacionales del Estado de Zambia	USD	5,375 %	20/09/2022	149.0	0,09
TOTAL DE BO (coste USD 13					135.105.9	79 82,42
Tenencias	Descripción del valor				Valor merca U:	
	versión – 9,26 %					
Irlanda 15.184.257	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de accione	s de distribu	ıción X) <sup>(f)(g)</sup>		15.184.2	57 9,26
TOTAL DE FOI (coste USD 15	NDOS DE INVERSIÓN .184.257)				15.184.2	57 9,26
TOTAL DE VAI	LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DI 3.084.820)	E VALORES	OFICIAL		150.290.2	36 91,68
			Tipo de		Valor mercado	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa		Fecha de vencimiento(b)		SD patrimonio
Bonos – 1,42 Islas Caimán						
	NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD USD	•	01/02/2026	71.3 167.1	
	NIO, Inc. 144A <sup>(e)</sup> Vnet Group, Inc. 144A <sup>(e)</sup>	USD	•	01/02/2027 01/02/2026	268.3	
					506.8	
Panamá						
	Cable Onda S.A. 144A <sup>(e)</sup>	USD	4,500 %	30/01/2030	205.6	75 0,13
25.475.000	Bonos internacionales del Estado de Egipto—HSBC Bank Plc. 144A <sup>(e)</sup>	EGP	0,000 %	23/12/2021	1.610.7	22 0,98
TOTAL DE BO (coste USD 2.3					2.323.2	54 1,42
TOTAL DE VAI REGULADO	LORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO					
(coste USD 2.3	362.852)				2.323.2	54 1,42
(coste USD 15	RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS 5.447.672)				152.613.4	90 93,10
Contratos de f	iuturos – (0,16 %)				<b>5</b> 1 1	
Número de contratos	Descripción del valor			Compromiso Valor de mercado en USD	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
	USD		1	0.504.500	64.005	0.01
	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/202	22	Larga Larga	2.591.500 5.792.750	61.235 203.288	0,04 0,12
20	20. aa, large plaze E2.00/20/	•		8.384.250	264.523	0,16
PLUSVALÍA LA	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS				264.523	0,16
Número de				Compromiso Valor de mercado en	Plusvalía latente	
contratos	Descripción del valor			USD	USD	% del patrimonio
(400)	USD		0- :	(47,000,050)	(000 045)	(0.10)
	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022		Corta Corta	(17.300.250) (3.504.375)	(269.245) (12.381)	(0,16) (0,01)

Divisa         Compra         Divisa         Venta         vencimiento           USD         422.935         BRL         2.394.655         02/12/2021	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
Contange		70 dei paarmente
MINUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS	(180.666) (59.555)	(0,11) (0,04)
Comparison   Com	(521.847)	(0,32)
Divisa Compra Divisa Venta venchimento BRI 2.293.913 USD 409.225 02/12/2021 EUR 69.5134 PLN 3.205.025 09/12/2021 USD 4.184.153 INR 312/707.451 07/12/2021 USD 165.994 TRY 2.108.110 10/12/2021 USD 165.994 TRY 2.108.110 10/12/2021 USD 168.800 ZAR 2.569.177 13/12/2021 USD 69.800 ZAR 2.569.179 20/12/2021 USD 69.800 ZAR 2.569.179 20/12/2021 USD 69.800 ZAR 2.569.200 EUR 3.600.200 ZAR 2.569.800 ZA	(521.847)	(0,32)
Divisa   Compri   Divisa   Venta   Venta   Venta   Part		
BRIL 2293-913 USD 409-226 027122021  BUR 608-134 PLN 3-205-025 06122021  USD 4.184.153 INR 312.707.451 071722021  USD 165-994 TRY 2.108.110 10122021  USD 165-994 TRY 2.108.110 10122021  USD 168-600 ZAR 2.509.177 13122021  USD 686.000 ZAR 2.2138.079 15122021  USD 686.000 ZAR 2.2188.079 15122021  USD 6.524.504 EUR 2.138.079 15122021  USD 6.008.81 USD 2.881.850 15122021  USD 9.284.284 15122021  USD 9.284.286 10.830.471 15122021  USD 182.751.800 EUR 2.137.658 15122021  USD 182.746 AUD 1.122.913 15122021  USD 8.24.746 AUD 1.122.913 15122021  USD 8.48.761 CAD 7.277.83 15122021  USD 8.48.761 CAD 7.277.83 15122021  USD 5.784.851 GBP 4.219.230 15122021  USD 5.784.851 GBP 4.219.230 15122021  USD 6.633.294 JPY 740.951.355 15122021  USD 6.633.294 JPY 740.951.355 15122021  USD 6.633.294 JPY 740.951.355 15122021  USD 9.2474 SAN 59.362.500 15122021  USD 9.2474.233 SEK 21.444.277 15122021  USD 9.2476.24779 USD 6.263.274 4729.285 15122021  USD 9.2474.233 SEK 21.444.277 15122021  USD 9.2476.24779 USD 6.263.2544 0202202  USD 9.2474.235 SEK 21.444.277 15122021  USD 9.2476.24779 USD 6.263.2544 0202202  USD 9.2474.235 S	Plusvalía latente en	% del
EUR 695.134 PLN 3.205.025 0917/22021 USD 4.184.153 INR 312.707.451 0717/22021 USD 165.994 TRY 2.108.110 1012/2021 USD 166.994 TRY 2.108.110 1012/2021 USD 840.00 TRY 8.028.864 141/22021 USD 849.00 TRY 8.028.864 141/22021 CHF 6.524.504 EUR 6.088.412 151/22021 CHF 2.640.881 USD 2.881.850 151/22021 CHF 2.640.881 USD 9.264.284 151/22021 USD 9.264.284 151/22021 EUR 360.871 CAD 519.880 151/22021 EUR 1078.600 PLN 4.999.881 151/22021 EUR 1073.279 SEK 10.830.471 151/22021 EUR 1073.279 SEK 10.830.471 151/22021 USD 8.06.871 CAD 1.122.913 151/22021 USD 1.122.91 151/22021 USD 8.06.871 CAD 1.122.913 151/22021 USD 8.06.871 CAD 7.277.183 151/22021 USD 8.06.873 CAD 7.277.183 151/22021 USD 8.0752.947 EUR 18.012.777 151/22021 USD 20.752.947 EUR 18.012.777 151/22021 USD 40.6552 HUF 127.141.151 151/22021 USD 2.907.247 MNN 59.302.530 151/22021 USD 2.2530.609 NZD 3.607.396 151/22021 USD 3.264.433 SEK 2.144.4277 151/22021 USD 3.264.433 SEK 2.144.4277 151/22021 USD 4.264.233 SEK 2.144.427 151/22021 USD 4.264.233 SEK 2.144.427 151/22021 USD 3.607.396 USD 1.166.00 241/22021 USD 5.64.439 COP 1.464.91.726.24 151/22021 USD 4.264.726.75 USD 1.166.200 241/22021 USD 4.264.726.75 USD 1.166.200 241/22021 USD 4.66.513 PLN 6.00.260.24 151/22021 USD 5.66.32 TRY 4.76.79.265 151/22021 USD 6.66.32 TRY 4.76.79.265 151/22021 USD 6.66.32 TRY 4.77.92.65 151/22021 USD 6.66.32 TRY 4.77.92.65 151/22021 USD 6.66.33 101/22022 USD 1.18.5 3.00.48.49 USD 1.166.200 241/22021 USD 1.18.5 3.00.48.49 USD 1.166.200 341/22021 USD 1.16.86.000 TRY 1.16.86.55.5 140/02/222 USD 1.16.86.000 TRY 1.16.86.55.5 140/02/222	USD	patrimonio
USD 4184.153 INR 312.707.451 07.712.2021 USD 165.994 TPY 2.108.110 1012.2021 USD 165.994 TPY 2.108.110 1012.2021 USD 168.600 ZAR 2.599.177 1312.2021 USD 484.000 TRY 8.028.864 14.12.2021 CAD 3.18.2838 EUR 2.138.079 1512.2021 CHF 6.524.504 EUR 6.088.412 1512.2021 CHF 2.640.881 USD 2.881.850 1512.2021 CNH 60.036.259 USD 9.284.224 1512.2021 CNH 60.036.259 USD 9.284.224 1512.2021 EUR 10.768.600 PLN 4.959.881 1512.2021 CHE 1.078.600 PLN 4.959.881 1512.2021 EUR 1.078.600 PLN 4.959.881 1512.2021 USD 1.82.2500 EUR 2.137.668 1512.2021 USD 1.82.2500 EUR 3.61.550 1512.2021 USD 824.746 AUD 1.122.913 1512.2021 USD 824.746 AUD 1.122.913 1512.2021 USD 824.746 AUD 1.122.913 1512.2021 USD 8.24.746 AUD 1.122.913 1512.2021 USD 8.04.746 AUD 1.122.913 1512.2021 USD 8.04.836 CZK 18.521.317 1512.2021 USD 9.07.29.947 EUR 18.012.777 1512.2021 USD 9.07.29.947 EUR 18.012.777 1512.2021 USD 0.68.33.294 JPY 740.951.555 1512.2021 USD 0.68.33.294 JPY 740.951.555 1512.2021 USD 0.2474.233 EKE 21.444.277 1512.2021 USD 0.2474.233 EKE 21.444.277 1512.2021 USD 0.2474.233 EKE 21.444.277 1512.2021 USD 0.50.05.292 TRY 47.279.265 1512.2021 USD 0.50.05.292 TRY 47.279.2	373	0,00
USD 165.994 TRY 2.008.110 1012/22021 USD 168.600 ZAR 2.569.177 1312/22021 USD 848.000 TRY 8.028.864 1412/22021 USD 848.000 TRY 8.028.864 1412/22021 CAD 3.182.838 EUR 2.138.079 1512/22021 CHF 6.524.594 EUR 6.088.412 1512/22021 CHF 2.640.881 USD 2.881.850 1512/22021 CHF 2.640.881 USD 2.881.850 1512/22021 EUR 360.871 CAD 519.880 1512/22021 EUR 1.073.679 SEK 10.830.471 1512/22021 EUR 1.073.279 SEK 10.830.471 1512/22021 USD 1.827.746.751 CAD 7.277.163 1512/22021 USD 824.746 AUD 1.122.913 1512/22021 USD 824.746 AUD 1.122.913 1512/22021 USD 824.746 AUD 1.122.913 1512/22021 USD 824.746 SOR 10.830.871 1512/22021 USD 824.746 SOR 10.830.871 1512/22021 USD 824.746 SOR 10.830.871 1512/22021 USD 824.748 SOR 10.830.871 1512/22021 USD 925.748.751 CAD 7.277.163 1512/22021 USD 926.752.947 EUR 18.012.777 1512/2021 USD 926.752.947 WMN 59.362.530 1512/22021 USD 926.752.947 MMN 59.362.530 1512/22021 USD 2.937.247 MMN 59.362.530 1512/22021 USD 2.530.609 NZD 3.607.396 1512/22021 USD 3.608.397 MMN 59.362.530 1512/2021 USD 4.248.87 CAD 3.607.396 1512/22021 USD 4.248.87 CAD 3.607.396 1512/22021 USD 4.249.89 SOR 3.609.396 15102/22021 USD 4.249.89 SOR 3.609.396 510102/2202 USD 4.249.89 SOR 3.609.396 510102/2202 USD 4.249.59 SOR 3.609	10.587	0,00
USD 168 600 ZAR 2.569.177 13/12/2021 USD 348.000 TRY 8.028.864 14/12/2021 CAD 3.182.838 EUR 2.138.079 15/12/2021 CHF 6.524.504 EUR 6.088.412 15/12/2021 CHF 2.640.881 USD 2.881.850 15/12/2021 CHH 60.036.259 USD 9.284.284 15/12/2021 CHH 60.036.259 USD 9.284.284 15/12/2021 EUR 10.78.600 PLN 4.959.881 15/12/2021 EUR 1.078.600 PLN 4.959.881 15/12/2021 EUR 1.073.279 SEK 10.830.471 15/12/2021 USD 8.247.46 AUD 1.122.913 15/12/2021 USD 824.746 AUD 1.122.913 15/12/2021 USD 824.746 AUD 1.122.913 15/12/2021 USD 840.836 CZK 18.521.317 15/12/2021 USD 840.836 CZK 18.521.317 15/12/2021 USD 860.552 HUF 12.741.151 15/12/2021 USD 9.655.2947 EUR 18.012.777 15/12/2021 USD 9.655.2947 WNN 59.962.530 15/12/2021 USD 9.653.575 NOK 23.011.159 15/12/2021 USD 2.0752.947 WNN 59.962.530 15/12/2021 USD 2.550.609 NZD 3.607.386 15/12/2021 USD 3.607.386 15/12/2021 USD 3.608.402 WRY 3.608.402 NZ 3.011.159 15/12/2021 USD 3.608.402 NZ 3.608.402 NZ 3.011.159 3.608.602 15/12/2021 USD 3.608.402 NZ 3.608.402 NZ 3.018.402 NZ 3.018.4	19.716	0,01
USD 48.600 TRY 8.028.84 141/22021 CAD 3.182.838 EUR 2.138.079 151/22021 CHF 6.524.504 EUR 6.088.412 151/22021 CHF 6.524.504 EUR 6.088.412 151/22021 CHF 2.640.881 USD 2.881.850 151/22021 EUR 360.871 CAD 519.880 151/22021 EUR 10.708.600 PLN 4.959.881 151/22021 EUR 1.073.279 SEK 10.830.471 151/22021 EUR 1.074.279 EUR 1.072.771.83 151/22021 EUR 1.074.279 EUR 1.072.272 151/22021 EUR 1.072.279 EUR 1.072	5.699	0,00
CAD 3.182.838 EUR 2.138.079 151/22021 CHIF 6.524.504 EUR 6.088.412 151/22021 CHIF 2.640.881 USD 2.881.850 151/22021 CNH 60.036.259 USD 9.284.284 151/22021 EUR 10/78.600 PLN 4.959.881 151/22021 EUR 1.078.600 PLN 4.959.881 151/22021 EUR 1.078.600 PLN 4.959.881 151/22021 EUR 1.073.279 SEK 10.830.471 151/22021 EUR 1.073.279 SEK 10.830.471 151/22021 SED 1.825.200 EUR 2.137.658 151/22021 SUSD 1.825.200 EUR 2.137.658 151/22021 USD 1.827.751 CAD 1.122.913 151/22021 USD 2.847.46 AUD 1.122.913 151/22021 USD 2.474.6 AUD 1.122.913 151/22021 USD 3.468.50 CZK 1.552.317 151/22021 USD 5.748.751 CAD 7.277.183 151/22021 USD 5.748.751 CAD 7.277.183 151/22021 USD 5.748.751 CAD 7.277.183 151/22021 USD 5.784.483 GBP 4.219.230 151/22021 USD 5.784.483 GBP 4.219.230 151/22021 USD 5.784.483 GBP 4.219.230 151/22021 USD 6.633.294 JPY 7.49.951.355 151/22021 USD 6.633.294 JPY 7.49.951.355 151/22021 USD 2.653.675 NOK 2.3011.59 151/22021 USD 2.653.675 NOK 2.3011.59 151/22021 USD 2.653.675 NOK 2.3011.59 151/22021 USD 2.503.600 NZD 3.007.396 151/22021 USD 2.504.825 SIN SEK 2.1444.277 151/22021 USD 2.505.828 TRY 4.779.265 151/22021 USD 2.505.828 TRY 4.779.265 151/22021 USD 1.185.021 THB 39.689.622 151/22021 USD 1.185.021 THB 39.689.622 201/22021 USD 1.505.036.492 USD 1.166.200 241/22021 USD 1.505.036.492 USD 1.166.200 241/22021 USD 1.506.036.492 USD 1.166.200 241/22021 USD 1.168.021 THB 39.689.622 151/22021 USD 1.168.021 THB 39.689.622 151/22021 USD 1.185.021 THB 39.689.622 151/22021 USD 1.185.021 THB 39.689.622 151/22021 USD 1.168.021 THB 39.689.6	7.740	0,00
CHF 6.224_504 EUR 6.088_412 15/12/2021 CHF 2.640.881 USD 2.881.850 15/12/2021 CNH 60.036.259 USD 9.284_284 15/12/2021 EUR 3060.871 CAD 519.880 15/12/2021 EUR 1.078.600 PLN 4.959.881 15/12/2021 EUR 1.078.600 PLN 4.959.881 15/12/2021 EUR 1.073.279 SEK 10.830.471 15/12/2021 EUR 1.073.279 SEK 10.830.471 15/12/2021 EUR 1.312.380 EUR 2.137.658 15/12/2021 EUR 3.1312.380 EUR 361.550 15/12/2021 EUR 3.15/12/2021 EUR 3.15	238.643	0,15
CHIF 2.408.81 USD 2.881.850 15/12/2021 CNH 60.036.259 USD 9.284.284 15/12/2021 EUR 360.871 CAD 519.880 15/12/2021 EUR 1.078.600 PLN 4.959.881 15/12/2021 EUR 1.073.279 SEK 10.830.471 15/12/2021 GBP 1.825.200 EUR 2.137.658 15/12/2021 LIS 1.312.380 EUR 3.61.550 15/12/2021 LIS 1.312.380 EUR 3.61.550 15/12/2021 LIS 1.312.380 EUR 1.451.801 15/12/2021 LIS 1.312.380 EUR 1.312.381 15/12/2021 LIS 1.312.380 EUR 1.312.381 15/12/2021 LIS 1.312.380 EUR 1.312.381 15/12/2021 LIS 1.312.381 EUR 1.312.381 15/12/2021 LIS 1.312.381 EUR 1.312.381 15/12/2021 LIS 1.312.382 EUR 1.312.381 15/12/2021 LIS 1.312.382 EUR 1.312.382 EUR 1.312.382 15/12/2021 LIS 1.312.312.312 15/12/2021 LIS 1.312.312.312 15/12/2021 LIS 1.312.312 15/12/	58.898	0,03
CMH 60.036.259 USD 9.284.284 15/12/2021 EUR 360.871 CAD 519.880 15/12/2021 EUR 1.078.600 PLN 4.959.881 15/12/2021 EUR 1.073.279 SEK 10.830.471 15/12/2021 EUR 1.073.279 SEK 10.830.471 15/12/2021 EUR 1.073.279 SEK 10.830.471 15/12/2021 EUR 1.1073.279 SEK 10.830.471 15/12/2021 EUR 2.137.658 15/12/2021 EUR 361.550 15/12/2021 EUR 1.451.801 15/12/2021 EUR 1.801.2777 15/12/2021 EUR 1.801.2778 15/12/2021 E	195.587	0,12
EUR 360.871 CAD 519.880 18/12/2021 EUR 1.078.600 PLN 4.959.881 16/12/2021 EUR 1.073.279 SEK 10.830,471 16/12/2021 GBP 1.825.200 EUR 2.137.658 16/12/2021 LIS 1.312.380 EUR 3.61.550 16/12/2021 LIS 1.312.380 EUR 3.61.550 16/12/2021 LIS 1.312.380 EUR 1.451.801 16/12/2021 JPY 186.775.180 EUR 1.451.801 16/12/2021 JPY 186.775.180 EUR 1.451.801 16/12/2021 USD 824.746 AUD 1.122.913 16/12/2021 USD 825.947 EUR 18.012.777 16/12/2021 USD 5.784.483 GBP 4.219.230 16/12/2021 USD 6.633.294 JPY 740.951.355 15/12/2021 USD 6.633.294 JPY 740.951.355 15/12/2021 USD 6.633.294 JPY 740.951.355 15/12/2021 USD 2.907.247 MXN 59.362.530 16/12/2021 USD 2.530.609 NZD 3.607.396 16/12/2021 USD 2.530.609 NZD 3.607.396 16/12/2021 USD 2.530.609 NZD 3.607.396 16/12/2021 USD 8.23.613 SGD 1.120.320 16/12/2021 USD 1.138.021 THB 3.968.962 16/12/2021 USD 1.143.021 THB 3.968.962 16/12/2021 USD 1.145 USD 1.146.200 24/12/2021 USD 1.145 USD 1.146.200 24/12/2021 USD 1.145 USD 1.146.200 24/12/2021 USD 1.146.200 24/12/2021 USD 1.147 USD 6.00.243 1901/2022 USD 1.146.91 USD 6.00.243 1901/2022 USD 1.146.91 USD 6.00.243 1901/2022 USD 1.145.732 TRY 1.160.58.21 000/2022 USD 1.186.732 TRY 1.160.58.52 14/06/2022 USD 1.186.733 TRY 1.160.58.52 14/06/2022 USD 1.186.733 TRY 1.160.58.552 14/06/2022 USD 1.186.733 TRY 1.160.58.552 14/06/2022 USD 1.186.733 TRY 1.160.58.552 14/06/2022 USD 1.186.735 BRL 2.394.655 02/12/2021	2.645	0,01
EUR 1.078.600 PLN 4.959.881 15/12/2021  GBP 1.825.200 EUR 2.137.668 15/12/2021  LIS 1.312.380 EUR 361.550 15/12/2021  LISD 824.746 AUD 1.122.913 15/12/2021  USD 824.746 AUD 1.122.913 15/12/2021  USD 840.836 CZK 18.521.317 15/12/2021  USD 840.836 CZK 18.521.317 15/12/2021  USD 840.836 CZK 18.521.317 15/12/2021  USD 940.6552 HUF 18.012.777 15/12/2021  USD 406.552 HUF 127.141.151 15/12/2021  USD 406.552 HUF 127.141.151 15/12/2021  USD 633.294 JPY 740.951.355 15/12/2021  USD 2.957.247 MXN 59.362.530 15/12/2021  USD 2.957.247 MXN 59.362.530 15/12/2021  USD 2.653.575 NOK 23.011.159 15/12/2021  USD 2.653.575 NOK 23.011.159 15/12/2021  USD 2.653.575 NOK 3.007.396 15/12/2021  USD 2.653.575 NOK 3.007.396 15/12/2021  USD 2.474.233 SEK 21.444.277 15/12/2021  USD 2.474.233 SEK 21.444.277 15/12/2021  USD 3.267.367 NOK 3.007.396 15/12/2021  USD 1.163.021 THB 39.699.622 15/12/2021  USD 5.052.522 TRY 47.279.265 15/12/2021  USD 5.052.521 THB 39.699.62 2 15/12/2021  USD 5.075.55 ZAR 73.410.942 15/12/2021  USD 5.017.565 ZAR 73.410.942 15/12/2021  USD 5.017.565 ZAR 73.410.942 15/12/2021  USD 5.017.565 ZAR 3.004.99 21/11/2021  USD 5.017.565 ZAR 3.004.99 21/11/2021  USD 5.017.565 ZAR 3.004.99 21/11/2021  USD 5.017.565 ZAR 3.004.99 30.004.99 21/11/2021  USD 5.017.565 ZAR 3.004.99 30.004.99 21/11/2021  USD 5.018.60 SAR 3.004.99 21/11/2021  USD 6.005 SAR 3.004.99 30.004.99 30.004.99 30.004.99 30.004.99 30.004.99 30.004.99 30.004.99 30.004.99 30.004.99 30.004.99 30.004.99 30.004.	133.573	0,07
EUR 1.073.279 SEK 10.830.471 15/12/2021 GBP 1.825.200 EUR 2.137.658 15/12/2021 USD 1.312.380 EUR 361.550 15/12/2021 USD 2.074.7510 EUR 1.451.801 15/12/2021 USD 82.4746 AUD 1.122.913 15/12/2021 USD 3.40.836 CZK 18.521.317 15/12/2021 USD 40.6.552 HUF 18.012.777 15/12/2021 USD 40.6.552 HUF 127.141.151 15/12/2021 USD 40.6.552 HUF 127.141.151 15/12/2021 USD 6.633.294 HPY 74.0951.355 15/12/2021 USD 2.907.247 MXN 59.362.530 15/12/2021 USD 2.907.247 MXN 59.362.530 15/12/2021 USD 2.500.609 NZD 3.607.366 15/12/2021 USD 2.500.609 NZD 3.607.366 15/12/2021 USD 2.474.233 SEK 21.444.277 15/12/2021 USD 3.23.613 SGD 1.120.320 15/12/2021 USD 3.2474.231 SEK 21.444.277 15/12/2021 USD 4.240.220 11/2/2021 USD 4.240.220 11/2/2021 USD 3.260.240 11/2/2021 USD 4.240.240 11/2/2021 USD 4.240.250 11	3.631	0,00
GBP 1.825.200 EUR 2.137.658 15/12/2021  ILS 1.312.380 EUR 301.550 15/12/2021  ILS 1.312.380 EUR 301.550 15/12/2021  USD 824.7146 AUD 1.1.22.913 15/12/2021  USD 824.7146 AUD 1.1.22.913 15/12/2021  USD 5.748.751 CAD 7.277.183 15/12/2021  USD 840.836 CZK 18.521.317 15/12/2021  USD 840.836 CZK 18.521.317 15/12/2021  USD 20.752.947 EUR 18.012.777 15/12/2021  USD 406.552 HUF 127.141.151 15/12/2021  USD 406.552 HUF 127.141.151 15/12/2021  USD 406.552 HUF 127.141.151 15/12/2021  USD 6.633.294 JPY 740.951.355 15/12/2021  USD 2.907.247 MXN 59.362.530 15/12/2021  USD 2.653.575 NOK 23.011.159 15/12/2021  USD 2.653.575 NOK 30.011.159 15/12/2021  USD 2.675.010 NCZ 3.677.396 15/12/2021  USD 2.675.010 NCZ 3.677.396 15/12/2021  USD 3.607.396 15/12/2021  USD 3.607.396 15/12/2021  USD 3.607.396 22 TRY 47.279.265 15/12/2021  USD 5.015.685 ZAR 73.410.942 15/12/2021  USD 3.607.396 ZAR 30.699.622 15/12/2021  USD 3.607.396 ZAR 30.699.622 20/12/2021  USD 3.607.396 ZAR 30.069.90 21/12/2021  USD 3.607.399 ZAR 30.069.491 22/12/2021  USD 3.607.399 ZAR 30.458.480 03/02/2022  USD 3.606.000 TRY 15.666.313 10/02/2022  USD 1.666.000 TRY 15.666.305 PLA 20.00000000000000000000000000000000000	20.751	0,01
ILS	19.986	0,02
JPY 186.775.180 EUR 1.451.801 1.51/22/221 USD 624.746 AUD 1.122.913 1.51/12/2021 USD 5.746.751 CAD 7.277.183 1.51/12/2021 USD 5.746.751 CAD 7.277.183 1.51/12/2021 USD 840.836 CZK 18.521.317 1.51/12/2021 USD 20.752.947 EUR 18.012.777 1.51/12/2021 USD 5.784.843 GBP 4.219.230 1.51/12/2021 USD 406.552 HUF 127.141.151 1.51/12/2021 USD 406.552 HUF 127.141.151 1.51/12/2021 USD 6.633.294 JPY 740.951.355 1.51/12/2021 USD 2.907.247 MXN 59.362.530 1.51/12/2021 USD 2.530.609 NZD 3.607.396 1.51/12/2021 USD 2.500.509 NZD 3.607.396 1.51/12/2021 USD 2.500.509 NZD 3.607.396 1.51/12/2021 USD 2.750.701 THB 30.689.622 1.51/12/2021 USD 5.05.282 TRY 47.279.265 1.51/12/2021 USD 5.015.565 ZAR 73.410.942 1.51/12/2021 USD 5.015.565 ZAR 73.410.942 1.51/12/2021 USD 5.015.565 ZAR 73.410.942 1.51/12/2021 USD 10.79.14 ILS 3.00.649 2.71/12/2021 USD 10.79.14 ILS 3.00.649 2.71/12/2021 USD 10.72.4779 USD 3.604.99 2.71/12/2021 USD 10.72.4779 USD 6.20.243 1.90/12/2021 USD 3.604.99 USD 1.51.602.913 2.71/12/2021 USD 3.604.99 USD 1.51.602.913 2.71/12/2021 USD 3.604.99 USD 1.51.602.913 2.71/12/2021 USD 3.604.99 USD 3	5.452	0,00
USD 824,746 AUD 1.122,913 15/12/2021 USD 5.748,751 CAD 7.277.183 15/12/2021 USD 840,836 CZK 18,521,317 15/12/2021 USD 20,752,947 EUR 18,012,777 15/12/2021 USD 406,552 HUF 18,012,777 15/12/2021 USD 406,552 HUF 127.141.151 15/12/2021 USD 6,833,294 JPY 740,951,355 15/12/2021 USD 6,833,294 JPY 740,951,355 15/12/2021 USD 2,907,247 MNN 59,362,530 15/12/2021 USD 2,907,247 MNN 59,362,530 15/12/2021 USD 2,253,669 NZD 3,607,396 15/12/2021 USD 2,474,233 SEK 21,444,277 15/12/2021 USD 5,253,669 NZD 3,607,396 15/12/2021 USD 5,253,675 NCK 23,011,159 15/12/2021 USD 5,1183,021 THB 39,689,622 15/12/2021 USD 5,1183,021 THB 39,689,622 15/12/2021 USD 5,107,565 ZAR 73,410,942 15/12/2021 USD 5,107,565 ZAR 73,410,942 15/12/2021 USD 5,107,914 ILS 30,049 21/12/2021 USD 5,108,721 ILS 3,064,94 21/12/2021 USD 5,108,721 ILS 3,064,94 21/12/2021 USD 5,108,721 ILS 3,064,94 21/12/2021 USD 5,108,721 ILS 1,602,913 22/12/2021 USD 10,145 ILS 3,084,94 USD 1,166,200 24/12/2021 USD 434,128 COP 1,646,917,285 21/01/2022 USD 365,049 ILS 1,125,139 26/01/2022 USD 365,049 ILS 1,125,139 26/01/2022 USD 365,049 ILS 1,125,139 26/01/2022 USD 1,957,399 ZAR 30,458,480 03/02/2022 USD 4,847 CAD 272,000 31/01/2022 USD 1,957,399 ZAR 30,458,480 03/02/2022 USD 1,957,399 ZAR 30,458,450 03/02/2022 USD 1,957,399 ZAR 30,458,550 19/15/7 10/02/2022 USD 1,958,000 TRY 116,05,821 06/04/2022 USD 1,958,000 TRY 116,05,825 14/06/2022 USD 1,958,000 TRY 116,05,825 14/06/2022 USD 1,968,000 TRY 116,05,825 14/06/2022 USD 1,968,000 TRY 116,05,825	5.843	0,00
USD 5.748.751 CAD 7.277.183 15/12/2021 USD 840.836 CZK 18.521.317 15/12/2021 USD 840.836 CZK 18.521.317 15/12/2021 USD 20.752.947 EUR 18.10.12.777 15/12/2021 USD 5.764.483 GBP 4.219.230 15/12/2021 USD 406.552 HUF 127.141.151 15/12/2021 USD 6.833.294 JPY 740.951.355 15/12/2021 USD 6.833.294 JPY 740.951.355 15/12/2021 USD 2.653.575 NOK 23.011.159 15/12/2021 USD 2.550.009 NZD 3.607.396 15/12/2021 USD 5.205.282 TRY 4.7279.265 15/12/2021 USD 5.017.565 ZAR 73.410.942 15/12/2021 USD 5.10.7572 USD 5.10.7572 USD 3.607.396 21/12/2021 USD 5.10.7572 USD 3.607.396 21/12/2021 USD 5.10.7572 USD 3.607.396 32/12/2021 USD 3.608.492 USD 3.608.492 USD 3.608.493 USD 3.608.4	6.415	0,00
USD 840.836 CZK 18.521.317 15/12/2021 USD 20.752.947 EUR 18.012.777 15/12/2021 USD 20.752.947 EUR 18.012.777 15/12/2021 USD 5.784.483 GBP 4.219.230 15/12/2021 USD 6.633.294 JPY 740.951.355 15/12/2021 USD 6.633.294 JPY 740.951.355 15/12/2021 USD 2.907.247 MXN 59.362.530 15/12/2021 USD 2.907.247 MXN 59.362.530 15/12/2021 USD 2.635.675 NOK 23.011.159 15/12/2021 USD 2.635.675 NOK 23.011.159 15/12/2021 USD 2.635.675 NOK 23.011.159 15/12/2021 USD 2.630.609 NZD 3.607.396 15/12/2021 USD 2.630.609 NZD 3.607.396 15/12/2021 USD 2.474.233 SEK 21.444.277 15/12/2021 USD 823.613 SGD 1.120.320 15/12/2021 USD 1.183.021 THB 39.689.622 15/12/2021 USD 5.05.262 TRY 47.279.665 15/12/2021 USD 5.05.262 TRY 47.279.665 15/12/2021 USD 5.075.665 ZAR 73.410.942 15/12/2021 USD 275.701 TRY 3.302.222 20/12/2021 USD 10.7914 ILS 330.649 21/12/2021 USD 50.872 ILS 3.694.992 USD 3.166.200 24/12/2021 USD 50.872 ILS 3.694.992 USD 3.12.84 24/12/2021 USD 40.145 ILS 3.0469.2913 22/12/2021 USD 40.145 ILS 3.0469.2913 22/12/2021 USD 40.145 ILS 3.12.184 24/12/2021 USD 40.145 ILS 3.12.139 26/01/2022 USD 40.146.249 PEN 4.186 INSTANCE DE DIVISAS A PLAZO USD 4.186.000 TRY 4.186 INSTANCE DE DIVISAS A PLAZO USD 4.24.665 USD 4.	20.410	0,01
USD 20.752.947 EUR 18.012.777 15/12/2021 USD 5.784.483 GBP 4.219.230 15/12/2021 USD 5.784.483 GBP 4.219.230 15/12/2021 USD 406.552 HUF 127.141.151 15/12/2021 USD 6.633.294 JPY 740.951.355 15/12/2021 USD 2.907.247 MXN 59.362.530 15/12/2021 USD 2.653.757 NOK 23.011.159 15/12/2021 USD 2.653.575 NOK 23.011.159 15/12/2021 USD 2.530.609 NZD 3.607.396 15/12/2021 USD 2.530.609 NZD 3.609.396 15/12/2021 USD 5.205.282 TRY 47.279.265 15/12/2021 USD 5.205.282 TRY 47.279.265 15/12/2021 USD 5.017.565 ZAR 73.410.942 15/12/2021 USD 5.017.565 ZAR 73.410.942 15/12/2021 USD 5.017.565 ZAR 73.410.942 15/12/2021 USD 275.701 TRY 3.302.222 20/12/2021 USD 5.10.872 USD 10.914 USD 3.004.99 21/12/2021 USD 5.10.872 USD 1.09.10.1418 USD 3.004.99 21/12/2021 USD 5.10.872 USD 3.004.99 USD 3.004.99 21/12/2021 USD 5.10.872 USD 3.004.99 USD 3.004.99 21/12/2021 USD 5.10.872 USD 3.004.99 USD 3.004.99 USD 3.004.99 21/12/2021 USD 3.004.99 USD	49.270	0,03
USD 5.784.483 GBP 4.219.230 15/12/2021 USD 406.552 HUF 127.141.151 15/12/2021 USD 406.552 HUF 127.141.151 15/12/2021 USD 6.633.294 JPY 740.951.355 15/12/2021 USD 2.907.247 MXN 59.362.530 15/12/2021 USD 2.653.675 NOK 23.011.159 15/12/2021 USD 2.653.675 NOK 23.011.159 15/12/2021 USD 2.530.609 NZD 3.607.396 15/12/2021 USD 2.474.233 SEK 21.444.277 15/12/2021 USD 823.613 SGD 1.120.320 15/12/2021 USD 823.613 SGD 1.120.320 15/12/2021 USD 823.613 SGD 1.120.320 15/12/2021 USD 50.11.83.021 THB 39.689.622 15/12/2021 USD 50.15.655 ZAR 73.410.942 15/12/2021 USD 50.17.565 ZAR 73.410.942 15/12/2021 USD 50.10.872 ILS 30.649 21/12/2021 USD 50.10.872 ILS 30.649 21/12/2021 USD 50.10.872 ILS 30.649 21/12/2021 USD 50.874 ILS 30.649 20.243 19/01/2022 USD 50.10.474 ILS 312.184 24/12/2021 USD 50.14.45 ILS 312.184 24/12/2021 USD 50.14.45 ILS 312.184 24/12/2021 USD 50.14.46 S0.12	16.231	0,00
USD 406.552 HUF 127.141.151 15/12/2021 USD 6.633.294 JPY 740.951.355 15/12/2021 USD 6.633.294 JPY 740.951.355 15/12/2021 USD 2.907.247 MXN 59.362.530 15/12/2021 USD 2.653.575 NOK 23.011.159 15/12/2021 USD 2.530.609 NZD 3.607.396 15/12/2021 USD 2.530.609 NZD 3.607.396 15/12/2021 USD 2.474.233 SEK 21.444.277 15/12/2021 USD 823.613 SGD 1.120.320 15/12/2021 USD 823.613 SGD 1.120.320 15/12/2021 USD 5.205.282 TRY 47.279.265 15/12/2021 USD 5.205.282 TRY 47.279.265 15/12/2021 USD 5.205.282 TRY 47.279.265 15/12/2021 USD 5.017.565 ZAR 73.410.942 15/12/2021 USD 5.017.565 ZAR 73.410.942 15/12/2021 USD 10.75.701 TRY 3.302.222 20/12/2021 USD 10.75.701 TRY 3.302.222 20/12/2021 USD 10.75.701 TRY 3.302.222 20/12/2021 USD 10.75.701 USD 2.75.701 USD 2.75.7	247.975	0,16
USD 6.633.294 JPY 740.951.355 15/12/2021 USD 2.907.247 MXN 59.362.530 15/12/2021 USD 2.653.575 NOK 23.011.159 15/12/2021 USD 2.530.609 NZD 3.607.396 15/12/2021 USD 2.530.609 NZD 3.607.396 15/12/2021 USD 2.474.233 SEK 21.444.277 15/12/2021 USD 8.23.613 SGD 1.120.300 15/12/2021 USD 1.183.021 THB 39.689.622 15/12/2021 USD 5.205.282 TRY 47.279.265 15/12/2021 USD 5.205.282 TRY 47.279.265 15/12/2021 USD 5.017.556 ZAR 73.410.942 15/12/2021 USD 5.017.556 ZAR 73.410.942 15/12/2021 USD 775.701 TRY 3.302.222 20/12/2021 USD 107.914 ILS 30.649 21/12/2021 USD 107.914 ILS 31.60.2913 22/12/2021 USD 107.914 ILS 30.694.92 USD 1.166.200 24/12/2021 USD 107.914 ILS 30.694.92 USD 1.166.200 32/12/2021 USD 107.914 ILS 312.184 24/12/2021 USD 49.4128 COP 1.646.917.285 21/01/2022 USD 365.049 ILS 1.125.139 26/01/2022 USD 365.049 ILS 1.125.139 26/01/2022 USD 391.390 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 391.390 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 391.393 CLP 774.575.524 07/02/2022 USD 391.393 CLP 774.575.524 07/02/2022 USD 391.393 CLP 774.575.524 07/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 3.1662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.865.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.865.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.865.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.865.552 TRY 11.605.855 14/06/2022 USD 1.865.752 TRY 11.605.855 14/06/2022 USD 1.867.4655 RUB 93.665.552 14/06/2022 USD 1.867.4656 RUB 93.665.552 14/06/2022	146.666	0,10
USD 2,007.247 MXN 59.362.530 15/12/2021 USD 2,653.575 NOK 23,011.159 15/12/2021 USD 2,653.675 NOK 23,011.159 15/12/2021 USD 2,530.609 NZD 3,607.396 15/12/2021 USD 2,474.233 SEK 21,444.277 15/12/2021 USD 823.613 SGD 1,120.320 15/12/2021 USD 1,183.021 THB 39.689.622 15/12/2021 USD 5,205.282 TRY 47.279.265 15/12/2021 USD 5,017.565 ZAR 73,410.942 15/12/2021 USD 5,017.565 ZAR 73,410.942 15/12/2021 USD 107.914 ILS 330.649 21/12/2021 USD 107.914 ILS 330.649 21/12/2021 USD 510.872 ILS 1,602.913 22/12/2021 USD 510.874 USD 1,166.200 24/12/2021 USD 510.8145 ILS 312.184 24/12/2021 USD 434.128 COP 1,646.917.285 21/10/12/202 USD 365.049 ILS 1,125.139 26/01/2022 USD 365.049 ILS 1,125.139 26/01/2022 USD 365.049 ILS 2,825.424 02/02/2022 USD 911.997.399 ZAR 30.458.480 30/02/2022 USD 911.997.399 ZAR 30.458.480 30/02/2022 USD 981.353 CLP 734.572.524 02/02/2022 USD 981.353 CLP 734.572.524 02/02/2022 USD 464.249 PEN 1,873.243 10/02/2022 USD 1,957.399 ZAR 30.458.480 30/02/2022 USD 464.249 PEN 1,873.243 10/02/2022 USD 1,957.399 ZAR 30.458.480 30/02/2022 USD 1,957.399 ZAR 30.458.480 30/02/2022 USD 464.249 PEN 1,873.243 10/02/2022 USD 464.249 PEN 1,873.243 10/02/2022 USD 1,957.399 ZAR 30.458.480 30/02/2022 USD 1,957.399 ZAR 30.458.480 30/02/2022 USD 1,957.399 ZAR 30.458.480 30/02/2022 USD 464.249 PEN 1,873.243 10/02/2022 USD 1,957.391 ZAR 30.458.480 30/02/2022 USD 1,957.392 TRY 11.605.821 66/04/2022 USD 1,857.32 TRY 11.605.821 66/04/2022 USD 1,185.732 TRY 11.605.821 66/04/2022	11.236	0,01
USD 2.653.575 NOK 23.011.159 15/12/2021 USD 2.530.609 NZD 3.607.396 15/12/2021 USD 2.530.609 NZD 3.607.396 15/12/2021 USD 2.474.233 SEK 21.444.277 15/12/2021 USD 823.613 SGD 1.120.320 15/12/2021 USD 823.613 SGD 1.120.320 15/12/2021 USD 5.205.282 TRY 47.279.265 15/12/2021 USD 5.205.282 TRY 47.279.265 15/12/2021 USD 5.005.282 TRY 47.279.265 15/12/2021 USD 5.075.665 ZAR 73.410.942 15/12/2021 USD 10.79.14 ILS 330.649 21/12/2021 USD 10.79.14 ILS 330.649 21/12/2021 USD 510.872 USD 10.79.14 ILS 330.649 21/12/2021 USD 510.872 USD 1.166.200 12/12/2021 USD 510.872 USD 1.166.200 12/12/2021 USD 10.145 ILS 312.184 22/12/2021 USD 12.24.779 USD 620.243 19/01/2022 USD 434.128 COP 1.646.712.255 21/10/12/2021 USD 365.049 ILS 1.125.139 26/01/2022 USD 365.049 ILS 1.125.139 26/01/2022 USD 365.049 ILS 1.125.139 26/01/2022 USD 911.909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 911.909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 02/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 02/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.815.732 TRY 11.605.851 06/04/2022 USD 1.815.732 TRY 11.605.851 06/04/2022 USD 1.815.732 TRY 11.605.852 14/06/2022 PUUSD 1.696.000 TRY 16.365.552 14/06/2022 PUUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO	51.589	0,03
USD 2.530.609 NZD 3.607.396 15/12/2021 USD 2.474.233 SEK 21.444.277 15/12/2021 USD 2.474.233 SEK 21.444.277 15/12/2021 USD 823.613 SGD 1.120.320 15/12/2021 USD 1.183.021 THB 39.689.622 15/12/2021 USD 5.005.282 TRY 47.279.265 15/12/2021 USD 5.017.565 ZAR 73.410.942 15/12/2021 USD 5.017.565 ZAR 73.410.942 20/12/2021 USD 10.79.14 US 3302.222 20/12/2021 USD 10.79.14 US 3302.222 20/12/2021 USD 510.872 USD 10.79.14 US 330.649 21/12/2021 USD 510.872 USD 1.166.200 22/1/2/2021 USD 510.872 USD 1.166.200 22/1/2/2021 USD 10.145 US 312.184 24/12/2021 USD 10.145 US 312.184 24/12/2021 USD 10.145 US 312.184 24/12/2021 USD 434.128 COP 1.646.917.285 21/0/12/22 USD 365.049 US 1.152.5139 26/0/12/22 USD 365.049 US 1.152.5139 26/0/12/22 USD 365.049 US 1.152.5139 26/0/12/22 USD 365.049 US 218.487 CAD 272.000 31/0/12/22 USD 911.909 US 2.18.487 CAD 272.000 31/0/12/22 USD 911.909 US 2.18.487 CAD 272.000 31/0/12/22 USD 365.049 US 2.18.487 CAD 272.000 31/0/12/22 USD 911.907.39 ZAR 30.488.480 30/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 02/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 02/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 02/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.695.000 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.695.000 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.696.000 TRY 11.605.855 14/06/2022 PUUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO	130.535	0,08
USD 2.474.233 SEK 21.444.277 15/12/2021 USD 823.613 SGD 1.120.320 15/12/2021 USD 1.183.021 THB 39.689.622 15/12/2021 USD 5.205.282 TRY 47.279.265 15/12/2021 USD 5.017.565 ZAR 73.410.942 15/12/2021 USD 275.701 TRY 3.302.222 20/12/2021 USD 107.914 ILS 330.649 21/12/2021 USD 510.872 ILS 1.602.913 22/12/2021 USD 510.872 ILS 1.602.913 22/12/2021 USD 101.145 ILS 312.184 24/12/2021 USD 101.145 ILS 312.184 24/12/2021 USD 101.445 ILS 312.184 24/12/2021 USD 434.128 COP 1.646.917.285 21/01/2022 USD 365.049 ILS 1.125.139 26/01/2022 USD 365.049 ILS 1.125.139 26/01/2022 USD 318.487 CAD 272.000 31/01/2022 USD 911.909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 911.909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 391.353 CLP 734.572.524 07/02/2022 USD 391.353 CLP 734.572.524 07/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.855 14/06/2022	110.317	0,06
USD 823.613 SGD 1.120.320 15/12/2021 USD 1.183.021 THB 39.689.622 15/12/2021 USD 5.205.282 TRY 47.279.265 15/12/2021 USD 5.205.282 TRY 47.279.265 15/12/2021 USD 5.017.565 ZAR 73.410.942 15/12/2021 USD 275.701 TRY 3.302.222 20/12/2021 USD 107.914 ILS 30.649 21/12/2021 USD 510.872 ILS 30.649 21/12/2021 USD 510.872 ILS 30.649 21/12/2021 USD 510.872 ILS 3.694.912 USD 1.166.200 24/12/2021 USD 101.145 ILS 312.184 24/12/2021 USD 101.145 ILS 312.184 24/12/2021 USD 101.145 ILS 312.184 24/12/2021 USD 434.128 COP 1.646.917.285 21/01/2022 USD 434.128 COP 1.646.917.285 21/01/2022 USD 365.049 ILS 1.125.139 26/01/2022 USD 319.1909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 911.909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 911.909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 07/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 07/02/2022 USD 2.168.402 KRW 2.569.197.157 10/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.247.655 RUB 93.695.985 10/02/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.696.000 TRY 16.365.552 14/06/2022 PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATUS DE DIVISAS A PLAZO	64.037	0,04
USD 1.183.021 THB 39.689.622 15/12/2021 USD 5.205.282 TRY 47.279.265 15/12/2021 USD 5.017.565 ZAR 73.410.942 15/12/2021 USD 275.701 TRY 3.302.222 20/12/2021 USD 107.914 ILS 330.649 21/12/2021 USD 510.872 ILS 1.602.913 22/12/2021 USD 510.872 ILS 1.602.913 22/12/2021 USD 510.872 ILS 1.602.913 22/12/2021 USD 101.145 ILS 3.694.492 USD 1.166.200 24/12/2021 USD 101.145 ILS 312.184 24/12/2021 USD 17.224.779 USD 620.243 19/01/2022 USD 434.128 COP 1.646.917.285 21/01/2022 USD 365.049 ILS 1.125.139 26/01/2022 USD 365.049 ILS 1.125.139 26/01/2022 USD 911.909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 911.909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 911.909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 911.905 ZAR 30.458.480 03/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 07/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 07/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.696.000 TRY 16.365.552 14/06/2022 PPUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATUS DE DIVISAS A PLAZO	94.695	0,06
USD 5.205.282 TRY 47.279.265 15/12/2021 USD 5.017.565 ZAR 73.410.942 15/12/2021 USD 275.701 TRY 3.302.222 20/12/2021 USD 107.914 ILS 330.649 21/12/2021 USD 510.872 ILS 1.602.913 22/12/2021 USD 510.872 ILS 1.602.913 22/12/2021 USD 101.145 ILS 31.21.84 24/12/2021 USD 17.224.779 USD 620.243 19/01/2022 USD 434.128 COP 1.846.917.285 21/101/2022 USD 365.049 ILS 1.125.139 26/01/2022 USD 365.049 ILS 1.125.139 26/01/2022 USD 365.049 ILS 1.125.139 26/01/2022 USD 911.909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 911.909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 911.909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 3.957.399 ZAR 30.458.480 03/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 07/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 07/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.247.655 RUB 93.695.995 10/02/2022 USD 1.857.32 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.696.000 TRY 16.365.552 14/06/2022 PPLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO	2.164	0,00
USD	5.212	0,01
USD 275.701 TRY 3.302.222 20/12/2021 USD 107.914 ILS 330.649 21/12/2021 USD 510.872 ILS 1.602.913 22/12/2021 USD 510.872 ILS 1.602.913 22/12/2021 USD 1.166.200 24/12/2021 USD 1.166.200 24/12/2021 USD 1.166.200 24/12/2021 USD 1.166.200 24/12/2021 USD 101.145 ILS 312.184 24/12/2021 USD 17.224.779 USD 620.243 19/01/2022 USD 434.128 COP 1.646.917.285 21/01/2022 USD 365.049 ILS 1.125.139 26/01/2022 USD 365.049 ILS 1.125.139 26/01/2022 USD 218.487 CAD 272.000 31/01/2022 USD 911.999 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 911.999 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 9.19.57.399 ZAR 30.458.480 03/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 07/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 07/02/2022 USD 2.168.402 KRW 2.569.197.157 10/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.247.655 RUB 93.695.985 10/02/2022 USD 1.247.655 RUB 93.695.985 10/02/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.696.000 TRY 16.365.552 14/06/2022 PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO	1.618.650	1,01
USD	422.526	0,26
USD 510.872 ILS 1.602.913 22/12/2021 ILS 3.694.492 USD 1.166.200 24/12/2021 USD 101.145 ILS 312.184 24/12/2021 TWD 17.224.779 USD 620.243 19/01/2022 USD 434.128 COP 1.646.917.285 21/01/2022 USD 365.049 ILS 1.125.139 26/01/2022 USD 218.487 CAD 272.000 31/01/2022 USD 911.909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 911.909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 911.907 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 07/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 07/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.247.655 RUB 93.695.985 10/02/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.696.000 TRY 16.365.552 14/06/2022 PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO	25.773	0,02
ILS	2.708	0,00
USD	825	0,00
TWD 17.224.779 USD 620.243 19/01/2022 USD 620.243 19/01/2022 USD 434.128 COP 1.646.917.285 21/01/2022 USD 365.049 ILS 1.125.139 26/01/2022 USD 218.487 CAD 272.000 31/01/2022 USD 911.909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 911.909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 1.957.399 ZAR 30.458.480 03/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 07/02/2022 USD 2.168.402 KRW 2.569.197.157 10/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 4662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.247.655 RUB 93.695.985 10/02/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.696.000 TRY 16.365.552 14/06/2022 PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO	9.536	0,00
USD 434.128 COP 1.646.917.285 21/01/2022 USD 365.049 ILS 1.125.139 26/01/2022 USD 218.487 CAD 272.000 31/01/2022 USD 911.909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 915.399 ZAR 30.458.480 03/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 07/02/2022 USD 2.168.402 KRW 2.569.197.157 10/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.696.000 TRY 16.365.552 14/06/2022 PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO  Fecha de vencimiento USD 422.935 BRL 2.394.655 02/12/2021	1.795	0,00
USD 365.049 ILS 1.125.139 26/01/2022 USD 218.487 CAD 272.000 31/01/2022 USD 911.909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 1.957.399 ZAR 30.458.480 03/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 07/02/2022 USD 2.168.402 KRW 2.569.197.157 10/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.247.655 RUB 93.695.985 10/02/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.696.000 TRY 16.365.552 14/06/2022 PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO	4.341	0,00
USD 218.487 CAD 272.000 31/01/2022 USD 911.909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 1.957.399 ZAR 30.458.480 03/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 07/02/2022 USD 2.168.402 KRW 2.569.197.157 10/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.247.655 RUB 93.695.985 10/02/2022 USD 1.857.32 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.696.000 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.696.000 TRY 16.365.552 14/06/2022 PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO	25.116	0,02
USD 911,909 ILS 2.825.424 02/02/2022 USD 1.957.399 ZAR 30.458.480 03/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 07/02/2022 USD 2.168.402 KRW 2.569.197.157 10/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.247.655 RUB 93.695.985 10/02/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.696.000 TRY 16.365.552 14/06/2022 USD 1.696.000 B DIVISAS A PLAZO  PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO  Fecha de vencimiento USD 422.935 BRL 2.394.655 02/12/2021	6.584	0,00
USD 1.957.399 ZAR 30.458.480 03/02/2022 USD 891.353 CLP 734.572.524 07/02/2022 USD 2.168.402 KRW 2.569.197.157 10/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.247.655 RUB 93.695.985 10/02/2022 USD 1.247.655 RUB 93.695.985 10/02/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.696.000 TRY 16.365.552 14/06/2022 USD 1.696.000 TRY 16.365.552 14/06/2022 USD 1.096.000 TRY 16.365.552 14/06/2022	5.389	0,00
USD 891.353 CLP 734.572.524 07/02/2022 USD 2.168.402 KRW 2.569.197.157 10/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.247.655 RUB 93.695.985 10/02/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.696.000 TRY 16.365.552 14/06/2022 PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO  PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO  Fecha de vencimiento USD 422.935 BRL 2.394.655 02/12/2021	11.605	0,01
USD 2.168.402 KRW 2.569.197.157 10/02/2022 USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.247.655 RUB 93.695.985 10/02/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.696.000 TRY 16.365.552 14/06/2022 PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO  PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO  Fecha de vencimiento USD 422.935 BRL 2.394.655 02/12/2021	63.776	0,04
USD 464.249 PEN 1.873.243 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.247.655 RUB 93.695.985 10/02/2022 USD 1.185.732 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.696.000 TRY 16.365.552 14/06/2022 USD 16.965 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.552 16.365.5	18.544	0,01
USD 1.662.113 PLN 6.766.133 10/02/2022 USD 1.247.655 RUB 93.695.985 10/02/2022 USD 1.857.32 TRY 11.605.821 06/04/2022 USD 1.696.000 TRY 16.365.552 14/06/2022 USD 16.906.000 TRY	3.214	0,00
USD         1.247.655         RUB         93.695.985         10/02/2022           USD         1.185.732         TRY         11.605.821         06/04/2022           USD         1.696.000         TRY         16.365.552         14/06/2022           PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO           Divisa         Compra         Divisa         Venta         Fecha de vencimiento           USD         422.935         BRL         2.394.655         02/12/2021	4.919	0,00
USD         1.185.732         TRY         11.605.821         06/04/2022           USD         1.696.000         TRY         16.365.552         14/06/2022           PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO           Divisa         Compra         Divisa         Venta         Fecha de vencimiento           USD         422.935         BRL         2.394.655         02/12/2021	22.263	0,01
USD         1.696.000         TRY         16.365.552         14/06/2022           PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO           Divisa         Compra         Divisa         Venta         Fecha de vencimiento           USD         422.935         BRL         2.394.655         02/12/2021	2.596 355.887	0,01 0,22
PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO           Divisa         Compra         Divisa         Venta         Fecha de vencimiento           USD         422.935         BRL         2.394.655         02/12/2021	572.251	0,22
Divisa         Compra         Divisa         Venta         vencimiento           USD         422.935         BRL         2.394.655         02/12/2021	4.864.174	2,97
USD 422.935 BRL 2.394.655 02/12/2021	Minusvalía latente	% del
	USD	patrimonio
DIAL CONTRACTOR FUR	(4.652)	(0,00)
PLN 665.979 EUR 144.800 06/12/2021	(2.606)	(0,00)
INR 312.761.957 USD 4.223.162 07/12/2021 USD 2.279.055 ZAR 36.404.410 09/12/2021	(58.002) (1.607)	(0,03) (0,00)

	ivisas a plazo – (continu	,			Minusvalía	
Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	latente USD	% del patrimonio
ZAR	42.755.822	USD	2.681.738	09/12/2021	(3.172)	(0,01)
ZAR	13.169.566	USD	859.127	13/12/2021	(34.560)	(0,02)
TRY	15.009.600	USD	1.696.000	14/12/2021	(556.834)	(0,34)
AUD	1.135.622	NZD	1.190.722	15/12/2021	(722)	(0,00)
AUD	3.152.031	USD	2.332.275	15/12/2021	(74.496)	(0,04)
CAD	5.702.483	USD	4.557.169	15/12/2021	(90.990)	(0,06)
CZK	27.358.209	EUR	1.077.827	15/12/2021	(8.910)	(0,00)
CZK	62.217.785	USD	2.883.498	15/12/2021	(113.438)	(0,07)
EUR	1.074.594	AUD	1.732.823	15/12/2021	(17.939)	(0,01)
EUR	715.303	CHF	773.987	15/12/2021	(31.115)	(0,02)
EUR	722.916	CZK	18.558.256	15/12/2021	(3.314)	(0,00)
EUR	360.329	GBP	309.241	15/12/2021	(3.031)	(0,00)
EUR	1.821.885	HUF	667.295.824	15/12/2021	(847)	(0,01)
EUR	1.450.145	JPY	190.474.910	15/12/2021	(41.162)	(0,03)
EUR	37.925.847	USD	43.925.854	15/12/2021	(752.685)	(0,48)
GBP	2.153.809	USD	2.917.455	15/12/2021	(39.494)	(0,02)
HUF	509.523.371	EUR	1.424.755	15/12/2021	(37.634)	(0,02)
HUF	172.330.989	USD	580.501	15/12/2021	(44.677)	(0,03)
JPY	650.155.944	USD	5.859.222	15/12/2021	(84.032)	(0,05)
MXN	25.890.014	USD	1.249.666	15/12/2021	(38.647)	(0,03)
NOK	21.903.900	EUR	2.138.814	15/12/2021	(13.855)	(0,01)
NOK	3.772.754	USD	436.719	15/12/2021	(19.744)	(0,01)
NZD	2.452.121	USD	1.745.215	15/12/2021	(68.568)	(0,04)
PLN	6.541.855	EUR	1.422.438	15/12/2021	(27.160)	(0,01)
PLN	10.114.232	USD	2.647.154	15/12/2021	(185.665)	(0,11)
SEK	7.306.374	EUR	729.156	15/12/2021	(19.298)	(0,01)
SEK	14.676.299	USD	1.649.701	15/12/2021	(21.164)	(0,02)
SGD	1.116.782	USD	828.255	15/12/2021	(9.400)	(0,01)
THB	46.910.028	USD	1.400.473	15/12/2021	(8.395)	(0,00)
TRY	31.791.110	USD	3.271.976	15/12/2021	(860.285)	(0,53)
USD	5.039.360	CHF	4.630.529	15/12/2021	(18.325)	(0,01)
USD	6.639.690	CNH	42.931.416	15/12/2021	(94.939)	(0,06)
USD	567.285	ILS	1.817.326	15/12/2021	(10.733)	(0,01)
ZAR	61.700.403	USD	4.114.801	15/12/2021	(252.763)	(0,16)
ILS	2.793.060	USD	893.114	22/12/2021	(4.363)	(0,00)
INR	40.539.441	USD	539.430	27/12/2021	(384)	(0,00)
USD	5.058.265	TWD	140.048.466	19/01/2022	(20.003)	(0,02)
MXN	26.800.184	USD	1.295.279	24/01/2022	(51.210)	(0,03)
HUF	255.750.139	USD	816.595	26/01/2022	(22.947)	(0,01)
CZK	2.104.831	USD	96.470	31/01/2022	(2.908)	(0,00)
ZAR	6.840.874	USD	443.374	03/02/2022	(18.072)	(0,01)
CLP	673.316.403	USD	832.665	07/02/2022	(32.640)	(0,02)
IDR	10.604.440.318	USD	736.624	10/02/2022	(1.109)	(0,00)
RUB	75.180.967	USD	1.040.312	10/02/2022	(41.285)	(0,03)
USD	20.675.904	EUR	18.293.698	10/02/2022	(186.984)	(0,11)
TRY	9.021.370	USD	900.939	06/04/2022	(255.889)	(0,16)
TRY	8.889.584	USD	848.000	14/06/2022	(237.592)	(0,15)
	TENTE SOBRE CONTRATO				(4.530.246)	(2,80)
- Jimatos de div	a piazo especificos u	o ana orașe de r	(2,11,10)		Plusvalía	
Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	latente USD	% del patrimonio
EUR	115.54 <b>7</b>	USD	130.475	10/02/2022	1.300	0,00
			PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA	10,02,2322	1.300	0,00
	ENTE SOBRE CONTRATO					
	ENTE SOBRE CONTRATO				Plusvalía	
	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
PLUSVALÍA LATI			<b>Venta</b> 161.848.436		latente	

(4.538.310)

(2,77)

MINUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA

Tenencias	Descripción del valor			Plusvalía/ (minusvalía) latente USD	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	Opciones adquiridas					
1.448.000	EUR Put EUR / Call PLN	Vence 02/12/2021	Precio de ejercicio 4,56	(3.782)	2	0,00
1.448.000	Put EUR / Call PLN	Vence 02/12/2021	Precio de ejercicio 4,56	(4.373)	2	0,00
11.774.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,12	(20.559)	16.987	0,01
12.877.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,12	(39.642)	13.260	0,01
11.625.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	(6.828)	42.130	0,02
11.630.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,14	21.043	65.875	0,04
				(54.141)	138.256	0,08
3.321.000	USD Call USD / Put ILS	Vence 17/12/2021	Propio do piorginio 2 11	56.254	68.413	0,04
3.329.000	Call USD / Put ILS	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 3,11 Precio de ejercicio 3,13	34.322	47.438	0,04
3.331.000	Call USD / Put ILS	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 3,14	32.118	45.408	0,03
6.618.000	Call USD / Put INR	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 75,26	13.799	31.998	0,03
2.522.000	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 15,90	7.389	28.524	0,02
4.997.000	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 16,15	(11.628)	24.295	0,02
4.007.000	can cop / Lat 2 at	VOIIGO OTTILIZOZI	1 1000 00 0,10	132.254	246.076	0,15
TOTAL DE OPCIO	NES ADQUIRIDAS			102.204	240.070	0,10
coste USD 306.21	9)				384.332	0,23
	Opciones suscritas EUR					
(5.887.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	15.311	(21.335)	(0,02)
(5.887.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	34.391	(21.335)	(0,01)
(5.813.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,14	1.454	(32.926)	(0,02)
				51.156	(75.596)	(0,05)
	USD					
(1.661.000)	Call USD / Put ILS	Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 3,06	(41.148)	(54.821)	(0,03)
(1.664.000)	Call USD / Put ILS	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 3,08	(30.250)	(45.126)	(0,03)
(1.666.000)	Call USD / Put ILS	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 3,09	(29.075)	(44.619)	(0,02)
(3.309.000)	Call USD / Put INR	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 74,72	(12.051)	(29.166)	(0,02)
(830.000)	Call USD / Put TRY	Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 12,30	(59.325)	(68.655)	(0,04)
(2.498.000)	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 15,90	3.231	(28.252)	(0,02)
				(168.618)	(270.639)	(0,16)
TOTAL DE OPCIO (coste USD (228.7)					(346.235)	(0,21)
TOTAL DE OPCIO					38.097	0,02
Contratos de per	rmutas financieras – 0,69 %					
mporte					Plusvalía	% del
teórico ocal neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	latente en USD	patrimonio
	Permutas de tipos de interés					
25.160.000	Fijo 5,800 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2023	199.836	0,12
5.570.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,400 %	BRL	02/01/2023		0,00
36.460.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,300 %	BRL	02/01/2024		0,04
16.565.000	Fijo 6,320 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2025		0,18
21.630.000	Fijo 8,495 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	04/01/2027		0,19
27.200.000	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 11,230 %	BRL	04/01/2027		0,02
10.579.569.401	Fijo 4,300 %	Variable (CLOIS a 6 meses en CLP)	CLP	15/12/2023		0,12
169.930.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,500 %	CNY	15/09/2023		0,02
44.050.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,500 %	CNY	15/12/2026		0,04
17.607.670.000	Fijo 4,900 %	Variable (LIBOR a 3 meses en COP)	COP	15/12/2023		0,05
10.361.990.000	Fijo 6,400 %	Variable (LIBOR a 3 meses en COP)	COP	15/12/2031		0,02
903.728.556	Fijo 2,700 %	Variable (PRIBOR a 6 meses en CZK		15/12/2023		0,27
346.500.000	Variable (PRIBOR a 6 meses en CZK)	Fijo 3,600 %	CZK	15/12/2023		0,06
31.046.281	Fijo 2,200 %	Variable (PRIBOR a 6 meses en CZK		15/12/2031		0,02
1.810.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2024		0,01
3.822.452	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2026		0,02
1.590.000	Fijo 0,000 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EU	•	15/12/2028		0,01
		Fii. 0 000 0/	EUR	15/12/2031	7.374	0,00
380.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %				
800.000	Fijo 0,250 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EU	JR) EUR	15/12/2036	6.145	0,00
		•			6.145 1 108.041	

#### Contratos de permutas financieras – (continuación)

Importe					Plusvalía latente en	% del
teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	ustente en USD	patrimonio
	Permutas de tipos de interés –					
05 047 700 000	(continuación)	V	KDW	40/00/0004	07.040	0.04
25.247.760.000	Fijo 1,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en KRW)	KRW	16/03/2024	67.316	0,04
179.840.000	Fijo 6,200 %	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	13/12/2023	135.376	0,08
112.210.000	Fijo 6,700 %	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	09/12/2026	136.443	0,08
58.980.000	Fijo 7,150 %	Variable (MIDOR a 6 masses an RIA)	MXN	03/12/2031	75.487	0,05
1.650.000	Fijo 1,700 %  ENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2026	21.983 <b>2.557.808</b>	0,01
PLUSVALIA LATE		INTERES			2.557.606	1,56
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)					
1.580.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Abu Dabi)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	9.684	0,01
180.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Indonesia)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	2.973	0,00
ΡΙ ΙΙΝΟΔΙ ΙΔΙ ΔΤΕ	ENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPL	•		20/12/2020	12.657	0,00
	VALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS I	· ' '				
TOTAL DE PLUS	VALIA LATENTE SOBRE CONTRATOS I	DE PERMUTAS FINANCIERAS			2.570.465	1,57
Importe teórico local			<b>5</b>		Minusvalía latente	% del patrimonio
neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	USD	
	Permutas de tipos de interés					
3.910.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 10,565 %	BRL	02/01/2023	(5.724)	(0,00)
54.710.000	Variable (LIBOR a 1 mes en BRL)	Fijo 7,200 %	BRL	02/01/2023	(370.499)	(0,23)
2.650.000	Fijo 11,814 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(1.986)	(0,00)
2.725.000	Fijo 11,905 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(2.296)	(0,00)
3.625.000	Fijo 12,185 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(6.018)	(0,00)
2.305.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 4,930 %	BRL	02/01/2024	(36.617)	(0,02)
25.625.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 7,370 %	BRL	02/01/2024	(271.242)	(0,17)
48.140.000	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 9,200 %	BRL	02/01/2024	(106.898)	(0,07)
1.824.605.000	Variable (LIBOR a 6 meses en CLP)	Fijo 5,100 %	CLP	15/12/2031	(27.830)	(0,02)
58.510.000	Fijo 2,600 %	Variable (PRIBOR a 6 meses en CZK)	CZK	15/12/2031	(25.292)	(0,02)
1.464.955	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2023	(1.734)	(0,00)
410.000	Fijo 0,500 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2041	(963)	(0,00)
180.000	Fijo 0,250 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2051	(5.466)	(0,00)
32.735.955	Variable (HIBOR a 3 meses en HKD)	Fijo 1,500 %	HKD	15/09/2031	(15.325)	(0,01)
5.194.422.818	Fijo 4,600 %	Variable (BUBOR a 6 meses en HUF)	HUF	16/03/2024	(4.585)	(0,00)
780.429.283	Fijo 4,300 %	Variable (BUBOR a 6 meses en HUF)	HUF	16/03/2032	(28.710)	(0,02)
2.779.098	Fijo 0,400 %	Variable (TELBOR a 3 meses en ILS)	ILS	15/12/2023	(5.069)	(0,00)
716.830.000	Fijo 4,750 %	Variable (LIBOR a 6 meses en INR)	INR	16/03/2024	(61.571)	(0,04)
6.912.310.000	Fijo 1,750 %	Variable (KWCDC a 3 meses en KRW)	KRW	15/09/2031	(58.843)	(0,04)
87.320.000	Fijo 0,250 %	Variable (WIBOR a 3 meses en PLN)	PLN	16/12/2021	(40.090)	(0,02)
10.668.881	Fijo 1,750 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2023	(8.120)	(0,00)
12.822.828	Fijo 2,000 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2031	(1.776)	(0,00)
215.415.000	Variable (LIBOR a 6 meses en THB)	Fijo 1,000 %	THB	15/09/2026	(6.662)	(0,00)
90.780.000	Variable (LIBOR a 6 meses en THB)	Fijo 1,000 %	THB	16/03/2027	(9.193)	(0,01)
2.830.000	Fijo 1,750 %	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD	15/12/2031	(24.239)	(0,01)
169.100.805	Fijo 5,500 %	Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	ZAR	15/12/2023	(30.289)	(0,02)
13.708.973	Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	Fijo 7,400 %	ZAR	15/12/2031	(9.196)	(0,01)
MINUSVALÍA LAT	TENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS D	E INTERÉS			(1.166.233)	(0,71)
	Permutas de incumplimiento creditici (CDS)	0				
420.000	Fijo 0,000 %	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2021	(57)	(0,00)
100.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Colombia)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2024	(1.498)	(0,00)
1.440.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Colombia)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	(31.902)	(0,02)
2.830.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Indonesia)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(18.969)	(0,01)
4.830.000	Variable (iTraxx Asia ex-Japan IG Serie 36 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(2.945)	(0,00)
2.510.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de México)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(28.032)	(0,02)

#### Contratos de permutas financieras - (continuación)

Importe teórico local					Minusvalía latente	% del patrimonio
neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	USD	
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS) – (continuación)					
770.000	Variable (Bonos extranjeros rusos - Eurobono)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(11.151)	(0,01)
10.420.000	Variable (The Markit CDX Emerging Markets 36 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(188.681)	(0,11)
MINUSVALÍA LAT	TENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPL	IMIENTO CREDITICIO (CDS)			(283.235)	(0,17)
TOTAL DE MINUS	SVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS (	DE PERMUTAS FINANCIERAS			(1.449.468)	(0,88)
	CADO DE LAS INVERSIONES				440.040.470	24.0=
(coste USD 155.5	25.118)				149.312.178	91,05
OTROS ACTIVOS	S Y PASIVOS				14.610.379	8,95
PATRIMONIO					163.922.557	100,00
TOTAL DE INVER	RSIONES			Valor	de mercado en USD	% del patrimonio
Total inversiones e	excluyendo derivados (coste USD 155.447.	672)			152.613.490	93,10
Plusvalía latente s	obre contratos de futuros				264.523	0,16
Minusvalía latente	sobre contratos de futuros				(521.847)	(0,32)
Plusvalía latente s	obre contratos de divisas a plazo				4.864.174	2,97
Minusvalía latente	sobre contratos de divisas a plazo				(4.530.246)	(2,80)
Plusvalía latente s	obre contratos de divisas a plazo celebrado	os con fines de cobertura			1.300	0,00
Minusvalía latente	sobre contratos de divisas a plazo celebra	dos con fines de cobertura			(4.538.310)	(2,77)
Valor de mercado	de opciones compradas (coste USD 306.2	19)			384.332	0,23
Valor de mercado	de opciones suscritas (coste USD (228.773	3))			(346.235)	(0,21)
	obre contratos de permutas financieras				2.570.465	1,57
Minusvalía latente	sobre contratos de permutas financieras				(1.449.468)	(0,88)

El Comisionista de futuros fue Bank of America N.A.

Otros activos y pasivos

Patrimonio

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Australia & New Zealand Banking Group Ltd., Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Credit Suisse International, Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Standard Chartered Bank, State Street Bank & Trust y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Barclays Bank Plc., HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc. y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Morgan Stanley y Morgan Stanley & Co. LLC.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 1,82 %.

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) Este título tiene un cupón escalonado que pasará al segundo tipo en una fecha determinada del futuro.
- (d) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (e) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (f) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- $^{(g)}~$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

14.610.379

163.922.557

8,95

100,00

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de patrimonio
Valores mobil Bonos – 20,18	liarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial 3 %					
Austria						
	ams AG 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,000 %	31/07/2025	227.362	0,07
Bermudas	Arch Conital Crays Ltd	HCD	7.250.0/	04/05/0004	100 710	0.00
	Arch Capital Group Ltd.	USD	7,350 %	01/05/2034	109.718	0,03
200 000	Bonos internacionales del Estado de Brasil	USD	3,875 %	12/06/2030	188.094	0,05
Canadá	Donos internacionales del Estado de Brasil	000	3,073 70	12/00/2030	100.034	0,00
	Canadian Pacific Railway Co.	USD	2.450 %	02/12/2031	75.904	0,02
	Cenovus Energy, Inc.	USD	5,375 %	15/07/2025	138.969	0,04
100.000	Enbridge, Inc.	USD	2,500 %	01/08/2033	98.737	0,03
100.000	Teck Resources Ltd.	USD	3,900 %	15/07/2030	107.637	0,03
Islas Caimán					421.247	0,12
	XLIT Ltd.	USD	4,450 %	31/03/2025	82.303	0,02
Colombia						
430.000	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	3,125 %	15/04/2031	386.781	0,11
Francia	Altica France C A 444A(C)	1100	E 40E 61	45/07/0000	200.007	0.00
	Altice France S.A. 144A <sup>(c)</sup> Crédit Agricole S.A.	USD	5,125 % 4,375 %	15/07/2029 17/03/2025	292.037 216.330	0,09
	Crédit Agricole S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	6,875 %	Perp.	217.840	0,00
200.000	G. G		0,010 70	. о.р.	726.207	0,22
Guernsey						
125.000	Amdocs Ltd.	USD	2,538 %	15/06/2030	125.143	0,04
Indonesia						
	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III	USD	4,400 % 2,550 %	01/03/2028 09/06/2031	553.700 201.125	0,16 0,06
200.000	r etusanaan r etietiit 303N iliuoliesia ili	030	2,330 /0	09/00/2031	754.825	0,00
Irlanda						0,22
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	4,875 %	16/01/2024	160.630	0,05
400.000	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	3,000 %	29/10/2028	403.604	0,12
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	3,300 %	30/01/2032	151.274	0,05
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	3,400 %	29/10/2033	150.444	0,05
	GE Capital International Funding Co. Unlimited Co. GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.	USD	3,373 % 4,418 %	15/11/2025 15/11/2035	216.590 243.186	0,06
	Perrigo Finance Unlimited Co.	USD	4,375 %	15/03/2026	211.864	0,06
	STERIS Irish FinCo Unlimited Co.	USD	2,700 %	15/03/2031	25.401	0,01
			·		1.562.993	0,47
Japón						
200.000	Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	USD	2,050 %	31/03/2030	195.116	0,06
Luxemburgo						
150.000	DH Europe Finance II SARL	USD	2,600 %	15/11/2029	155.820	0,05
México						
	Mexico City Airport Trust	USD	4,250 %	31/10/2026	210.754	0,06
	Bonos internacionales del Estado de México Bonos internacionales del Estado de México	USD	3,750 % 3,250 %	11/01/2028 16/04/2030	247.271 264.788	0,07 0,08
	Bonos internacionales del Estado de México	USD	2,659 %	24/05/2031	192.906	0,06
200.000	20.100 monator and 20.20.000		2,000 %	2 1/00/2001	915.719	0,27
Países Bajos					0.010	5,2,
-	Lukoil Securities BV	USD	3,875 %	06/05/2030	205.150	0,06
50.000	LYB International Finance BV	USD	4,875 %	15/03/2044	62.447	0,02
					267.597	0,08
Nigeria 200,000	Ronos internacionales del Estado de Nigeria	USD	£ 12E 0/	28/09/2028	188.373	0.00
Perú	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	חפט	6,125 %	20/09/2028	100.3/3	0,06
	Bonos internacionales del Estado de Perú	USD	2,780 %	01/12/2060	8.452	0,00
30.000	Bonos internacionales del Estado de Perú	USD	3,230 %	28/07/2121	24.719	0,01

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos – (cont	tinuación)					
Rumanía						
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	USD	5,125 %	15/06/2048	22.875	0,01
20.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	USD	4,000 %	14/02/2051	19.513	0,00
					42.388	0,01
España						
•	Banco Santander S.A.	USD	2,746 %	28/05/2025	207.640	0,06
200.000	Banco Santander S.A.	USD	2,749 %	03/12/2030	195.874	0,06
					403.514	0,12
Ci==						
Suiza 250 000	Credit Suisse AG	USD	1,250 %	07/08/2026	244.587	0,07
	Credit Suisse AG 144A(c)	USD	6,500 %	08/08/2023	217.022	0,07
290.000	Credit Suisse Group AG 144A(c)(d)	USD	5,250 %	Perp.	297.250	0,09
		-	<u> </u>	· ·	758.859	0,23
		-			730.039	0,20
Turquía	THE WHAT BUT ITAG		5.050.0/	05/00/0005	101.010	
200.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO	USD	5,250 %	05/02/2025	191.313	0,06
Ucrania						
100.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	7,750 %	01/09/2024	100.214	0,03
Reino Unido						
	Barclays Plc.(d)	USD	4,610 %	15/02/2023	201.610	0,06
	HSBC Holdings Plc. <sup>(d)</sup>	USD	3,803 %	11/03/2025	211.100	0,07
	HSBC Holdings Plc.(d)	USD	1,645 %	18/04/2026	199.524	0,06
	Natwest Group Plc. (d)	USD	4,519 %	25/06/2024	210.758	0,06
200.000	NatWest Group Plc.	USD	3,875 %	12/09/2023	209.724	0,06
					1.032.716	0,31
Estados Unido						
	AbbVie, Inc.	USD	3,200 %	21/11/2029	398.764	0,12
	AbbVie, Inc.	USD	4,050 %	21/11/2039	344.493	0,10
	Air Lease Corp. Air Lease Corp.	USD	3,375 % 3,750 %	01/07/2025 01/06/2026	131.377 292.971	0,04 0,09
	Air Lease Corp. – Serie C <sup>(d)</sup>	USD	4,125 %	Perp.	123.125	0,04
	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp.	USD	6,625 %	15/07/2026	151.777	0,05
50.000	Ally Financial, Inc.	USD	1,450 %	02/10/2023	50.348	0,01
125.000	Ally Financial, Inc.	USD	2,200 %	02/11/2028	124.275	0,04
	Altria Group, Inc.	USD	4,400 %	14/02/2026	57.378	0,02
	Amazon.com, Inc.	USD	4,950 %	05/12/2044	102.686	0,03
	American Electric Power Co., Inc. American Homes 4 Rent LP	USD	2,300 % 2,375 %	01/03/2030 15/07/2031	98.956 24.727	0,03 0,01
	American International Group, Inc.	USD	3,900 %	01/04/2026	163.920	0,01
	American International Group, Inc.	USD	3,400 %	30/06/2030	108.485	0,03
	American International Group, Inc.	USD	4,500 %	16/07/2044	61.717	0,02
25.000	American International Group, Inc.	USD	4,800 %	10/07/2045	32.397	0,01
	American Tower Corp.	USD	5,000 %	15/02/2024	135.370	0,04
	American Tower Corp.	USD	2,100 %	15/06/2030	120.332	0,04
	Amgen, Inc.  Anheuser-Busch Cos. LLC Via Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	USD	4,400 % 4,700 %	01/05/2045 01/02/2036	90.158 241.452	0,03 0,07
	Anheuser-Busch Cos., LLC Via Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	USD	4,900 %	01/02/2036	221.965	0,07
	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	USD	4,750 %	23/01/2029	437.632	0,13
	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	USD	5,450 %	23/01/2039	196.371	0,06
75.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	USD	4,950 %	15/01/2042	94.126	0,03
175.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	USD	5,550 %	23/01/2049	242.070	0,07
	Apple, Inc.	USD	3,850 %	04/05/2043	148.392	0,04
	AT&T, Inc.	USD	2,300 %	01/06/2027	688.351	0,21
	AT&T, Inc.	USD	2,750 %	01/06/2031	457.942	0,14
	AT&T, Inc. AT&T, Inc.	USD	6,150 % 4,900 %	15/09/2034 15/08/2037	99.010 182.247	0,03 0,05
	AT&T, Inc.	USD	4,850 %	01/03/2039	210.577	0,06
	AT&T, Inc.	USD	3,500 %	01/06/2041	77.403	0,02
	AT&T, Inc.	USD	5,150 %	15/11/2046	128.364	0,04
	AT&T, Inc.	USD	5,150 %	15/02/2050	32.160	0,01
	AT&T, Inc.	USD	3,650 %	01/06/2051	52.104	0,02
	AT&T, Inc. – Serie WI	USD	3,500 %	15/09/2053	25.331	0,01
	AutoNation, Inc.	USD	4,750 %	01/06/2030	87.121	0,03
200.000	AutoNation, Inc.	USD	2,400 %	01/08/2031	97.018	0,03
	Rank of America Corn	HOD	4 200 0/	25/00/2024	400 400	0.40
400.000	Bank of America Corp. Bank of America Corp.	USD	4,200 % 4,450 %	26/08/2024 03/03/2026	429.480 82.726	0,13 0,02

Tananaina	Deservinción del valer	Divise	Tina da interéa(a)	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado	% del
Tenencias Bonos – (con	Descripción del valor	DIVISA	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	recna de vencimiento	en USD	patrimonio
•	s – (continuación)					
	Bank of America Corp.(d)	USD	3,419 %	20/12/2028	454.627	0,14
	Bank of America Corp.(d)	USD	3,970 %	05/03/2029	192.552	0,06
	Bank of America Corp.(d)	USD	4,271 %	23/07/2029	336.222	0,10
	Bank of America Corp. (d)	USD	2,482 %	21/09/2036	218.212	0,07
	Bank of America Corp. – Serie L	USD	3,950 %	21/04/2025	134.405	0,04
150.000	BAT Capital Corp.	USD	2,259 %	25/03/2028	146.982	0,04
25.000	BAT Capital Corp.	USD	4,390 %	15/08/2037	26.587	0,01
300.000	Becton Dickinson and Co.	USD	3,700 %	06/06/2027	326.181	0,10
	Becton Dickinson and Co.	USD	4,669 %	06/06/2047	31.690	0,01
75.000	Becton Dickinson and Co.	USD	3,794 %	20/05/2050	85.475	0,03
	Berkshire Hathaway Energy Co.	USD	6,125 %	01/04/2036	240.161	0,07
	Berry Global, Inc.	USD	1,570 %	15/01/2026	49.063	0,01
	Berry Global, Inc. – Serie WI	USD	1,650 %	15/01/2027	121.726	0,04
	Boeing Co.	USD	1,875 %	15/06/2023	75.860	0,02
	Boeing Co.	USD	3,250 %	01/02/2035	50.210	0,01
	Boeing Co.	USD	3,550 %	01/03/2038	305.670	0,09
	Boeing Co.	USD	3,375 % 3,850 %	15/06/2046 01/11/2048	48.915 104.511	0,01 0,03
	Boeing Co. Boeing Co.	USD				0,05
	Boyd Gaming Corp.	USD	5,805 % 4,750 %	01/05/2050 01/12/2027	169.465 233.162	0,05
	BP Capital Markets America, Inc.	USD	3,119 %	04/05/2026	79.601	0,07
	Burlington Northern Santa Fe LLC	USD	5,750 %	01/05/2040	104.819	0,02
	Carrier Global Corp.	USD	2,493 %	15/02/2027	256.695	0,08
	Carrier Global Corp. – Serie WI	USD	2,722 %	15/02/2030	153.802	0,05
	Centene Corp.	USD	2,500 %	01/03/2031	187.935	0,06
	Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications		_,			-,
	Operating Capital	USD	4,908 %	23/07/2025	276.572	0,08
250.000	Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications					
	Operating Capital	USD	3,750 %	15/02/2028	269.475	0,08
125.000	Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications					
	Operating Capital	USD	6,484 %	23/10/2045	171.642	0,05
	Cigna Corp.	USD	4,125 %	15/11/2025	355.790	0,11
	Cigna Corp.	USD	2,400 %	15/03/2030	125.606	0,04
	CIT Group, Inc.	USD	4,750 %	16/02/2024	105.750	0,03
	Citigroup, Inc.	USD	3,875 %	26/03/2025	455.863	0,14
	Citigroup, Inc. (d)	USD	2,976 %	05/11/2030	78.089	0,02
	Citigroup, Inc. <sup>(d)</sup> Citigroup, Inc.	USD USD	4,412 %	31/03/2031	114.331 125.923	0,03 0,04
	Citrix Systems, Inc.	USD	4,750 % 3,300 %	18/05/2046 01/03/2030	101.535	0,04
	Comcast Corp.	USD	4,700 %	15/10/2048	64.949	0,03
	Constellation Brands, Inc.	USD	4,400 %	15/11/2025	110.458	0,02
	Constellation Brands, Inc.	USD	3,700 %	06/12/2026	136.151	0,04
	Crown Castle International Corp.	USD	2,900 %	01/04/2041	96.935	0,03
	CSX Corp.	USD	4,750 %	15/11/2048	66.110	0,02
	CubeSmart LP	USD	2,500 %	15/02/2032	124.777	0,04
	CVS Health Corp.	USD	3,875 %	20/07/2025	216.078	0,06
	CVS Health Corp.	USD	5,125 %	20/07/2045	163.966	0,05
50.000	CVS Health Corp.	USD	4,250 %	01/04/2050	60.679	0,02
225.000	DaVita, Inc.	USD	3,750 %	15/02/2031	209.812	0,06
240.000	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	5,450 %	15/06/2023	255.125	0,08
150.000	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	6,020 %	15/06/2026	175.660	0,05
25.000	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	4,900 %	01/10/2026	28.341	0,01
25.000	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	5,300 %	01/10/2029	29.798	0,01
150.000	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	6,200 %	15/07/2030	190.881	0,06
	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	8,100 %	15/07/2036	114.878	0,03
	Devon Energy Corp.	USD	5,850 %	15/12/2025	115.097	0,03
	Diamondback Energy, Inc.	USD	4,750 %	31/05/2025	137.380	0,04
	Diamondback Energy, Inc.	USD	3,500 %	01/12/2029	105.320	0,03
	DISH DBS Corp.	USD	7,375 %	01/07/2028	274.225	0,08
	Dollar Tree, Inc.	USD	4,000 %	15/05/2025	107.943	0,03
	Dominion Energy, Inc.	USD	3,900 %	01/10/2025	108.522	0,03
	Duke Realty LP	USD	1,750 %	01/07/2030	24.015	0,01
	DuPont de Nemours, Inc. DuPont de Nemours, Inc.	USD USD	4,493 %	15/11/2025	110.821	0,03 0,03
	Energy Transfer LP	USD	4,725 % 2,900 %	15/11/2028 15/05/2025	87.548 129.404	0,03
	Energy Transfer LP	USD	4,200 %	15/04/2027	216.728	0,04
	Energy Transfer LP	USD	5,500 %	01/06/2027	28.695	0,00
	Energy Transfer LP	USD	5,150 %	15/03/2045	85.977	0,01
	Enterprise Products Operating LLC	USD	4,800 %	01/02/2049	30.500	0,03
	EQT Corp.	USD	6,625 %	01/02/2025	178.000	0,05
	Essex Portfolio LP	USD	3,000 %	15/01/2030	52.625	0,02
			- * · <del>-</del>		· ·	

Standard   Continuacion   Carter   Ca	Tenencias	Descripción del valor	Divise	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del
		. <u> </u>	Divisa	Tipo de interes	recha de vencimiento.	en osb	patrimonio
200000   Feperial Group, Inc.   USD   3,000 %   15/12/2020   209 248   0.00	•	•					
7-5.00   Expedits Group, Inc.   USD   2.950 %   1500/2021   20.1512   0.44   6.700.00   Federal Hamel Loam Mortgage Association (FMAN)** USD   0.300 %   0.7761/2022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7016/7022   0.7		·	USD	3,600 %	15/12/2023	209.248	0,06
2 800.000 Federal Home Lann Mortgage Corp. (FHAMC) <sup>61</sup> 6700.000 Federal Maronia Mortgage Association (FMMA) <sup>67</sup> 680.001 Federal Corp. 680.001 Federal Corp. 680.001 Federal Corp. 680.001 Federal Maronia Mortgage Association (FMMA) <sup>67</sup> 680.002 Federal Maronia Mortgage Association (FMMA) <sup>67</sup> 680.007 Federal Mortgage Corp. 680.007 Federal Mortgage Corp. 680.007 Federal Mortgage Corp. 680.007 Federal Works Financia Corp. 6	125.000	Expedia Group, Inc.	USD	3,250 %	15/02/2030	128.750	0,04
6.700.00 Federal National Mortgage Association (FNNA) <sup>(1)</sup> 5.000 First Horzon Corp. 5.000 First Horzon First Horzon First Horzon Corp. 5.000 First Horzon F	75.000	Expedia Group, Inc.	USD	2,950 %	15/03/2031	75.725	0,02
50.000   Fedits Corp.   USD   5.250 %   150552650   67.822   0.02   123.000   Freillinery Corp.   USD   4.000 %   20.6502005   134.259   0.04   123.000   Freillinery Corp.   USD   2.850 %   0.1032030   123.110   0.04   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05							
125.00   First Horizon Corp.   USD							
125.000   Firefitnergy Corp.   USD   2,850 %   0103/2030   123.110   0.04   5.000   Fernida Prower & Light Co.   USD   3,950 %   0103/2048   61.06 %   0.02   5.000   Fornida Prower & Light Co.   USD   3,950 %   0103/2048   61.06 %   0.02   7.500   Cernida Prower & Light Co.   USD   3,950 %   0103/2048   61.06 %   0.02   7.500   Cernida Prower & Light Co.   USD   5,777 %   44.01/2038   103.00   7.500   Cernida Prower & Light Co.   USD   5,777 %   44.01/2038   103.00   7.500   Cernida Prower & Light Co.   USD   5,777 %   44.01/2038   103.00   7.500   Cernida Motors Co.   USD   5,800 %   0104/2038   163.01   7.500   Cernida Motors Co.   USD   5,800 %   0104/2038   163.01   7.500   Cernida Motors Co.   USD   5,800 %   0104/2038   163.01   7.500   Cernida Motors Co.   USD   5,800 %   0104/2038   163.01   7.500   Cernida Motors Co.   USD   5,800 %   0104/2038   162.00   7.500   Cernida Motors Financial Co., Inc.   USD   1,500 %   1006/2038   123.00   7.500   Cernida Motors Financial Co., Inc.   USD   1,500 %   1006/2038   123.00   7.500   Cernida Motors Financial Co., Inc.   USD   7,750 %   0106/2038   123.00   7.500   Cernida Motors Financial Co., Inc.   USD   7,750 %   0106/2038   123.00   7.500   Cernida Motors Financial Co., Inc.   USD   7,750 %   0106/2038   123.00   7.500   Cernida Motors Financial Co., Inc.   USD   7,750 %   0106/2038   123.00   7.500   Cernida Motors Financial Co., Inc.   USD   7,750 %   0106/2038   123.00   7.500   Cernida Motors Financial Co., Inc.   USD   7,750 %   0106/2038   123.00   7.500   Cernida Motors Financial Co., Inc.   USD   7,750 %   0106/2038   123.00   7.500   Cernida Motors Financial Co., Inc.   USD   7,750 %   0106/2038   123.00   7.500   Cernida Motors Financial Co., Inc.   USD   7,750 %   0106/2038   123.00   7.500   Cernida Motors Financial Co., Inc.   USD   8,875 %   0106/2038   123.00   7.500   Cernida Motors Financial Co., Inc.   USD   8,875 %   1501/2038   123.00   7.500   Cernida Motors Financial Co., Inc.   USD   8,750 %   1501/2039   123.00   7.500   Cernida Mot		·					
50.00   Fierv. Inc.		·					
50.000   Florida Power & Light Co.   USD   3,950 %   0103/2048   61.008   0.02   326.000   Form Motor Co.   USD   3,250 %   120/20/2025   357.899   0.11   325.000   Form Motor Co.   USD   5,125 %   16006/2025   352.281   0.11   325.000   Form Motor Co.   USD   6,700 %   0104/20/201   105.003   325.000   Form Motor Co.   USD   6,700 %   0104/20/201   105.003   325.000   General Motors Co.   USD   6,700 %   0104/20/201   105.003   325.000   General Motors Co.   USD   5,200 %   0104/20/201   105.003   325.000   General Motors Financial Co., Inc.   USD   1,500 %   1006/20/201   37.75 %   325.000   General Motors Financial Co., Inc.   USD   1,500 %   1006/20/201   37.75 %   326.000   General Motors Financial Co., Inc.   USD   2,350 %   0601/20/201   37.75 %   326.000   General Motors Financial Co., Inc.   USD   2,350 %   0601/20/201   37.75 %   326.000   General Motors Financial Co., Inc.   USD   2,350 %   0601/20/201   37.75 %   326.000   General Motors Financial Co., Inc.   USD   2,350 %   0601/20/201   37.75 %   326.000   General Motors Financial Co., Inc.   USD   2,350 %   0601/20/201   37.75 %   326.000   General Motors Financial Co., Inc.   USD   2,350 %   0601/20/201   37.75 %   326.000   General Motors Financial Co., Inc.   USD   2,350 %   0601/20/201   37.75 %   326.000   General Motors Financial Co., Inc.   USD   2,350 %   0601/20/201   37.75 %   326.000   General Motors Financial Co., Inc.   USD   2,350 %   0601/20/201   37.75 %   326.000   General Motors Financial Co., Inc.   USD   2,350 %   0601/20/201   37.75 %   326.000   General Motors Financial Co., Inc.   USD   2,350 %   0601/20/201   37.75 %   326.000   General Motors Financial Co., Inc.   USD   2,500 %   1500/20/205   30.000   326.000   General Motors Financial Co., Inc.   USD   2,500 %   1500/20/205   30.000   326.000   General Motors Financial Co., Inc.   USD   2,500 %   1500/20/205   30.000   326.000   Healthcare Really Trust, Inc.   USD   2,500 %   1500/20/205   326.000   Healthcare Really Trust, Inc.   USD   2,500 %   1500/20/205   326.000							
380,000 Fork Motor Co.   USD   3,260 %   1,2022032   357,698   0,11		·					
325.000   Fork Motor Cerell Co., LLC		•					
75.000 General Richards Co. 1950 5.400 W 1010/2023 215.75 W 1.05.083 0.03   200.000 General Motors Co. 1950 0.000 General Motors Francial Co., Inc. 1950 0.000 General Entropy LP Via General Entropy France Corp. 1950 0.000 General Entropy LP Via General Entropy France Corp. 1950 0.000 General Entropy LP Via General Entropy France Corp. 1950 0.000 General Entropy LP Via General Entropy France Corp. 1950 0.000 General Entropy LP Via General Entropy France Corp. 1950 0.000 General Entropy LP Via General Entropy France Corp. 1950 0.000 General Entropy LP Via General Entropy France Corp. 1950 0.000 General Entropy LP Via General Entropy France Corp. 1950 0.000 General Entropy LP Via General Entropy France Corp. 1950 0.000 General Entropy LP Via General Entropy France Corp. 1950 0.000 General Entropy LP Via General Entropy France Corp. 1950 0.000 General Entropy LP Via General Entropy France Corp. 1950 0.000 General Entropy LP Via General Entropy France Corp. 1950 0.000 General Entropy LP Via General Entropy France Corp. 1950 0.000 General Entropy LP Via General Entropy France Corp. 1950 0.000 General Entropy LP Via General Entropy France Corp. 1950 0.000 General Entropy France Corp. 1950 0.000 General Entropy France Corp. 2950 0.0000 General Entropy France Corp. 2950 0.0000 General Entropy France Corp. 2950 0.0000 General Entropy France Corp. 2950 0.00000 General Entropy France Corp. 2950 0.00000 General Entropy France							
20000 General Motors Co.   USD   5,400 %   02/10/2038   169.314   0.05   125.000 General Motors Co.   USD   5,200 %   01/04/2045   62.078   0.02   125.000 General Motors Financial Co., Inc.   USD   1,200 %   1,200 %   1,200 %   125.000 General Motors Financial Co., Inc.   USD   1,200 %   1,200 %   1,200 %   125.000 General Motors Financial Co., Inc.   USD   1,200 %   1,200 %   1,200 %   125.000 General Motors Financial Co., Inc.   USD   1,200 %   1,200 %   1,200 %   125.000 General Motors Financial Co., Inc.   USD   2,200 %   1,200 %   1,200 %   125.000 General Motors Financial Co., Inc.   USD   2,200 %   1,200 %   1,200 %   125.000 Healthcare LP Via GLP Finance Corp.   USD   0,875 %   1,501 / 2,200 %   1,200 %   1,200 %   125.000 Healthcare Realty Trust, Inc.   USD   2,250 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200 %   1,501 / 2,200							
125.000   Ceneral Motors Co.   USD   5.000 %   0104/2045   82.078   0.02							
50,000   General Motors Chamarial Co., Inc.							
300.000 General Mitoria Financial Co., Inc.							
75.000 General Motors Financial Co., Inc.   USD   2,350 %   0801/2031   12,755   0.02	125.000	General Motors Financial Co., Inc.	USD	1,500 %	10/06/2026	123.030	0,04
68.000 Genesis Energy LP Via Genesis Energy Finance Corp.			USD	5,650 %	17/01/2029	357.525	0,11
173,000   Global Parmerts LP Via GLIP Finance Corp.	75.000	General Motors Financial Co., Inc.	USD	2,350 %	08/01/2031	72.755	0,02
150,000   Global Payments, Inc.	66.000	Genesis Energy LP Via Genesis Energy Finance Corp.	USD	7,750 %	01/02/2028	64.928	0,02
SE 5000   HB Fuller Co.   USD   4.250 %   15/10/2028   56.306   0.02	173.000	Global Partners LP Via GLP Finance Corp.	USD	6,875 %	15/01/2029	177.325	0,05
25.000   Healthcare Realty Trust, Inc.	100.000	Global Payments, Inc.	USD	2,650 %	15/02/2025	103.206	0,03
550.000   Newlet Packard Enterprise Co.   USD   4,900 %   15/10/2025   612.793   0.18   21.000   Hillenbrand, Inc.   USD   5,750 %   15/00/2025   219.975   0.07   25.000   home Depot, Inc.   USD   4,800 %   15/10/2031   73.474   0.02   25.000   Huntsman International LLC   USD   4,800 %   15/12/2031   73.474   0.02   25.000   Huntsman International LLC   USD   2,900 %   15/12/2031   73.474   0.02   25.000   Huntsman International LLC   USD   2,950 %   15/06/2031   50.813   0.02   25.000   Huntsman International LLC   USD   2,950 %   15/06/2031   50.813   0.02   27.000   Cahn Enterprises IP Vial Ioan Enterprises Finance Corp.   USD   1,800 %   11/02/2029   283.437   0.08   27.000   Cahn Enterprises IP Vial Ioan Enterprises Finance Corp.   USD   4,375 %   10/02/2029   283.437   0.08   10.0000   Intercontinental Exchange, Inc.   USD   2,650 %   15/09/2040   119.725   0.04   50.000   Intercontinental Exchange, Inc.   USD   2,650 %   15/09/2040   119.725   0.04   50.000   Intercontinental Exchange, Inc.   USD   2,050 %   15/09/2040   119.725   0.04   50.000   Invitation Homes Operating Partnership LP   USD   2,000 %   15/08/2031   52.305   0.02   25.000   JPMorgan Chase & Co.   USD   3,875 %   10/09/2025   49.475   0.01   10.0000   JPMorgan Chase & Co.   USD   3,876 %   10/09/2025   49.475   0.01   10.0000   JPMorgan Chase & Co.   USD   3,860 %   16/02/2025   49.475   0.01   10.0000   JPMorgan Chase & Co.   USD   3,860 %   16/02/2025   49.475   0.01   10.0000   JPMorgan Chase & Co.   USD   3,860 %   16/02/2025   49.475   0.01   10.0000   JPMorgan Chase & Co.   USD   3,865 %   01/12/2027   215.256   0.06   10.0000   JPMorgan Chase & Co.   USD   3,860 %   16/02/2025   34.350   0.10   10.0000   JPMorgan Chase & Co.   USD   3,860 %   16/02/2025   34.350   0.10   10.0000   JPMorgan Chase & Co.   USD   3,960 %   16/02/2027   218.753   0.03   10.0000   Variat Heinz Foods Co.   USD   3,960 %   16/02/2027   218.753   0.03   10.0000   Variat Heinz Foods Co.   USD   3,960 %   16/02/2027   218.05   0.06   10.0000   JPMorgan			USD	4,250 %	15/10/2028	56.306	0,02
25.000   Hewlett Packard Enterprise Co.							
2510.00   Hillenbrand, Inc.		·					
25.000   Home Depot, Inc.   USD   4,500 %   68/12/2048   32,721   0.01		·					
75.000   Host Hollels & Resorts LP - Serie J							
25.000   Huntsman International LLC   USD   4.500 %   0.105/2029   28.142   0.01							
50.000   Huntsmain International LLC   USD   2.960 %   15.002/231   59.813   0.02   10.000   Hysth Hotels Corp.   USD   1.800 %   10.002/2029   263.437   0.08   10.000   Icahn Enterprises EV Via Icahn Enterprises Finance Corp.   USD   3.050 %   12.002/2029   263.437   0.08   10.000   Intercontinental Exchange, Inc.   USD   2.650 %   15.002/2029   263.437   0.08   10.000   Intercontinental Exchange, Inc.   USD   2.650 %   15.002/2040   119.725   0.04   50.000   Intercontinental Exchange, Inc.   USD   2.000 %   15.002/2040   119.725   0.04   50.000   Invitation Homes Operating Partnership LP   USD   2.000 %   15.008/2031   52.305   0.02   232.000   Invitation Homes Operating Partnership LP   USD   2.000 %   15.008/2031   52.305   0.02   232.000   PMorgan Chase & Co.   USD   0.563 %   16.002/2024   347.539   0.10   0.000   PMorgan Chase & Co.   USD   0.563 %   16.002/2025   404.75   0.01   0.000   PMorgan Chase & Co.   USD   3.650 %   29.001/2027   106.753   0.03   0.000   0.000   PMorgan Chase & Co.   USD   3.650 %   29.001/2027   106.753   0.03   0.000   0.000   PMorgan Chase & Co.   Serie HHI <sup>(1)</sup>   USD   2.522 %   22.004/2031   101.044   0.03   0.000   0.000   PMorgan Chase & Co.   Serie HHI <sup>(2)</sup>   USD   4.507 %   25.005/2028   343.350   0.10   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.000   0.							
100.000   Hyath Hotels Corp.   USD   1,800 %   01/10/2024   100.176   0.03   270.000   Cahn Enterprises I-Visi Icahn Enterprises Finance Corp.   USD   3,375 %   01/02/2026   283.437   0.08   100.000   Intel Corp.   USD   3,050 %   12/08/2051   103.701   0.03   12.000   Intel Corp.   USD   2,850 %   15/09/2040   119.725   0.04   50.000   Intel Corp.   USD   2,850 %   15/09/2040   119.725   0.04   50.000   Invitation Homes Operating Partnership LP   USD   2,300 %   15/11/2028   49.845   0.01   50.000   Invitation Homes Operating Partnership LP   USD   2,300 %   15/08/2031   52.305   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02   0.02							
270.000   Cahn Enterprises LP Visi Icahn Enterprises Finance Corp.   USD   3,05%   1208/2051   103.701   0.03   125.000   Intel Corp.   USD   3,05%   1208/2051   103.701   0.03   125.000   Intel Corp.   USD   2,650 %   15/09/2040   119.725   0.04   50.000   Invitation Homes Operating Partnership LP   USD   2,000 %   15/08/2051   49.845   0.01   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   10.03   1							
100.000   Intel Corp.							
125.000   Intercontinental Exchange, Inc.		·					
55.000 Invitation Homes Operating Partnership LP 55.000 Invitation Homes Operating Partnership LP USD 2,000 % 15/11/2028 15/18/2023 15/2000 19/Morgan Chase & Co. USD 3,875 % 10/09/2024 347.539 0,10 50.000 JP/Morgan Chase & Co. USD 3,867 % 16/02/2025 149.475 0,011 100.000 JP/Morgan Chase & Co. USD 3,860 % 29/01/2027 108.753 0,03 200.000 JP/Morgan Chase & Co. USD 3,860 % 29/01/2027 108.753 0,03 200.000 JP/Morgan Chase & Co. USD 3,865 % 01/12/2027 12.15,256 0,06 10.0000 JP/Morgan Chase & Co. USD 3,625 % 01/12/2027 12.15,256 0,06 10.0000 JP/Morgan Chase & Co. USD 3,625 % 01/12/2027 12.15,256 0,06 10.0000 JP/Morgan Chase & Co. USD 3,625 % 01/12/2027 12.15,256 0,06 10.0000 JP/Morgan Chase & Co. USD 3,625 % 01/12/2027 12.15,256 0,06 10.0000 JP/Morgan Chase & Co. USD 4,600 % Perp. 176.414 0,03 175.000 JP/Morgan Chase & Co. USD 4,507 % 25/05/2023 343,350 0,10 30.000 Keurig DP-Pepper, Inc. USD 4,507 % 25/05/2023 343,350 0,10 30.000 Kraif Helinz Foods Co. USD 4,507 % 25/05/2023 343,350 0,01 35,0000 Kraif Helinz Foods Co. USD 4,375 % 01/06/2045 15/07/2035 366.015 0,01 15/0000 Kraif Helinz Foods Co. USD 4,375 % 01/06/2046 172.933 0,05 100.000 Lowe's Cos., Inc. USD 1,700 % 15/09/2028 98.036 0,03 15/0000 Lowe's Cos., Inc. USD 1,700 % 15/09/2028 98.036 0,03 15/0000 Lowe's Cos., Inc. USD 1,700 % 15/03/2042 303,100 0,09 100.000 Marathon Petroleum Corp. USD 3,800 % 15/03/2042 303,100 0,09 100.000 Marathon Petroleum Corp. USD 3,800 % 15/03/2042 303,100 0,09 100.000 Marathon Petroleum Corp. USD 3,800 % 15/03/2042 303,100 0,09 100.000 Marathon Petroleum Corp. USD 3,800 % 15/03/2042 303,100 0,09 100.000 Marathon Petroleum Corp. USD 3,800 % 15/03/2042 303,100 0,09 100.000 Marathon Petroleum Corp. USD 3,800 % 15/03/2042 303,100 0,09 100.000 Marathon Petroleum Corp. USD 3,200 % 15/03/2042 303,100 0,09 100.000 Marathon Petroleum Corp. USD 3,200 % 15/03/2042 303,100 0,09 100.000 Marathon Petroleum Corp. USD 3,200 % 15/03/2042 303,100 0,09 100.000 Marathon Petroleum Corp. USD 3,200 % 15/03/2042 303,100 0,09 100.000 Marathon Petroleum Corp.		•					
55,000   Invitation Homes Operating Partnership LP		- · · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					
\$35,000   JPMorgan Chase & Co. (9)		. •					
50.000   JPMorgan Chase & Co. (a)		. •					
100,000   JPMorgan Chase & Co. (a)							
100.000 JPMorgan Chase & Co. (a)			USD	3,960 %	29/01/2027	108.753	0,03
175.000   JPMorgan Chase & Co Serie HH   0   0,05   300.000   Keurig Dr Pepper, Inc.   USD   4,600 %   Perp.   176.414   0,05   300.000   Keurig Dr Pepper, Inc.   USD   5,550 %   01/06/2045   63,743   0,02   295.000   Kinder Morgan, Inc.   USD   5,550 %   01/06/2045   63,743   0,02   295.000   Kraft Heinz Foods Co.   USD   5,500 %   15/07/2035   366.015   0,11   150.000   Kraft Heinz Foods Co.   USD   4,375 %   01/06/2046   172.933   0,05   150.000   Lowe's Cos., Inc.   USD   1,700 %   15/09/2028   98.036   0,03   50.000   Lowe's Cos., Inc.   USD   1,700 %   15/09/2028   98.036   0,03   50.000   Lowe's Cos., Inc.   USD   1,700 %   15/09/2028   98.036   0,03   100.000   Lowe's Cos., Inc.   USD   7,850 %   15/03/2042   303.100   0,09   100.000   Marathon Petroleum Corp.   USD   3,800 %   01/04/2028   108.295   0,03   125.000   Marsh & McLennan Cos., Inc.   USD   4,375 %   15/03/2029   143.567   0,04   175.000   Martin Marietta Materials, Inc.   USD   4,375 %   15/03/2029   143.567   0,04   175.000   Martin Marietta Materials, Inc.   USD   3,200 %   15/07/2028   48.349   0,01   20.000   15/07/2028   48.349   0,01   20.000   15/07/2028   48.349   0,01   20.000   15/07/2028   273.007   0,08   20.000   15/07/2028   273.007   0,08   20.000   15/07/2028   273.007   0,08   20.000   15/07/2028   273.007   0,08   20.000   15/07/2028   273.007   0,08   20.000   15/07/2028   273.007   0,08   20.000   15/07/2028   273.007   0,08   20.000   15/07/2028   273.007   0,08   20.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   273.000   27	200.000	JPMorgan Chase & Co.	USD	3,625 %	01/12/2027	215.256	0,06
300.000   Keurig Dr Pepper, Inc.   USD   4,597 %   25/05/2028   343.350   0,10	100.000	JPMorgan Chase & Co.(d)	USD	2,522 %	22/04/2031	101.044	0,03
50.000         Kinder Morgan, Inc.         USD         5,550 %         0.1/06/2045         63,743         0,02           295.000         Kraft Heinz Foods Co.         USD         5,000 %         15/07/2035         366.015         0,11           150.000         Kraft Heinz Foods Co.         USD         4,375 %         01/06/2046         172.933         0,05           100.000         Lowe's Cos., Inc.         USD         1,700 %         15/10/2030         47.587         0,01           280.000         Lumen Technologies, Inc. – Serie U         USD         7,650 %         15/03/2042         303.100         0,09           100.000         Marathon Petroleum Corp.         USD         3,800 %         01/04/2028         188.295         0,03           125.000         Martin Marietta Materials, Inc.         USD         3,300 %         15/03/2029         143.567         0,04           175.000         Martin Marietta Materials, Inc.         USD         3,200 %         15/07/2051         180.103         0,05           50.000         Masco Corp.         USD         4,750 %         15/02/2028         48.349         0,01           267.000         Microchip Technology, Inc.         USD         2,670 %         01/09/2023         154.269         0,0	175.000	JPMorgan Chase & Co. – Serie HH <sup>(d)</sup>	USD	4,600 %	Perp.	176.414	0,05
295.000         Kraft Heinz Foods Co.         USD         5,000 %         15/07/2035         366.015         0,11           150.000         Kraft Heinz Foods Co.         USD         4,375 %         01/06/2046         172.933         0,05           100.000         Lowe's Cos., Inc.         USD         1,700 %         15/10/2030         47.587         0,01           280.000         Lowe's Cos., Inc.         USD         1,700 %         15/10/2030         47.587         0,01           280.000         Lumen Technologies, Inc Serie U         USD         7,650 %         15/03/2042         303.100         0,09           100.000         Marathon Petroleum Corp.         USD         3,800 %         01/04/2028         108.295         0,03           125.000         Marsh & McLennan Cos., Inc.         USD         4,375 %         15/03/2029         143.567         0,04           175.000         Martin Marietta Materials, Inc.         USD         1,500 %         15/07/2051         180.103         0,05           50.000         Masco Corp.         USD         1,500 %         15/07/2028         43.349         0,01           267.000         Micro Erbnology, Inc.         USD         2,670 %         01/09/2023         154.269         0,05				4,597 %	25/05/2028	343.350	
150.000   Kraft Heinz Foods Co.   USD   4,375 %   01/06/2046   172.933   0,05		•		5,550 %	01/06/2045		
100.000   Lowe's Cos., Inc.   USD   1,700 %   15/09/2028   98.036   0,03   50.000   Lowe's Cos., Inc.   USD   1,700 %   15/10/2030   47.587   0,01   280.000   Lumen Technologies, Inc. – Serie U   USD   7,650 %   15/03/2042   303.100   0,09   100.000   Marathon Petroleum Corp.   USD   3,800 %   01/04/2028   108.295   0,03   125.000   Marsh & McLennan Cos., Inc.   USD   4,375 %   15/03/2029   143.567   0,04   175.000   Martin Marietta Materials, Inc.   USD   3,200 %   15/07/2051   180.103   0,05   15/07/2051   180.103   0,05   15/07/2051   180.103   0,05   15/07/2051   180.103   0,05   15/07/2051   180.103   0,05   15/07/2051   180.103   0,05   15/07/2051   180.103   0,05   15/07/2051   180.103   0,05   15/07/2051   180.103   0,05   15/07/2051   180.103   0,05   15/07/2051   180.103   0,05   15/07/2051   180.103   0,05   15/07/2051   180.103   0,05   15/07/2051   180.103   0,05   15/07/2051   180.103   0,05   15/07/2051   180.103   0,05   15/07/2051   180.103   0,05   15/07/2051   180.103   0,05   15/07/2051   180.103   0,05   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15/07/2052   15							
50.000         Lowe's Cos., Inc.         USD         1,700 %         15/10/2030         47.587         0,01           280.000         Lumen Technologies, Inc. – Serie U         USD         7,650 %         15/03/2042         303.100         0,09           100.000         Marathon Petroleum Corp.         USD         3,800 %         01/04/2028         10.295         0,03           125.000         Marathon Petroleum Corp.         USD         4,375 %         15/03/2029         143.567         0,04           175.000         Martin Marietta Materials, Inc.         USD         3,200 %         15/07/2051         180.103         0,05           50.000         Masco Corp.         USD         1,500 %         15/10/2028         48.349         0,01           267.000         Micro Resorts International         USD         4,750 %         15/10/2028         273.007         0,08           150.000         Micro Fechnology, Inc.         USD         2,670 %         01/09/2023         154.269         0,05           50.000         Micro Technology, Inc.         USD         2,703 %         15/04/2032         50.355         0,01           125.000         Micro Technology, Inc.         USD         1,700 %         15/02/2031         23.818         0,01 <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>							
280.000       Lumen Technologies, Inc. – Serie U       USD       7,650 %       15/03/2042       303.100       0,09         100.000       Marathon Petroleum Corp.       USD       3,800 %       01/04/2028       108.295       0,03         125.000       Marsh & McLennan Cos., Inc.       USD       4,375 %       15/03/2029       143.567       0,04         175.000       Marin Marietta Materials, Inc.       USD       3,200 %       15/07/2051       180.103       0,05         50.000       Masco Corp.       USD       1,500 %       15/02/2028       48.349       0,01         267.000       MGM Resorts International       USD       4,750 %       15/10/2028       273.007       0,08         150.000       Microchip Technology, Inc.       USD       2,670 %       01/09/2023       154.269       0,05         50.000       Micron Technology, Inc.       USD       2,703 %       15/04/2032       50.355       0,01         25.000       Mid-America Apartments LP       USD       1,700 %       15/02/2031       23.818       0,01         125.000       Morgan Stanley       USD       4,100 %       22/05/2023       130.920       0,04         75.000       Morgan Stanley       USD       3,950 % <t< td=""><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></t<>							
100.000       Marathon Petroleum Corp.       USD       3,800 %       01/04/2028       108.295       0,03         125.000       Marsh & McLennan Cos., Inc.       USD       4,375 %       15/03/2029       143.567       0,04         175.000       Martin Marietta Materials, Inc.       USD       3,200 %       15/07/2051       180.103       0,05         50.000       Marso Corp.       USD       1,500 %       15/02/2028       48.349       0,01         267.000       MGM Resorts International       USD       4,750 %       15/10/2028       273.007       0,08         150.000       Microchipi Technology, Inc.       USD       2,670 %       01/09/2023       154.269       0,05         50.000       Micron Technology, Inc.       USD       2,703 %       15/04/2032       50.355       0,01         25.000       Micro Technology, Inc.       USD       1,700 %       15/04/2032       50.355       0,01         25.000       Micro Technology, Inc.       USD       1,700 %       15/04/2032       50.355       0,01         25.000       Micro Technology, Inc.       USD       1,700 %       15/04/2032       50.355       0,01         25.000       Micro Technology, Inc.       USD       1,700 % <td< td=""><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></td<>							
125.000       Marsh & McLennan Cos., Inc.       USD       4,375 %       15/03/2029       143.567       0,04         175.000       Martin Marietta Materials, Inc.       USD       3,200 %       15/07/2051       180.103       0,05         50.000       Masco Corp.       USD       1,500 %       15/02/2028       48.349       0,01         267.000       MGM Resorts International       USD       4,750 %       15/10/2028       273.007       0,08         150.000       Microchip Technology, Inc.       USD       2,670 %       01/09/2023       154.269       0,05         50.000       Micron Technology, Inc.       USD       2,703 %       15/04/2032       50.355       0,01         25.000       Mid-America Apartments LP       USD       1,700 %       15/02/2031       23.818       0,01         125.000       Morgan Stanley       USD       4,100 %       22/05/2023       130.920       0,04         75.000       Morgan Stanley(d)       USD       3,950 %       23/04/2027       274.855       0,08         200.000       Morgan Stanley(d)       USD       3,622 %       01/04/2031       82.139       0,02         175.000       Morgan Stanley (d)       USD       2,484 %       16/09/2036							
175.000       Martin Marietta Materials, Inc.       USD       3,200 %       15/07/2051       180.103       0,05         60.000       Masco Corp.       USD       1,500 %       15/02/2028       48.349       0,01         267.000       MGM Resorts International       USD       4,750 %       15/10/2028       273.007       0,08         150.000       Microchip Technology, Inc.       USD       2,670 %       01/09/2023       154.269       0,05         50.000       Micron Technology, Inc.       USD       2,703 %       15/04/2032       50.355       0,01         25.000       Mid-America Apartments LP       USD       1,700 %       15/02/2031       23.818       0,01         125.000       Morgan Stanley       USD       4,100 %       22/05/2023       130.920       0,04         75.000       Morgan Stanley(d)       USD       3,950 %       23/04/2027       274.855       0,08         200.000       Morgan Stanley(d)       USD       3,622 %       01/04/2031       82.139       0,02         175.000       Morgan Stanley(d)       USD       2,484 %       16/09/2036       188.835       0,05         1.500.000       Morgan Stanley Bank NA – Serie CD(d)       USD       0,349 %       02/12/20							
50.000       Masco Corp.       USD       1,500 %       15/02/2028       48.349       0,01         267.000       MGM Resorts International       USD       4,750 %       15/10/2028       273.007       0,08         150.000       Microchip Technology, Inc.       USD       2,670 %       01/09/2023       154.269       0,05         50.000       Micron Technology, Inc.       USD       2,703 %       15/04/2032       50.355       0,01         25.000       Micron Technology, Inc.       USD       1,700 %       15/02/2031       23.818       0,01         25.000       Micron Repartments LP       USD       4,100 %       22/05/2023       130.920       0,04         75.000       Morgan Stanley       USD       4,100 %       22/07/2025       77.583       0,02         250.000       Morgan Stanley       USD       3,950 %       23/04/2027       274.855       0,08         200.000       Morgan Stanley       USD       4,431 %       23/01/2030       228.338       0,07         75.000       Morgan Stanley       USD       3,622 %       01/04/2031       82.139       0,02         175.000       Morgan Stanley       USD       2,484 %       16/09/2036       168.835       0,05 <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>							
267.000       MGM Resorts International       USD       4,750 %       15/10/2028       273.007       0,08         150.000       Microchip Technology, Inc.       USD       2,670 %       01/09/2023       154.269       0,05         50.000       Micron Technology, Inc.       USD       2,703 %       15/04/2032       50.355       0,01         25.000       Mid-America Apartments LP       USD       1,700 %       15/02/2031       23.818       0,01         125.000       Morgan Stanley       USD       4,100 %       22/05/2023       130.920       0,04         75.000       Morgan Stanley(d)       USD       2,720 %       22/07/2025       77.583       0,02         250.000       Morgan Stanley(d)       USD       3,950 %       23/04/2027       274.855       0,08         200.000       Morgan Stanley(d)       USD       4,431 %       23/01/2030       228.338       0,07         75.000       Morgan Stanley(d)       USD       3,622 %       01/04/2031       82.139       0,02         175.000       Morgan Stanley(d)       USD       2,484 %       16/09/2036       188.835       0,05         1.500.000       Morgan Stanley(d)       USD       0,349 %       02/12/2021       1.500.000							
150.000       Microchip Technology, Inc.       USD       2,670 %       01/09/2023       154.269       0,05         50.000       Micron Technology, Inc.       USD       2,703 %       15/04/2032       50.355       0,01         25.000       Mid-America Apartments LP       USD       1,700 %       15/02/2031       23.818       0,01         125.000       Morgan Stanley       USD       4,100 %       22/05/2023       130.920       0,04         75.000       Morgan Stanley(d)       USD       2,720 %       22/07/2025       77.583       0,02         250.000       Morgan Stanley(d)       USD       3,950 %       23/04/2027       274.855       0,08         200.000       Morgan Stanley(d)       USD       4,431 %       23/01/2030       228.338       0,07         75.000       Morgan Stanley(d)       USD       3,622 %       01/04/2031       82.139       0,02         175.000       Morgan Stanley(d)       USD       2,484 %       16/09/2036       188.835       0,05         1.500.000       Morgan Stanley Bank NA – Serie CD(d)       USD       0,349 %       02/12/2021       1.500.000       0,45         100.000       MPLX LP       USD       2,650 %       15/08/2030       99.145		•					
50.000         Micron Technology, Inc.         USD         2,703 %         15/04/2032         50.355         0,01           25.000         Mid-America Apartments LP         USD         1,700 %         15/02/2031         23.818         0,01           125.000         Morgan Stanley         USD         4,100 %         22/05/2023         130.920         0,04           75.000         Morgan Stanley         USD         2,720 %         22/07/2025         77.583         0,02           250.000         Morgan Stanley         USD         3,950 %         23/04/2027         274.855         0,08           200.000         Morgan Stanley(d)         USD         4,431 %         23/01/2030         228.338         0,07           75.000         Morgan Stanley(d)         USD         3,622 %         01/04/2031         82.139         0,02           1.500.000         Morgan Stanley(d)         USD         2,484 %         16/09/2036         168.835         0,05           1.500.000         Morgan Stanley Bank NA – Serie CD(d)         USD         0,349 %         02/12/2021         1.500.000         99.145         0,03           50.000         MPLX LP         USD         2,650 %         15/08/2030         99.145         0,03							
25.000         Mid-America Apartments LP         USD         1,700 %         15/02/2031         23.818         0,01           125.000         Morgan Stanley         USD         4,100 %         22/05/2023         130.920         0,04           75.000         Morgan Stanley(d)         USD         2,720 %         22/07/2025         77.583         0,02           250.000         Morgan Stanley         USD         3,950 %         23/04/2027         274.855         0,08           200.000         Morgan Stanley(d)         USD         4,431 %         23/01/2030         228.338         0,07           75.000         Morgan Stanley(d)         USD         3,622 %         01/04/2031         82.139         0,02           175.000         Morgan Stanley(d)         USD         2,484 %         16/09/2036         168.835         0,05           1.500.000         Morgan Stanley Bank NA – Serie CD(d)         USD         0,349 %         02/12/2021         1.500.000         0,45           100.000         MPLX LP         USD         2,650 %         15/08/2030         99.145         0,03           50.000         MPLX LP         USD         4,625 %         01/08/2029         78.659         0,02           75.000         MPT							
125.000       Morgan Stanley       USD       4,100 %       22/05/2023       130.920       0,04         75.000       Morgan Stanley(d)       USD       2,720 %       22/07/2025       77.583       0,02         250.000       Morgan Stanley       USD       3,950 %       23/04/2027       274.855       0,08         200.000       Morgan Stanley(d)       USD       4,431 %       23/01/2030       228.338       0,07         75.000       Morgan Stanley(d)       USD       3,622 %       01/04/2031       82.139       0,02         175.000       Morgan Stanley Bank NA – Serie CD(d)       USD       2,484 %       16/09/2036       168.835       0,05         1.500.000       MPLX LP       USD       0,349 %       02/12/2021       1.500.000       0,45         100.000       MPLX LP       USD       2,650 %       15/08/2030       99.145       0,03         50.000       MPLX LP       USD       4,700 %       15/04/2048       57.709       0,02         75.000       MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.       USD       4,625 %       01/08/2029       78.659       0,02         104.000       Navient Corp.       USD       5,500 %       25/01/2023       107.900       0		97					
75.000         Morgan Stanley(d)         USD         2,720 %         22/07/2025         77.583         0,02           250.000         Morgan Stanley         USD         3,950 %         23/04/2027         274.855         0,08           200.000         Morgan Stanley(d)         USD         4,431 %         23/01/2030         228.338         0,07           75.000         Morgan Stanley(d)         USD         3,622 %         01/04/2031         82.139         0,02           175.000         Morgan Stanley(d)         USD         2,484 %         16/09/2036         168.835         0,05           1.500.000         Morgan Stanley Bank NA – Serie CD(d)         USD         0,349 %         02/12/2021         1.500.000         0,45           100.000         MPLX LP         USD         2,650 %         15/08/2030         99.145         0,03           50.000         MPLX LP         USD         4,700 %         15/04/2048         57.709         0,02           75.000         MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.         USD         4,625 %         01/08/2029         78.659         0,02           104.000         Navient Corp.         USD         5,500 %         25/01/2023         107.900         0,03           92.		•					
250.000         Morgan Stanley         USD         3,950 %         23/04/2027         274.855         0,08           200.000         Morgan Stanley(d)         USD         4,431 %         23/01/2030         228.338         0,07           75.000         Morgan Stanley(d)         USD         3,622 %         01/04/2031         82.139         0,02           175.000         Morgan Stanley(d)         USD         2,484 %         16/09/2036         188.835         0,05           1.500.000         Morgan Stanley Bank NA – Serie CD(d)         USD         0,349 %         02/12/2021         1.500.000         0,45           100.000         MPLX LP         USD         2,650 %         15/08/2030         99.145         0,03           50.000         MPLX LP         USD         4,700 %         15/04/2048         57.709         0,02           75.000         MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.         USD         4,625 %         01/08/2029         78.659         0,02           104.000         Navient Corp.         USD         5,500 %         25/01/2023         107.900         0,03           92.000         Navient Corp.         USD         5,625 %         01/08/2033         85.560         0,03							
75.000         Morgan Stanley <sup>(d)</sup> USD         3,622 %         01/04/2031         82.139         0,02           175.000         Morgan Stanley <sup>(d)</sup> USD         2,484 %         16/09/2036         168.835         0,05           1.500.000         Morgan Stanley Bank NA – Serie CD <sup>(d)</sup> USD         0,349 %         02/12/2021         1.500.000         0,45           100.000         MPLX LP         USD         2,650 %         15/08/2030         99.145         0,03           50.000         MPLX LP         USD         4,700 %         15/04/2048         57.709         0,02           75.000         MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.         USD         4,625 %         01/08/2029         78.659         0,02           104.000         Navient Corp.         USD         5,500 %         25/01/2023         107.900         0,03           92.000         Navient Corp.         USD         5,625 %         01/08/2033         85.560         0,03	250.000	Morgan Stanley	USD	3,950 %	23/04/2027	274.855	0,08
175.000         Morgan Stanley <sup>(d)</sup> USD         2,484 %         16/09/2036         168.835         0,05           1.500.000         Morgan Stanley Bank NA – Serie CD <sup>(d)</sup> USD         0,349 %         02/12/2021         1.500.000         0,45           100.000         MPLX LP         USD         2,650 %         15/08/2030         99.145         0,03           50.000         MPLX LP         USD         4,700 %         15/04/2048         57.709         0,02           75.000         MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.         USD         4,625 %         01/08/2029         78.659         0,02           104.000         Navient Corp.         USD         5,500 %         25/01/2023         107.900         0,03           92.000         Navient Corp.         USD         5,625 %         01/08/2033         85.560         0,03	200.000	Morgan Stanley <sup>(d)</sup>	USD	4,431 %	23/01/2030	228.338	0,07
1.500.000     Morgan Stanley Bank NA – Serie CD <sup>(d)</sup> USD     0,349 %     02/12/2021     1.500.000     0,45       100.000     MPLX LP     USD     2,650 %     15/08/2030     99.145     0,03       50.000     MPLX LP     USD     4,700 %     15/04/2048     57.709     0,02       75.000     MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.     USD     4,625 %     01/08/2029     78.659     0,02       104.000     Navient Corp.     USD     5,500 %     25/01/2023     107.900     0,03       92.000     Navient Corp.     USD     5,625 %     01/08/2033     85.560     0,03	75.000	Morgan Stanley <sup>(d)</sup>	USD	3,622 %	01/04/2031	82.139	0,02
100.000     MPLX LP     USD     2,650 %     15/08/2030     99.145     0,03       50.000     MPLX LP     USD     4,700 %     15/04/2048     57.709     0,02       75.000     MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.     USD     4,625 %     01/08/2029     78.659     0,02       104.000     Navient Corp.     USD     5,500 %     25/01/2023     107.900     0,03       92.000     Navient Corp.     USD     5,625 %     01/08/2033     85.560     0,03				2,484 %			0,05
50.000         MPLX LP         USD         4,700 %         15/04/2048         57.709         0,02           75.000         MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.         USD         4,625 %         01/08/2029         78.659         0,02           104.000         Navient Corp.         USD         5,500 %         25/01/2023         107.900         0,03           92.000         Navient Corp.         USD         5,625 %         01/08/2033         85.560         0,03				0,349 %		1.500.000	
75.000 MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.     USD     4,625 %     01/08/2029     78.659     0,02       104.000 Navient Corp.     USD     5,500 %     25/01/2023     107.900     0,03       92.000 Navient Corp.     USD     5,625 %     01/08/2033     85.560     0,03							
104.000 Navient Corp.     USD     5,500 %     25/01/2023     107.900     0,03       92.000 Navient Corp.     USD     5,625 %     01/08/2033     85.560     0,03							
92.000 Navient Corp. USD 5,625 % 01/08/2033 85.560 0,03							
•		•					
125.000 Newmont Corp. USD 2,250 % 01/10/2030 122.495 0,04		•					
	125.000	межнопі Согр.	USD	2,250 %	01/10/2030	122.495	0,04

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
	os – (continuación)					
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	USD	1,900 %	15/06/2028	183.365	0,05
	NiSource, Inc.	USD	3,950 %	30/03/2048	57.739 90.938	0,02
	Occidental Petroleum Corp. Oracle Corp.	USD	6,625 % 2,875 %	01/09/2030 25/03/2031	153.787	0,03 0,05
	Oracle Corp.	USD	4,000 %	15/11/2047	53.940	0,03
	Oracle Corp.	USD	3,600 %	01/04/2050	76.454	0,02
	Otis Worldwide Corp.	USD	3,112 %	15/02/2040	25.813	0,01
	Ovintiv Exploration, Inc.	USD	5,625 %	01/07/2024	164.349	0,05
	Pacific Gas and Electric Co.	USD	3,000 %	15/06/2028	125.677	0,04
125.000	Pacific Gas and Electric Co.	USD	2,500 %	01/02/2031	120.026	0,04
25.000	Pacific Gas and Electric Co.	USD	3,500 %	01/08/2050	23.848	0,01
200.000	PayPal Holdings, Inc.	USD	2,850 %	01/10/2029	210.758	0,06
	Penske Automotive Group, Inc.	USD	3,750 %	15/06/2029	354.150	0,11
	PerkinElmer, Inc.	USD	3,300 %	15/09/2029	106.885	0,03
	PerkinElmer, Inc.	USD	2,550 %	15/03/2031	76.519	0,02
	Phillips 66	USD	1,300 %	15/02/2026	24.582	0,01
	Pioneer Natural Resources Co.	USD	1,125 %	15/01/2026	97.661	0,03
	Plains All American Pipeline LP Via PAA Finance Corp.	USD	3,850 %	15/10/2023	182.716	0,05
	Plains All American Pipeline LP Via PAA Finance Corp. Progress Energy, Inc.	USD	3,800 %	15/09/2030	105.065 68.308	0,03
	Public Service Electric and Gas Co.	USD	7,000 % 3,950 %	30/10/2031 01/05/2042	147.300	0,02 0,04
	Raytheon Technologies Corp.	USD	4,125 %	16/11/2028	225.104	0,04
	Realty Income Corp.	USD	3,400 %	15/01/2028	107.816	0,07
	Realty Income Corp.	USD	3,100 %	15/12/2029	80.327	0,03
	Realty Income Corp.	USD	2,850 %	15/12/2032	104.501	0,02
	Regions Financial Corp.	USD	1,800 %	12/08/2028	98.070	0,03
	Republic Services, Inc.	USD	1,750 %	15/02/2032	71.042	0,02
	Sabine Pass Liquefaction LLC	USD	6,250 %	15/03/2022	102.209	0,03
	Sabine Pass Liquefaction LLC	USD	5,625 %	01/03/2025	195.323	0,06
	Sabine Pass Liquefaction LLC	USD	5,000 %	15/03/2027	56.457	0,02
100.000	Santander Holdings USA, Inc.	USD	4,500 %	17/07/2025	108.783	0,03
100.000	Sempra Energy	USD	3,800 %	01/02/2038	110.832	0,03
180.000	Service Properties Trust	USD	4,750 %	01/10/2026	173.112	0,05
100.000	ServiceNow, Inc.	USD	1,400 %	01/09/2030	93.785	0,03
25.000	Sherwin-Williams Co.	USD	4,000 %	15/12/2042	28.792	0,01
	Skyworks Solutions, Inc.	USD	3,000 %	01/06/2031	25.501	0,01
	Southern Co.	USD	3,250 %	01/07/2026	158.769	0,05
	Southwestern Energy Co.	USD	5,375 %	01/02/2029	129.890	0,04
	Spirit AeroSystems, Inc.	USD	4,600 %	15/06/2028	214.312	0,06
	Spirit Realty LP	USD	4,000 %	15/07/2029	137.982	0,04
	Sprint Capital Corp. Steel Dynamics, Inc.	USD	8,750 % 1,650 %	15/03/2032 15/10/2027	178.050 48.876	0,05 0,01
	Stryker Corp.	USD	1,950 %	15/06/2030	172.032	0,01
	Sysco Corp.	USD	6,600 %	01/04/2040	36.606	0,03
	Sysco Corp.	USD	6,600 %	01/04/2050	39.533	0,01
	TEGNA, Inc.	USD	4,625 %	15/03/2028	230.000	0,07
	Time Warner Cable LLC	USD	5,875 %	15/11/2040	63.014	0,02
150.000	T-Mobile USA, Inc.	USD	3,500 %	15/04/2025	159.088	0,05
200.000	T-Mobile USA, Inc.	USD	3,750 %	15/04/2027	215.840	0,06
375.000	T-Mobile USA, Inc.	USD	2,050 %	15/02/2028	370.620	0,11
325.000	T-Mobile USA, Inc.	USD	3,875 %	15/04/2030	353.808	0,11
215.000	T-Mobile USA, Inc.	USD	2,875 %	15/02/2031	209.302	0,06
	T-Mobile USA, Inc.	USD	3,500 %	15/04/2031	103.421	0,03
	T-Mobile USA, Inc.	USD	3,000 %	15/02/2041	167.876	0,05
	TransDigm, Inc.	USD	5,500 %	15/11/2027	396.955	0,12
	Tri Pointe Homes, Inc.	USD	5,700 %	15/06/2028	221.144	0,07
	UDR, Inc.	USD	2,100 %	01/08/2032	24.046	0,01
	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,048 %	17/03/2022	1.799.722	0,54
	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,076 %	21/04/2022 31/10/2023	2.524.308 5.999.842	0,75
	Pagaré del Tesoro de Estados Unidos a tipo de interés variable <sup>(d)</sup> USA Compression Partners LP Via USA Compression Finance Corp.	USD	0,085 % 6,875 %	01/04/2026	123.722	1,79 0,04
	Valero Energy Corp.	USD	2,700 %	15/04/2023	102.760	0,04
	Verizon Communications, Inc.	USD	2,100 %	22/03/2028	155.397	0,03
	Verizon Communications, Inc.  Verizon Communications, Inc.	USD	4,329 %	21/09/2028	427.609	0,03
	Verizon Communications, Inc.	USD	4,016 %	03/12/2029	224.348	0,13
	Verizon Communications, Inc.	USD	5,250 %	16/03/2037	98.504	0,03
	Verizon Communications, Inc.	USD	2,650 %	20/11/2040	191.580	0,06
	Verizon Communications, Inc.	USD	3,850 %	01/11/2042	140.064	0,04
	VMware, Inc.	USD	1,800 %	15/08/2028	48.739	0,01
	VMware, Inc.	USD	2,200 %	15/08/2031	73.124	0,02
	Walgreens Boots Alliance, Inc.	USD	4,100 %	15/04/2050	57.703	0,02

					Valor de mercado	% del
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)	en USD	patrimonio
Bonos - (con	•					
	s – (continuación)					
	Wells Fargo & Co.(d)	USD	2,188 %	30/04/2026	102.302	0,03
	Wells Fargo & Co.	USD	4,100 %	03/06/2026	272.785	0,08
	Wells Fargo & Co. (d)	USD	3,196 %	17/06/2027	211.758	0,06
	Wells Fargo & Co.	USD USD	4,300 %	22/07/2027	167.173	0,05 0,02
	Whirlpool Corp.	USD	4,600 % 3,850 %	15/05/2050 15/07/2029	62.885 83.177	0,02
	WP Carey, Inc. WP Carey, Inc.	USD	2,400 %	01/02/2031	49.611	0,02
	WP Carey, Inc. WP Carey, Inc.	USD	2,450 %	01/02/2032	49.532	0,01
	Zimmer Biomet Holdings, Inc.	USD	3,550 %	20/03/2030	81.909	0,01
	Zoetis, Inc.	USD	2,000 %	15/05/2030	123.017	0,02
					58.737.895	17,54
TOTAL DE BOI (coste USD 67.					67.607.368	20,18
Tenencias	Descripción del valor				Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ord	linarias – 18,21 %					
Argentina						
328	MercadoLibre, Inc.				406.067	0,12
Australia 8 101	Goodman Group				142.838	0.04
	Goodman Group					0,04
	Ingenia Communities Group				195.260	0,06
	NEXTDC Ltd. Scentre Group				148.149 117.749	0,04
55.402	Scenife Group			-		0,04
Rálgica					603.996	0,18
Bélgica 3.071	Warehouses De Pauw CVA				144.666	0,04
Brasil						
	Banco Bradesco S.A.—Preferente				179.003	0,05
	Caixa Seguridade Participacoes S.A.				53.513	0,01
	Hapvida Participacoes e Investimentos S.A. 144A <sup>(c)</sup>				67.860	0,02
	Pagseguro Digital Ltd. "A"				91.543	0,03
	Rede D'Or Sao Luiz S.A. 144A <sup>(c)</sup>				90.423	0,03
				-	482.342	0,14
Canadá						
4.061	Canadian Apartment Properties REIT				184.199	0,06
	Chartwell Retirement Residences				115.136	0,03
1.598	Granite Real Estate Investment Trust				126.081	0,04
5.355	Summit Industrial Income REIT				95.865	0,03
				-	521.281	0,16
China						
	Alibaba Group Holding Ltd.				45.523	0,01
	Alibaba Group Holding Ltd.—ADR <sup>(e)</sup>				437.719	0,13
	ANTA Sports Products Ltd.				176.562	0,05
	Bilibili, Inc.—ADR <sup>(e)</sup>				130.204	0,04
	China Feihe Ltd. 144A <sup>(c)</sup>				97.748	0,03
	China Merchants Bank Co., Ltd. "H"				404.652	0,12
	CIFI Holdings Group Co., Ltd.				65.422	0,02
	Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. "A"				291.131	0,09
	Ecovacs Robotics Co., Ltd. "A"				72.597	0,02
	ENN Energy Holdings Ltd.				262.921	0,08
	Full Truck Alliance Co., Ltd.—ADR <sup>(e)</sup>				46.264	0,01
	GDS Holdings Ltd.—ADR <sup>(e)</sup> Hangzhou Robam Appliances Co., Ltd. "A"				91.721 95.149	0,03 0,03
	Kweichow Moutai Co., Ltd. "A"				395.906	0,03
	Luxshare Precision Industry Co., Ltd. "A"				106.353	0,12
	Meituan "B" 144A <sup>(c)</sup>				518.481	0,03
	Minth Group Ltd.				35.085	0,10
	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. "H"				209.480	0,01
	SF Holding Co., Ltd. "A"				76.208	0,00
	Silergy Corp.				337.787	0,10
	Sunny Optical Technology Group Co., Ltd.				283.147	0,09
	Tencent Holdings Ltd.				1.264.597	0,38
	-					-,

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ord	narias – (continuación)		
China – (contir			
	Topsports International Holdings Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	88.826	0,03
	WuXi AppTec Co., Ltd. "H" 144A(c)  Zhoiling Sophya Intelligent Controls Co., Ltd. "A"	175.761 106.332	0,05
29.012	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co., Ltd. "A"	5.815.576	0,03 1,74
Chipre		3.013.370	1,74
•	TCS Group Holding Plc.—GDR <sup>(e)</sup>	284.845	0,09
Egipto			
34.832	Commercial International Bank Egypt SAE	113.963	0,03
Finlandia 9 400	Neste OYJ	452.004	0,14
Francia	11000 010	102.004	0,14
	Gecina S.A.	216.832	0,06
4.370	Klepierre S.A.	93.208	0,03
2.910	Safran S.A.	332.240	0,10
		642.280	0,19
Alemania 3.448	Instone Real Estate Group S.E. 144A <sup>(c)</sup>	72.738	0,02
	Vonovia S.E.	475.062	0,14
		547.800	0,16
Grecia			
	JUMBO S.A.	158.234	0,05
Hong Kong	AIA Group Ltd.	309.614	0,09
	Alibaba Health Information Technology Ltd.	11.784	0,00
	China Mengniu Dairy Co., Ltd.	156.840	0,05
	CK Asset Holdings Ltd.	111.790	0,03
34.800	ESR Cayman Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	115.658	0,04
	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	262.760	0,08
	Hongkong Land Holdings Ltd.	101.085	0,03
	Link REIT	167.751	0,05
	Shangri-La Asia Ltd.	92.017 99.642	0,03 0,03
	Sino Biopharmaceutical Ltd. Swire Properties Ltd.	114.765	0,03
	Techtronic Industries Co., Ltd.	155.654	0,05
		1.699.360	0,51
Hungría			
	OTP Bank Nyrt	207.303	0,06
India 2.495	Avenue Supermarts Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	156.771	0,05
	Divi's Laboratories Ltd.	204.678	0,06
1.171	FSN E-Commerce Ventures Ltd.	38.026	0,01
	Godrej Properties Ltd.	192.750	0,06
	ICICI Lombard General Insurance Co., Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	184.771	0,05
	Info Edge India Ltd.	238.482	0,07
	Infosys Ltd. Infosys Ltd.—ADR <sup>(e)</sup>	349.728 30.186	0,10 0,01
	Kotak Mahindra Bank Ltd.	195.850	0,01
	SBI Life Insurance Co., Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	145.818	0,04
	Sona BLW Precision Forgings Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	120.693	0,04
	Tata Consumer Products Ltd.	128.883	0,04
	Wipro Ltd.	193.042	0,06
111.914	Zomato Ltd.	227.171 	0,07
Indonesia		2.406.849	0,72
	Bank Central Asia Tbk PT	270.705	0,08
	O II D TIET	44.000	0,01
73.860	Semen Indonesia Persero Tbk PT	41.329	0,01

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% de patrimonio
Acciones ord	narias – (continuación)		
Irlanda			
	Accenture Plc. "A"	848.148	0,25
17.185	Dalata Hotel Group Plc.	66.288	0,02
		914.436	0,27
Italia 31 795	Davide Campari-Milano NV	466.334	0,14
Japón	Burne Sumpan milano IIV	-100.004	0,1-
	GLP J-REIT	115.290	0,03
4.800	Hoya Corp.	770.017	0,23
104	Hulic Reit, Inc.	153.907	0,05
	Japan Metropolitan Fund Invest	107.383	0,03
11.900	Keihanshin Building Co., Ltd.	145.066	0,04
	Kenedix Office Investment Corp.	122.181	0,04
	Kenedix Retail REIT Corp.	59.735	0,02
	Keyence Corp.	749.348	0,22
	Mitsubishi Estate Co., Ltd.	160.259	0,05
	Mitsui Fudosan Co., Ltd.	196.241	0,06
	Nidec Corp.	773.614	0,23
	Open House Co., Ltd.	79.971	0,02
	Sankei Real Estate, Inc.	164.223	0,05
129	United Urban Investment Corp.	165.787	0,05
		3.763.022	1,12
México 25 563	Arca Continental SAB de CV	159.074	0,05
	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV "A"	120.938	0,03
	Prologis Property Mexico S.A. de CV	40.517	0,01
	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	155.815	0,05
		476.344	0,14
Países Bajos			
	CTP NV	81.833	0,02
2.717	Koninklijke DSM NV	595.585	0,18
		677.418	0,20
Filipinas	1.117	04.500	0.00
	Jollibee Foods Corp. Monde Nissin Corp. 144A <sup>(c)</sup>	61.566 135.080	0,02
400.000	Monde Nissin Corp. 144A		0,04
D-1i-		196.646	0,06
Polonia 2.292	Dino Polska S.A. 144A <sup>(c)</sup>	191.681	0,06
	InPost S.A.	81.301	0,02
11.682	Powszechna Kasa Oszczedności Bank Polski S.A.	124.071	0,04
		397.053	0,12
Rusia			-,
	Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC	49.979	0,02
	Ozon Holdings Plc.—ADR <sup>(e)</sup>	106.602	0,03
	Sberbank of Russia PJSC	161.719	0,05
4.123	Yandex NV "A"	301.556	0,09
		619.856	0,19
Arabia Saudí		-	
9.950	Saudi National Bank	160.193	0,05
Singapur			
	Ascendas Real Estate Investment Trust	153.669	0,05
	Lendlease Global Commercial REIT	95.855	0,03
782	Sea Ltd.—ADR <sup>(e)</sup>	234.921	0,07
		484.445	0,15
Sudáfrica	Cliele Croup Ltd	4=0.000	0.00
	Clicks Group Ltd.	156.939	0,05
	Mr Price Group Ltd.	126.770	0,04
4.842	Santam Ltd.	77.690	0,02
		361.399	0,11

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ord	inarias – (continuación)		
Corea del Sur			
	Hankook Tire & Technology Co., Ltd.	82.834	0,02
	KB Financial Group, Inc.	128.817	0,04
	Krafton, Inc.	87.651	0,03
	LG Electronics, Inc. NAVER Corp.	179.064 288.281	0,05 0,09
	NCSoft Corp.	210.394	0,09
	Orion Corp.	92.157	0,03
	Samsung Electronics Co., Ltd.	1.089.110	0,32
		2.158.308	0,64
España			
•	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	675.862	0,20
1.947	Cellnex Telecom S.A. 144A <sup>(c)</sup>	118.479	0,03
10.893	Merlin Properties Socimi S.A.	122.682	0,04
		917.023	0,27
Suecia			
	Castellum AB	246.877	0,07
34.970	Hexagon AB "B"	525.576	0,16
		772.453	0,23
Suiza			
44.452	UBS Group AG	765.293	0,23
Taiwán			
	Chailease Holding Co., Ltd.	199.331	0,06
	MediaTek, Inc.	400.114	0,12
	Nien Made Enterprise Co., Ltd.	41.001	0,01
	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	1.477.882	0,44
	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.—ADR <sup>(e)</sup>	1.069.597	0,32
	United Microelectronics Corp. Win Semiconductors Corp.	157.219 91.491	0,05 0,03
7.000	will definicultuations dutp.	3.436.635	
Tailandia		3.430.033	1,03
	Airports of Thailand PCL	117.461	0,03
	Kasikornbank PCL	152.549	0,05
		270.010	0,08
Emiratos Áral	nes Unidos		
	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	146.826	0,04
Reino Unido			
	AstraZeneca Plc.	1.066.934	0,32
6.613	Big Yellow Group Plc.	146.567	0,04
35.519	Capital & Counties Properties Plc.	78.200	0,02
1.893	Derwent London Plc.	86.187	0,03
	Ferguson Plc.	845.471	0,25
	InterContinental Hotels Group Plc.	699.473	0,21
	Life Science REIT Plc.	73.266	0,02
	LondonMetric Property Plc. Reckitt Benckiser Group Plc.	109.858 901.252	0,03 0,27
	Rentokil Initial Plc.	516.539	0,27
	Segro Plc.	312.773	0,10
	Tritax EuroBox Plc. 144A(c)	98.954	0,03
	UNITE Group Plc.	195.399	0,06
		5.130.873	1,53
Estados Unid	os		
	Alexandria Real Estate Equities, Inc.	436.475	0,13
	Alphabet, Inc. "A"	1.264.815	0,38
	American Tower Corp.	1.200.365	0,36
8.120	AvalonRay Communities Inc.	262.438 491.912	0,08 0,15
2.054	AvalonBay Communities, Inc.	491.912 889.041	0,15
	Ball Corn	009.041	
9.536	Ball Corp. Boston Properties, Inc.	191 195	0.06
9.536 1.770	Boston Properties, Inc.	191.195 1.010.302	
9.536 1.770 26.133	Boston Properties, Inc. Boston Scientific Corp.	191.195 1.010.302 870.561	0,30
9.536 1.770 26.133 2.991	Boston Properties, Inc.	1.010.302	0,06 0,30 0,26 0,10

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ord	inarias – (continuación)		
Estados Unido	s – (continuación)		
	Cousins Properties, Inc.	122.567	0,04
	CubeSmart	305.827	0,09
	Digital Realty Trust, Inc.	253.500	0,08
	Duke Realty Corp.	341.079	0,10
	EastGroup Properties, Inc. Elanco Animal Health, Inc.	266.598 744.172	0,08 0,22
	EPAM Systems, Inc.	115.767	0,03
	Equinix, Inc.	688.342	0,20
	Equity LifeStyle Properties, Inc.	288.346	0,09
	Equity Residential	129.658	0,04
	Essex Property Trust, Inc.	347.732	0,10
1.540	Federal Realty Investment Trust	191.730	0,06
8.767	Fidelity National Information Services, Inc.	923.340	0,28
	Healthpeak Properties, Inc.	282.350	0,08
	Highwoods Properties, Inc.	92.945	0,03
	Honeywell International, Inc.	592.896	0,18
	Host Hotels & Resorts, Inc.	243.615	0,07
	Hudson Pacific Properties, Inc.	87.038	0,03
	Intuit, Inc. Invitation Homes, Inc.	963.578 392.428	0,29 0,12
	Kilroy Realty Corp.	392.426 101.520	0,12
	Marsh & McLennan Cos., Inc.	939.203	0,03
	Martin Marietta Materials, Inc.	565.729	0,17
	MGM Growth Properties LLC "A"	79.773	0,02
3.340	NIKE, Inc. "B"	566.197	0,17
6.688	Northern Trust Corp.	784.636	0,23
1.881	NVIDIA Corp.	626.147	0,19
127	Orion Office REIT, Inc.	2.259	0,00
	Pebblebrook Hotel Trust	77.028	0,02
	Procter & Gamble Co.	1.099.712	0,33
	Prologis, Inc.	785.808	0,23
	Public Storage	648.100	0,19
	Realty Income Corp.	89.748 217.295	0,03
	Regency Centers Corp. RLJ Lodging Trust	85.594	0,06 0,03
	Ryman Hospitality Properties, Inc.	93.303	0,03
	S&P Global, Inc.	559.716	0,03
	SBA Communications Corp.	118.641	0,03
	Simon Property Group, Inc.	532.233	0,16
	SITE Centers Corp.	83.099	0,02
2.960	STORE Capital Corp.	99.042	0,03
455	Sun Communities, Inc.	89.030	0,03
1.499	Terreno Realty Corp.	114.149	0,03
	Ventas, Inc.	245.587	0,07
	Walt Disney Co.	631.060	0,19
3.122	Welltower, Inc.	254.849	0,08
TOTAL DE ACC	CIONES ORDINARIAS	24.062.816	7,19
(coste USD 49		60.975.983	18,21
Derechos – 0 Alemania	01 %		
8.467	Vonovia S.E.—Derechos	31.369	0,01
TOTAL DE DEI (coste USD 0)	RECHOS	31.369	0,01
	versión – 9,35 %		
Irlanda			
	iShares MSCI Emerging Markets IMI ESG Screened UCITS ETF	718.959	0,22
448.337	iShares S&P 500 Energy Sector UCITS ETF	2.252.893	0,67
		2.971.852	0,89

Tenencias	Descripción del valor				Valor de mercado en USD	% de
Fondos de inv	versión – (continuación)					-
Luxemburgo	,					
	Goldman Sachs Funds - Emerging Markets Debt Portfolio (Clase de a		,		11.708.795	3,49
176.839	Goldman Sachs Funds - Global Strategic Macro Bond Portfolio (Clase	de accione	s de distribución IO) <sup>(f)</sup>	_	16.642.301	4,97
					28.351.096	8,46
TOTAL DE FON (coste USD 31.	NDOS DE INVERSIÓN 451.625)				31.322.948	9,35
TOTAL DE VAL	ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA	DE VALOR	ES OFICIAL		159.937.668	47,75
(COSTE OSD 143	5.230.311)				Valor de mercado	% de
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento(b)		patrimonio
Valores mobil Bonos – 26,63	liarios negociados en otro mercado regulado					
•	5 /6					
Bermudas 100 000	Bacardi Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,300 %	15/05/2048	135.326	0,04
	IHS Markit Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	01/03/2026	163.331	0,05
100.000	THO MUNICED. 1447	_	4,000 70	01/100/2020		
					298.657	0,09
Canadá	4044770 DO III O V5- Nov. Dod Fin	1100	4 000 00	4514010555	70 :	
	1011778 BC ULC Via New Red Finance, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	4,000 % 5,250 %	15/10/2030 30/01/2030	78.165 355.865	0,02 0,11
	GFL Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	01/08/2028	337.560	0,1
	GFL Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	15/08/2029	111.837	0,10
			-,		883.427	0,26
Islas Caimán						
125.000	Avolon Holdings Funding Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	15/04/2026	133.673	0,04
125.000	Avolon Holdings Funding Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,250 %	15/02/2027	127.875	0,04
268.000	Seagate HDD Cayman 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,125 %	15/07/2029	254.265	0,08
70.000	Transocean, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD _	11,500 %	30/01/2027	66.500	0,02
Formala					582.313	0,18
350,000	BNP Paribas S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,323 %	13/01/2027	341.978	0,10
	BNP Paribas S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	2,824 %	26/01/2041	191.018	0,06
	BPCE S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,700 %	22/10/2023	243.880	0,07
250.000	BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,116 %	19/10/2032	251.442	0,07
250.000	Constellium S.E. 144A <sup>(c)</sup>	USD _	5,875 %	15/02/2026	253.125	0,08
					1.281.443	0,38
Irlanda	AID Cours Dis 444A(C)	HOD	4.750.0/	40/40/0000	040.050	0.00
200.000	AIB Group Plc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	12/10/2023	213.252	0,06
Italia	11-10	HOD	5.450.0/	20/02/2025	040.000	0.0
	UniCredit SpA 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	5,459 %	30/06/2035	219.686	0,07
Países Bajos	5 L5: LANG (1)	LIOD	4.075.0/	10/07/0000	100 110	0.00
	Enel Finance International NV 144A <sup>(c)</sup>	USD	1,875 %	12/07/2028	196.442	0,06
	ING Groep NV 144A <sup>(c)(d)</sup> Lundin Energy Finance BV 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	1,400 % 2,000 %	01/07/2026 15/07/2026	198.800 199.468	0,06 0,06
200.000	Edition Energy Finance By 14474	_	2,000 70	13/01/2020	594.710	0,18
Supranacional					354.710	0,10
•	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp. Via Atlas					
	Luxco 4 SARL 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	01/06/2028	282.025	0,09
180.000	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp. Via Atlas					
100.000	Luxco 4 SARL 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	01/06/2028	173.925	0,05
	NXP BV Via NXP Funding LLC Via NXP USA, Inc. 144A <sup>(c)</sup> NXP BV Via NXP Funding LLC Via NXP USA, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	3,400 % 2,500 %	01/05/2030 11/05/2031	107.020 175.703	0,03 0,05
175.000	TATE BY VIA TATE I UITUING ELO VIA TATE USA, IIIC. 144A	035_	2,300 /6	11/03/2031	738.673	0,03
Estados Unido	S.				730.073	0,22
	7-Eleven, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	2,500 %	10/02/2041	69.281	0,02
	AdaptHealth LLC 144A(c)	USD	6,125 %	01/08/2028	228.437	0,07
	Allison Transmission, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,750 %	30/01/2031	235.812	0,07
335 000	ANGI Group LLC 144A(c)	USD	3,875 %	15/08/2028	318.669	0,10
	APi Group DE, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD				0,05

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con	<u> </u>		·			<u>·                                     </u>
	s – (continuación)					
	Aramark Services, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,375 %	01/05/2025	225.212	0,07
	Arcosa, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Asbury Automotive Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	4,375 % 4,625 %	15/04/2029 15/11/2029	199.709 98.091	0,06 0,03
	Asbury Automotive Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	15/02/2032	53.663	0,03
	Aviation Capital Group LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	1,950 %	30/01/2026	49.370	0,01
	Baxter International, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	2,272 %	01/12/2028	100.803	0,03
125.000	Baxter International, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	2,539 %	01/02/2032	126.401	0,04
	Broadcom, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,419 %	15/04/2033	155.082	0,05
	Broadcom, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,469 %	15/04/2034	272.760	0,08
	Broadcom, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,137 %	15/11/2035	258.494	0,08
	Broadcom, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	3,500 %	15/02/2041	75.122	0,02
	Broadcom, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Buckeye Partners LP 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,750 % 4,500 %	15/02/2051 01/03/2028	77.808 220.781	0,02 0,07
	Catalent Pharma Solutions, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,125 %	15/02/2029	52.663	0,07
	Clarivate Science Holdings Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	01/07/2028	533.250	0,16
	CommScope, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,125 %	01/07/2028	201.025	0,06
100.000	CoStar Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	2,800 %	15/07/2030	101.881	0,03
100.000	Duquesne Light Holdings, Inc. 144A(c)	USD	2,532 %	01/10/2030	99.504	0,03
	EQT Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,625 %	15/05/2031	316.587	0,09
	Federal Farm Credit Banks Funding Corp.(d)	USD	0,290 %	13/12/2021	400.024	0,12
	Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (d)	USD	0,290 %	13/12/2021	200.012	0,06
	Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (d)	USD	0,095 %	31/01/2022	99.999	0,03
	Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (d) Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (d)	USD USD	0,180 %	11/02/2022	100.013	0,03
	Federal Farm Credit Banks Funding Corp.(d)	USD	0,195 % 0,196 %	14/02/2022 18/04/2022	200.034 5.702.223	0,06 1,70
	Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (d)	USD	0,140 %	21/11/2022	200.032	0,06
	Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (d)	USD	0,150 %	02/12/2022	199.986	0,06
	Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (d)	USD	0,080 %	17/02/2023	100.001	0,03
	Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (d)	USD	0,085 %	23/10/2023	200.038	0,06
2.500.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes	USD	0,041 %	08/12/2021	2.499.990	0,75
18.000.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes	USD	0,009 %	12/01/2022	17.999.370	5,37
	Federal Home Loan Bank Discount Notes	USD	0,005 %	14/01/2022	17.999.340	5,37
	Federal Home Loan Bank Discount Notes	USD	0,021 %	16/02/2022	2.999.743	0,90
	Federal Home Loan Bank Discount Notes Federal Home Loan Bank Discount Notes	USD USD	(0,022 %)	18/02/2022	8.999.210	2,69
	Federal Home Loan Banks	USD	0,053 % 0,050 %	23/03/2022 25/01/2022	11.697.817 3.499.370	3,49 1,04
	Federal Home Loan Banks <sup>(d)</sup>	USD	0,170 %	28/02/2022	200.048	0,06
	Freedom Mortgage Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,625 %	01/05/2026	221.950	0,07
	Gartner, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,750 %	01/10/2030	130.650	0,04
75.000	Glencore Funding LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	2,625 %	23/09/2031	72.956	0,02
50.000	Glencore Funding LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,375 %	23/09/2051	48.278	0,01
	Go Daddy Operating Co., LLC Via GD Finance Co., Inc. 144A(c)	USD	5,250 %	01/12/2027	223.063	0,07
	H&E Equipment Services, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	15/12/2028	269.445	0,08
	Howard Hughes Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,375 %	01/08/2028	236.250	0,07
	HUB International Ltd. 144A <sup>(c)</sup> iHeartCommunications, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	7,000 % 4,750 %	01/05/2026 15/01/2028	184.725 164.588	0,06 0,05
	Imola Merger Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 % 4,750 %	15/05/2029	378.510	0,03
	Ingevity Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	01/11/2028	278.400	0,08
	International Flavors & Fragrances, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	2,300 %	01/11/2030	98.548	0,03
125.000	International Flavors & Fragrances, Inc. 144A(c)	USD	3,268 %	15/11/2040	128.799	0,04
75.000	Kyndryl Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	2,050 %	15/10/2026	73.454	0,02
	LCM Investments Holdings II LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	01/05/2029	302.250	0,09
	LD Holdings Group LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,500 %	01/11/2025	97.000	0,03
	LPL Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	15/11/2027	105.315	0,03
	ModivCare, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,875 %	15/11/2025	40.560	0,01
	Mozart Debt Merger Sub, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Mozart Debt Merger Sub, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	3,875 % 5,250 %	01/04/2029 01/10/2029	147.563 114.425	0,04 0,03
	MSCI, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,625 %	01/11/2031	185.640	0,03
	Netflix, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	15/06/2030	173.344	0,05
	NRG Energy, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,450 %	15/06/2029	82.310	0,02
	Organon & Co. Via Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,125 %	30/04/2031	321.300	0,10
175.000	Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A(c)	USD	6,250 %	15/06/2025	182.109	0,05
	Prestige Brands, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,750 %	01/04/2031	124.394	0,04
	Realogy Group LLC Via Realogy Co-Issuer Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	01/06/2023	236.900	0,07
	Sabre GLBL, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	9,250 %	15/04/2025	229.856	0,07
	Scripps Escrow II, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,375 % 3,750 %	15/01/2031	10.100	0,00
	Sensata Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Shift4 Payments LLC Via Shift4 Payments Finance Sub, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	3,750 % 4,625 %	15/02/2031 01/11/2026	291.312 41.450	0,09 0,01
	Six Flags Entertainment Corp. 144A(c)	USD	5,500 %	15/04/2027	240.425	0,01
	Sonic Automotive, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	15/11/2029	350.119	0,10
	Spectrum Brands, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	15/03/2031	222.130	0,07
			•			•

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
	os – (continuación)					
	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	1,711 %	29/01/2027	197.098	0,06
	Travel & Leisure Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,625 %	31/07/2026	228.900	0,07
	Venture Global Calcasieu Pass LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	15/08/2031	46.209	0,01
	Vistra Operations Co., LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	01/05/2029	314.000	0,09
50.000	Vistra Operations Co., LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,300 %	15/07/2029	53.619 84.373.199	25,19
TOTAL DE BO						
TOTAL DE VAI	.339.236) LORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REG	GULADO			89.185.360	26,63
(coste USD 89	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·				89.185.360	26,63
Otros valores	s mobiliarios					
Bonos - 0,46 9	%					
Francia						
1.000.000	Credit Industriel et Commercial	USD	0,000 %	07/04/2022	999.424	0,30
Estados Unido						
	CCO Holdings LLC Via CCO Holdings Capital Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,250 %	15/01/2034	200.813	0,06
	Glencore Funding LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	2,850 %	27/04/2031	50.021	0,02
295.000	Penn National Gaming, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,125 %	01/07/2029	279.512	0,08
TOTAL DE BO	NOS				530.346	0,16
(coste USD 1.					1.529.770	0,46
Tenencias	Descripción del valor				Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	· ·					<b>F</b>
Derechos – ( China	J,00 %					
6.000	CIFI Holdings Group—Derechos <sup>(g)</sup>				193	0,00
(coste USD 0)	RECHOS				193	0,00
TOTAL DE OT	ROS VALORES MOBILIARIOS 542.438)				1.529.963	0,46
					Valor de mercado	% del
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés	Fecha de vencimiento	en USD	patrimonio
Certificados	de depósito – 4,44 %					
Canadá						
262.000	Canadian Imperial Bank <sup>(d)</sup>	USD	0,163 %	24/01/2022	262.039	0,08
Alemania	·		.,			· ·
Alemania 1.000.000	Canadian Imperial Bank <sup>(d)</sup> Landesbank Baden-Wuerttemberg	USD	0,163 % 0,220 %	24/01/2022 01/12/2021	262.039 1.000.004	0,08
Alemania 1.000.000 Japón	Landesbank Baden-Wuerttemberg	USD	0,220 %	01/12/2021	1.000.004	0,30
Alemania 1.000.000 Japón 1.000.000	Landesbank Baden-Wuerttemberg  MUFG Bank Ltd.	USD	0,220 %	01/12/2021	1.000.004	0,30
Alemania 1.000.000 Japón 1.000.000	Landesbank Baden-Wuerttemberg	USD	0,220 %	01/12/2021	1.000.004 1.000.189 1.000.196	0,30 0,29 0,30
Alemania 1.000.000 Japón 1.000.000 1.000.000	Landesbank Baden-Wuerttemberg  MUFG Bank Ltd.	USD	0,220 %	01/12/2021	1.000.004	0,30
1.000.000  Japón 1.000.000 1.000.000 Países Bajos	Landesbank Baden-Wuerttemberg  MUFG Bank Ltd. Norinchukin Bank	USD USD USD	0,220 % 0,240 % 0,240 %	01/12/2021 31/01/2022 21/01/2022	1.000.004 1.000.189 1.000.196 2.000.385	0,30 0,29 0,30 0,59
Alemania	Landesbank Baden-Wuerttemberg  MUFG Bank Ltd. Norinchukin Bank  Cooperatieve Centrale	USD	0,220 %	01/12/2021	1.000.004 1.000.189 1.000.196	0,30 0,29 0,30 0,59
Alemania	Landesbank Baden-Wuerttemberg  MUFG Bank Ltd. Norinchukin Bank  Cooperatieve Centrale	USD USD USD	0,220 % 0,240 % 0,240 %	01/12/2021 31/01/2022 21/01/2022	1.000.004 1.000.189 1.000.196 2.000.385	0,30 0,29 0,30 0,59
Alemania	Landesbank Baden-Wuerttemberg  MUFG Bank Ltd. Norinchukin Bank  Cooperatieve Centrale	USD USD USD_	0,220 % 0,240 % 0,240 % 0,160 %	01/12/2021 31/01/2022 21/01/2022 10/12/2021	1.000.004 1.000.189 1.000.196 2.000.385	0,30 0,29 0,30 0,59
Alemania	Landesbank Baden-Wuerttemberg  MUFG Bank Ltd. Norinchukin Bank  Cooperatieve Centrale  Ss  Bayerische Landesbank(d)	USD USD USD USD	0,220 %  0,240 %  0,240 %  0,160 %	01/12/2021 31/01/2022 21/01/2022 10/12/2021 28/01/2022	1.000.004 1.000.189 1.000.196 2.000.385 1.000.021	0,30 0,29 0,30 0,59 0,30
Alemania 1.000.000 Japón 1.000.000 1.000.000  Países Bajos 1.000.000 Estados Unide 1.900.000 1.000.000 1.000.000	Landesbank Baden-Wuerttemberg  MUFG Bank Ltd. Norinchukin Bank  Cooperatieve Centrale  Ss  Bayerische Landesbank(d) Bayerische Landesbank	USD USD USD USD	0,220 %  0,240 %  0,240 %  0,160 %  0,606 %  0,210 %	01/12/2021 31/01/2022 21/01/2022 10/12/2021 28/01/2022 12/05/2022	1.000.004 1.000.189 1.000.196 2.000.385 1.000.021 1.900.503 999.891	0,30 0,29 0,30 0,59 0,30
Alemania 1.000.000 Japón 1.000.000 1.000.000 Países Bajos 1.000.000 Estados Unide 1.900.000 1.000.000 630.000	Landesbank Baden-Wuerttemberg  MUFG Bank Ltd. Norinchukin Bank  Cooperatieve Centrale  DS  Bayerische Landesbank(d) Bayerische Landesbank Credit Suisse	USD USD USD USD USD USD USD	0,220 %  0,240 %  0,240 %  0,160 %  0,606 %  0,210 %  0,400 %	01/12/2021 31/01/2022 21/01/2022 10/12/2021 28/01/2022 12/05/2022 10/11/2022	1.000.004  1.000.189 1.000.196 2.000.385  1.000.021  1.900.503 999.891 999.808	0,30 0,29 0,30 0,59 0,30 0,56 0,30 0,30 0,19
Alemania	Landesbank Baden-Wuerttemberg  MUFG Bank Ltd. Norinchukin Bank  Cooperatieve Centrale  Ss  Bayerische Landesbank(d) Bayerische Landesbank Credit Suisse HSBC Bank(d)	USD USD USD USD USD USD USD USD	0,220 %  0,240 %  0,240 %  0,160 %  0,606 %  0,210 %  0,400 %  0,290 %	01/12/2021 31/01/2022 21/01/2022 10/12/2021 28/01/2022 12/05/2022 10/11/2022 18/11/2022	1.000.004 1.000.189 1.000.196 2.000.385 1.000.021 1.900.503 999.891 999.808 629.815	0,30 0,29 0,30 0,59 0,30 0,56 0,30 0,30 0,19 0,26
Alemania 1.000.000 Japón 1.000.000 1.000.000 Países Bajos 1.000.000 Estados Unide 1.900.000 1.000.000 630.000 630.000 890.000 1.000.000	Landesbank Baden-Wuerttemberg  MUFG Bank Ltd. Norinchukin Bank  Cooperatieve Centrale  Ds  Bayerische Landesbank(d) Bayerische Landesbank  Credit Suisse HSBC Bank(d) Landesbank Hessen-Thuringen	USD USD USD USD USD USD USD USD	0,220 %  0,240 %  0,240 %  0,160 %  0,400 %  0,290 %  0,160 %	01/12/2021 31/01/2022 21/01/2022 10/12/2021 28/01/2022 12/05/2022 10/11/2022 18/11/2022 09/12/2021	1.000.004 1.000.189 1.000.196 2.000.385 1.000.021 1.900.503 999.891 999.808 629.815 890.018	0,30 0,29 0,30

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés	Fecha de vencimiento	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Certificados	de depósito – (continuación)					
Estados Unio	los – (continuación)					
	0 Standard Chartered Bank	USD	0,182 %	18/03/2022	1.000.267	0,30
	Sumitomo Mitsui Banking Corp.     Sumitomo Mitsui Trust Heldings Inc.	USD	0,200 %	25/04/2022	999.858	0,30
1.000.00	0 Sumitomo Mitsui Trust Holdings, Inc.	USD _	0,150 %	24/01/2022	1.000.066 10.619.673	0,30 3,17
TOTAL DE CE	ERTIFICADOS DE DEPÓSITO 4.883.304)				14.882.122	4,44
<del></del>	s de depósito – 0,30 %					-,
Canadá						
1.000.00	0 Bank Of Montreal	USD	0,179 %	01/12/2021	1.000.000	0,30
TOTAL DE CE (coste USD 1	ERTIFICADOS DE DEPÓSITO .000.000)				1.000.000	0,30
Efectos com	nerciales – 1,08 %					
Canadá						
784.00	0 Bank Of Nova Scotia <sup>(d)</sup>	USD	0,200 %	28/10/2022	783.422	0,23
Estados Unio		HOD	0.000.0/	04/40/0004	4 000 007	0.00
	Banco Santander     Royal Bank of Canada <sup>(d)</sup>	USD USD	0,000 % 0,200 %	01/12/2021 10/11/2022	1.999.997 836.119	0,60 0,25
030.00	o Noyal Balik di Gallada		0,200 /6	10/11/2022	2.836.116	0,25
	FECTOS COMERCIALES					
(coste USD 3					3.619.538	1,08
(coste USD 2	ERCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS 59.674.794)				270.154.651	80,66
Contratos d	e futuros – (0,07 %)					
Número de contratos	Descripción del valor			Compromiso Valor de mercado USD	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
	Descripción del valor			Valor de mercado	latente en	
contratos	<u> </u>		Larga	Valor de mercado	latente en	
contratos	AUD 7 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021		Larga	Valor de mercado USD	latente en USD	patrimonio
contratos 15	AUD 7 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021 CAD			Valor de mercado USD 15.667.243	latente en USD 116.943	patrimonio 0,04
15	AUD 7 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021		Larga Larga Larga	Valor de mercado USD	latente en USD	patrimonio
15	AUD 7 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021 CAD 8 Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022		Larga	Valor de mercado USD 15.667.243 9.761.698	116.943 213.289	0,04 0,06
15	AUD 7 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021 CAD 8 Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022		Larga	Valor de mercado USD 15.667.243 9.761.698 1.193.562	116.943 213.289 21.175	0,04 0,06 0,01
contratos  15	AUD 7 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  CAD 8 Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022 6 Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR 5 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 0		Larga Larga —	9.761.698 1.193.562 10.955.260	116.943 213.289 21.175 234.464 31.834	0,04 0,06 0,01 0,07
contratos  15	AUD 7 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  CAD 8 Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022 6 Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR		Larga Larga	Valor de mercado USD 15.667.243 9.761.698 1.193.562 10.955.260	116.943 213.289 21.175 234.464	0,04 0,06 0,01
contratos  15	AUD 7 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  CAD 8 Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022 6 Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR 5 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 0		Larga Larga —	9.761.698 1.193.562 10.955.260	116.943 213.289 21.175 234.464 31.834	0,04 0,06 0,01 0,07
contratos  15	AUD 7 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  CAD 8 Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022 6 Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR 5 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 0 2 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08  HKD		Larga Larga Larga Larga	9.761.698 1.193.562 10.955.260 1.239.916 308.676	116.943 213.289 21.175 234.464 31.834 250 32.084	0,04 0,06 0,01 0,07 0,01 0,01
contratos  15 8	AUD 7 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  CAD 8 Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022 6 Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR 5 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 0 2 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08  HKD 7 Futuros sobre el Hang Seng Index 30/12/2021		Larga Larga Larga Larga Corta	9.761.698 1.193.562 10.955.260 1.239.916 308.676 1.548.592 (1.053.973)	116.943 213.289 21.175 234.464 31.834 250 32.084	0,04 0,06 0,01 0,07 0,01 0,00 0,01
contratos  15 8	AUD 7 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  CAD 8 Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022 6 Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR 5 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 0 2 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08  HKD		Larga Larga Larga Larga	Valor de mercado USD 15.667.243 9.761.698 1.193.562 10.955.260 1.239.916 308.676 1.548.592 (1.053.973) (753.294)	116.943 213.289 21.175 234.464 31.834 250 32.084 44.070 32.464	0,04 0,06 0,01 0,07 0,01 0,01 0,01
contratos  15 8	AUD 7 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  CAD 8 Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022 6 Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR 5 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 0 2 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08  HKD 7 Futuros sobre el Hang Seng Index 30/12/2021 4) Futuros sobre el HSCEI Index 30/12/2021		Larga Larga Larga Larga Corta	9.761.698 1.193.562 10.955.260 1.239.916 308.676 1.548.592 (1.053.973)	116.943 213.289 21.175 234.464 31.834 250 32.084	0,04 0,06 0,01 0,07 0,01 0,00 0,01
15 8 (77 (144	AUD 7 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  CAD 8 Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022 6 Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR 5 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 0 2 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08  HKD 7) Futuros sobre el Hang Seng Index 30/12/2021 4) Futuros sobre el HSCEI Index 30/12/2021  KRW		Larga Larga Larga Corta Corta	Valor de mercado USD 15.667.243 9.761.698 1.193.562 10.955.260 1.239.916 308.676 1.548.592 (1.053.973) (753.294) (1.807.267)	116.943 213.289 21.175 234.464 31.834 250 32.084 44.070 32.464 76.534	0,04 0,06 0,01 0,07 0,01 0,00 0,01 0,01 0,01 0,02
15 8 (77 (144	AUD 7 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  CAD 8 Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022 6 Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR 5 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 0 2 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 0 8 HKD 7) Futuros sobre el Hang Seng Index 30/12/2021 9 Futuros sobre el HSCEI Index 30/12/2021  KRW 2) Futuros sobre el KOSPI 200 Index 09/12/2021		Larga Larga Larga Larga Corta	Valor de mercado USD 15.667.243 9.761.698 1.193.562 10.955.260 1.239.916 308.676 1.548.592 (1.053.973) (753.294)	116.943 213.289 21.175 234.464 31.834 250 32.084 44.070 32.464	0,04 0,06 0,01 0,07 0,01 0,00 0,01 0,01 0,01 0,02
15 8 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9	AUD 7 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  CAD 8 Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022 6 Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR 5 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 0 2 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08  HKD 7) Futuros sobre el Hang Seng Index 30/12/2021 4) Futuros sobre el HSCEI Index 30/12/2021  KRW 2) Futuros sobre el KOSPI 200 Index 09/12/2021  USD		Larga Larga Larga Corta Corta	15.667.243 9.761.698 1.193.562 10.955.260 1.239.916 308.676 1.548.592 (1.053.973) (753.294) (1.807.267)	116.943 213.289 21.175 234.464 31.834 250 32.084 44.070 32.464 76.534 6.672	0,04 0,06 0,01 0,07 0,01 0,01 0,01 0,02 0,00
15 8 (7 (14 (2 (2 (2 (2 (2 (2 (2 (2 (2 (2 (2 (2 (2	AUD 7 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  CAD 8 Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022 6 Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR 5 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 0 2 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08  HKD 7) Futuros sobre el Hang Seng Index 30/12/2021 9 Futuros sobre el HSCEI Index 30/12/2021  KRW 2) Futuros sobre el KOSPI 200 Index 09/12/2021  USD 7 Futuros sobre el E-Mini NASDAQ 100 Index 17/12/2021		Larga Larga Larga Corta Corta Corta Larga	Valor de mercado USD 15.667.243 9.761.698 1.193.562 10.955.260 1.239.916 308.676 1.548.592 (1.053.973) (753.294) (1.807.267) (157.147)	116.943 213.289 21.175 234.464 31.834 250 32.084 44.070 32.464 76.534 6.672	0,04 0,06 0,01 0,07 0,01 0,01 0,01 0,01 0,02 0,00
15 8 (7 (14 (2 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8	AUD 7 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  CAD 8 Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022 6 Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR 5 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 0 2 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08  HKD 7) Futuros sobre el Hang Seng Index 30/12/2021  KRW 2) Futuros sobre el HSCEI Index 30/12/2021  USD 7 Futuros sobre el E-Mini NASDAQ 100 Index 17/12/2021 0 Futuros sobre el E-Mini S&P 500 Index 17/12/2021		Larga Larga Larga Corta Corta Corta Larga Larga Larga	Valor de mercado USD 15.667.243 9.761.698 1.193.562 10.955.260 1.239.916 308.676 1.548.592 (1.053.973) (753.294) (1.807.267) (157.147) 2.298.030 18.523.000	116.943 213.289 21.175 234.464 31.834 250 32.084 44.070 32.464 76.534 6.672	0,04 0,06 0,01 0,07 0,01 0,01 0,01 0,02 0,00 0,04 0,00
15 8 (2 (2 8 4 4	AUD 7 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  CAD 8 Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022 6 Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR 5 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 0 2 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08  HKD 7) Futuros sobre el Hang Seng Index 30/12/2021 9 Futuros sobre el HSCEI Index 30/12/2021  KRW 2) Futuros sobre el KOSPI 200 Index 09/12/2021  USD 7 Futuros sobre el E-Mini NASDAQ 100 Index 17/12/2021		Larga Larga Larga Corta Corta  Corta  Larga Larga Larga Larga Larga Larga Larga Larga Larga	Valor de mercado USD  15.667.243  9.761.698 1.193.562  10.955.260  1.239.916 308.676  1.548.592  (1.053.973) (753.294)  (1.807.267)  (157.147)  2.298.030 18.523.000 9.724.575	116.943 213.289 21.175 234.464 31.834 250 32.084 44.070 32.464 76.534 6.672 119.911 237.317 233.112	0,04 0,06 0,01 0,07 0,01 0,01 0,01 0,02 0,00 0,04 0,07 0,07
15 8 (7 (14 (2 8 8 4 1 1 ) ) ) ) ) ) ) ) ) ) ) ) ) ) ) ) )	AUD 7 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  CAD 8 Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022 6 Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR 5 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 0 2 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08  HKD 7) Futuros sobre el Hang Seng Index 30/12/2021 BY Futuros sobre el HSCEI Index 30/12/2021  KRW 2) Futuros sobre el KOSPI 200 Index 09/12/2021  USD 7 Futuros sobre el E-Mini NASDAQ 100 Index 17/12/2021 0 Futuros sobre el E-Mini S&P 500 Index 17/12/2021 2 Futuros sobre el E-Mini S&P 500 Index 17/12/2021		Larga Larga Larga Corta Corta Corta Larga Larga Larga	Valor de mercado USD 15.667.243 9.761.698 1.193.562 10.955.260 1.239.916 308.676 1.548.592 (1.053.973) (753.294) (1.807.267) (157.147) 2.298.030 18.523.000	116.943 213.289 21.175 234.464 31.834 250 32.084 44.070 32.464 76.534 6.672	0,04 0,06 0,01 0,07 0,01 0,01 0,02 0,00 0,01 0,00 0,01 0,00 0,01 0,00 0,01
15 8 (7 (14 (24 1 2 4 1 2 4 1 2 4 1 2 4 1 2 4 1 1 2 4 1 1 2 4 1 1 1 2 4 1 1 1 1	AUD 7 Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021  CAD 8 Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022 6 Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR 5 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 0 2 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 0 8 HKD 7) Futuros sobre el Hang Seng Index 30/12/2021 9 Futuros sobre el HSCEI Index 30/12/2021  KRW 2) Futuros sobre el KOSPI 200 Index 09/12/2021  USD 7 Futuros sobre el E-Mini NASDAQ 100 Index 17/12/2021 0 Futuros sobre el E-Mini S&P 500 Index 17/12/2021 2 Futuros sobre el E-Mini S&P 500 Index 17/12/2021 2 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022		Larga Larga Larga Larga Corta Corta  Corta  Larga	Valor de mercado USD  15.667.243  9.761.698 1.193.562  10.955.260  1.239.916 308.676  1.548.592  (1.053.973) (753.294)  (1.807.267)  (157.147)  2.298.030 18.523.000 9.724.575 1.943.625	116.943 213.289 21.175 234.464 31.834 250 32.084 44.070 32.464 76.534 6.672 119.911 237.317 233.112 47.321	0,04 0,06 0,01 0,07 0,01 0,01 0,01

#### Contratos de futuros – (continuación)

Número de contratos	Descripción del valor		Compromiso Valor de mercado USD	Plusvalía latente en USD	% de patrimonio
	USD – (continuación)				
	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022	Larga	10.986.250	229.570	0,07
35	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022	Larga	6.991.250	203.358	0,06
			86.248.113	1.521.337	0,45
PLUSVALÍA LA	TENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS			1.988.034	0,59
			Compromiso	Minusvalía	
Número de contratos	Descripción del valor		Valor de mercado USD	latente en USD	% de patrimonio
	CAD				
(37)	Futuros sobre letras de aceptación del Banco de Canadá 19/09/2022	Corta	(7.134.079)	(14.763)	(0,01
-	EUR				
(27)	Futuros sobre el EURIBOR a 3 meses 13/03/2023	Corta	(7.703.917)	(8.762)	(0,00
, ,	Futuros sobre el EURIBOR a 3 meses 18/12/2023	Corta	(8.260.553)	(9.822)	(0,00
, ,	Futuros sobre el Amsterdam Index 17/12/2021	Larga	713.432	(36.402)	(0,01
	Futuros sobre el CAC 40 Index 17/12/2021	Larga	996.837	(58.747)	(0,02
	Futuros sobre el DAX Index 17/12/2021	Larga	1.730.443	(95.698)	(0,02
	Futuros sobre el E-mini FTSE MIB Index 17/12/2021	Larga	737.327	(13.854)	(0,00
		-			
, ,	Futuros sobre Euro BTP Bonos del Estado de Italia 08/12/2021	Corta	(345.907)	(1.172)	(0,00
	Futuros sobre el Euro STOXX 50 Index 17/12/2021	Larga	2.232.463	(93.522)	(0,03
	EURO STOXX Banks Index 17/12/2021	Larga	3.447.559	(18.348)	(0,00
, ,	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años 08/12/2021	Corta	(33.377.140)	(490.501)	(0,15
3	Futuros sobre el IBEX 35 Index 17/12/2021	Larga	284.963	(21.522)	(0,01)
			(39.544.493)	(848.350)	(0,25)
	GBP				
(40)	Futuros en libras esterlinas a 90 días 15/06/2022	Corta	(6.622.304)	(11.712)	(0,01
(45)	Futuros en libras esterlinas a 90 días 15/03/2023	Corta	(7.422.664)	(7.093)	(0,00
(44)	Futuros en libras esterlinas a 90 días 20/12/2023	Corta	(7.252.572)	(2.266)	(0,00
11	Futuros sobre el FTSE 100 Index 17/12/2021	Larga	1.040.070	(10.284)	(0,00
(24)	Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022	Corta	(4.063.639)	(77.312)	(0,02
			(24.321.109)	(108.667)	(0,03
	JPY				
, ,	Futuros sobre bonos del Estado de Japón a 10 años 13/12/2021	Corta	(14.850.000)	(23.568)	(0,01)
6	Futuros sobre el TOPIX Index 09/12/2021	Larga	1.010.302	(79.498)	(0,02)
			(13.839.698)	(103.066)	(0,03)
	SEK				
27	Futuros sobre el OMX Stockholm 30 Index 17/12/2021	Larga	679.065	(34.482)	(0,01)
	тнв				
104	Futuros sobre el SET50 Index 29/12/2021	Larga	573.617	(31.499)	(0,01)
	USD				
(36)	Futuros en eurodólares a 90 días 13/06/2022	Corta	(8.966.250)	(6.856)	(0,00
, ,	Futuros en eurodólares a 90 días 13/03/2023	Corta	(22.273.875)	(15.343)	(0,01
` ,	Futuros en eurodólares a 90 días 18/12/2023	Corta	(17.242.750)	(7.859)	(0,00
, ,	Futuros sobre el CBOE Volatility Index 22/12/2021	Corta	(983.220)	(14.820)	(0,00
, ,	Futuros sobre el CBOE Volatility Index 19/01/2022	Corta	, ,	(90.290)	(0,03
	Futuros sobre el CBOE Volatility Index 19/01/2022  Futuros sobre el CBOE Volatility Index 16/02/2022	Corta	(1.160.900) (1.191.920)	(94.770)	(0,03
, ,	Futuros sobre el E-Mini S&P MidCap 400 Index 17/12/2021				
	•	Larga	826.200 556 175	(8.710)	(0,00
	Futuros sobre el Mini-Russell 2000 Index 17/12/2021	Larga	556.175 7.537.500	(28.641)	(0,01
	Futures sobre el MSCI EAFE Index 17/12/2021	Larga	7.537.500	(364.700)	(0,11
	Futuros sobre el S&P 500 E-mini Healthcare Index 17/12/2021	Larga	2.648.000	(31.100)	(0,01
` ,	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022	Corta	(323.938)	(1.812)	(0,00
` ,	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022	Corta	(12.713.062)	(171.906)	(0,05
	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022	Corta	(3.538.687)	(55.581)	(0,02
(86)	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022	Corta	(10.465.797)	(109.213)	(0,03
(27)	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022	Corta	(3.968.578)	(80.960)	(0,02
` ,					
			(71.261.102)	(1.082.561)	(0,32

Contratos de	divisas a	a plazo –	(0,04 %)
--------------	-----------	-----------	----------

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
USD	1.127.786	AUD	1.530.000	15/12/2021	31.857	0,01
USD	1.759.076	CAD	2.220.000	15/12/2021	20.375	0,01
USD	1.566.651	CHF	1.430.000	15/12/2021	4.737	0,00
USD	424.611	DKK	2.660.000	15/12/2021	17.465	0,01
USD	5.259.473	EUR	4.430.000	15/12/2021	216.551	0,06
USD	2.268.142	GBP	1.645.000	15/12/2021	70.061	0,02
USD	491.309	HKD	3.820.000	15/12/2021	1.282	0,00
USD	3.610.342	JPY	397.000.000	15/12/2021	83.880	0,03
USD	97.882	NOK	850.000	15/12/2021	3.938	0,00
USD	42.378	NZD	60.000	15/12/2021	1.353	0,00
USD	610.577	SEK	5.250.000	15/12/2021	28.017	0,01
USD	171.070	SGD	230.000	15/12/2021	2.427	0,00
CHF	660.000	USD	714.063	23/12/2021	7.133	0,00
EUR	660.000	USD	744.081	23/12/2021	7.553	0,00
JPY	186.110.000	USD	1.636.606	23/12/2021	16.945	0,01
USD	1.581.420	AUD	2.200.000	23/12/2021	5.345	0,00
USD	2.575.916	GBP	1.920.000	23/12/2021	9.709	0,00
USD	1.998.765	THB	65.570.000	23/12/2021	52.750	0,01
PHP	7.530.000	USD	148.156	29/12/2021	1.058	0,00
USD	1.200.551	CLP	1.004.260.000	29/12/2021	1.960	0,00
USD	652.182	PEN	2.630.000	29/12/2021	4.550	0,00
USD	938.094	PHP	47.340.000	29/12/2021	11	0,00
PLUSVALÍA LAT	TENTE SOBRE CONTRA	TOS DE DIVISAS	A PLAZO		588.957	0,17

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% del patrimonio
PHP	87.460.000	USD	1.740.305	01/12/2021	(4.471)	(0,00)
USD	1.716.037	PHP	87.460.000	01/12/2021	(19.797)	(0,01)
USD	62.459	ILS	200.000	15/12/2021	(1.153)	(0,00)
CAD	4.360.000	USD	3.452.421	23/12/2021	(37.211)	(0,01)
ILS	6.630.000	USD	2.143.507	23/12/2021	(33.707)	(0,01)
MXN	42.560.000	USD	2.040.186	23/12/2021	(52.637)	(0,02)
NOK	22.200.000	USD	2.506.225	23/12/2021	(52.680)	(0,02)
NZD	550.000	USD	385.488	23/12/2021	(9.455)	(0,00)
SEK	15.750.000	USD	1.768.877	23/12/2021	(20.343)	(0,01)
USD	1.008.704	CAD	1.290.000	23/12/2021	(1.760)	(0,00)
USD	10.397.698	CHF	9.640.000	23/12/2021	(136.140)	(0,04)
USD	1.295.609	CZK	29.380.000	23/12/2021	(12.645)	(0,00)
USD	9.874.348	EUR	8.730.000	23/12/2021	(67.721)	(0,02)
USD	2.201.802	HUF	716.410.000	23/12/2021	(25.591)	(0,01)
USD	780.093	ILS	2.470.000	23/12/2021	(5.911)	(0,00)
USD	8.747.950	JPY	997.030.000	23/12/2021	(110.468)	(0,04)
USD	1.007.576	NZD	1.480.000	23/12/2021	(4.295)	(0,00)
USD	2.449.809	PLN	10.160.000	23/12/2021	(21.379)	(0,00)
ZAR	7.720.000	USD	490.356	23/12/2021	(7.696)	(0,00)
BRL	4.650.000	USD	833.508	29/12/2021	(7.954)	(0,00)
IDR	43.026.690.000	USD	2.999.121	29/12/2021	(4.551)	(0,00)
INR	260.560.000	USD	3.486.050	29/12/2021	(22.143)	(0,01)
RUB	247.660.000	USD	3.346.291	29/12/2021	(25.874)	(0,01)
USD	3.705.080	KRW	4.415.410.000	29/12/2021	(18.447)	(0,00)
USD	1.360.785	TWD	37.810.000	29/12/2021	(8.363)	(0,00)
MINUSVALÍA	LATENTE SOBRE CONTR	ATOS DE D	IVISAS A PLAZO		(712.392)	(0,21)

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones – (2,56 %)

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Minusvalia latente USD	% del patrimonio
EUR	41.312.000	USD	49.044.013	15/12/2021	(2.016.203)	(0,60)
GBP	156.669.000	USD	214.537.172	15/12/2021	(5.193.004)	(1,55)
JPY	6.465.794.000	USD	58.800.317	15/12/2021	(1.366.117)	(0,41)
SEK	819.000	USD	95.224	15/12/2021	(4.345)	(0,00)
MINUSVALÍA L	NUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA				(8.579.669)	(2,56)

0	pci	on	es	- 0	,29	%

Tenencias	Descripción del valor			Plusvalia/ (minusvalia) latente USD	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	Opciones adquiridas					
	AUD					
4.762.000	Put AUD / Call USD	Vence 14/11/2022	Precio de ejercicio 0,67	17.437	65.762	0,02
11 620 000	CHF	Venne 10/11/2022	Dropio do piereinio 40 40	124 720	262.602	0.00
11.630.000	Call CHF / Put SEK	Vence 10/11/2022	Precio de ejercicio 10,18	124.729	262.602	0,08
660.000	EUR Put EUR / Call USD	Vence 07/03/2023	Precio de ejercicio 1,19	13.126	37.147	0,01
	GBP	701100 01700/2020			07.1.11	
158	Call FTSE 100 Index	Vence 18/03/2022	Precio de ejercicio 7.579,65	(13.222)	9.791	0,00
	JPY		•			
1.044.338.000		Vence 11/11/2022	Precio de ejercicio 11,63	41.776	170.646	0,05
6.617	Call NIKKEI 225 Index	Vence 30/12/2021	Precio de ejercicio 28.465,53	(16.226)	25.596	0,01
10.422	Call NIKKEI 225 Index	Vence 30/12/2021	Precio de ejercicio 28.671,14	(23.758)	32.952	0,01
10.422	Put NIKKEI 225 Index	Vence 30/12/2021	Precio de ejercicio 23.708,82	3.891	9.380	0,00
				5.683	238.574	0,07
0.044.000	NZD		5	44 700	101.070	2.24
9.814.000	Put NZD / Call USD	Vence 11/11/2022	Precio de ejercicio 0,64	41.730	134.273	0,04
2.000.000	USD	Vence 24/11/2021	Dragio de cierciaio 2.07	(64.700)	109.132	0,03
820.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses Call Futuros en eurodólares a 90 días	Vence 19/12/2022	Precio de ejercicio 2,07 Precio de ejercicio 99,00	(61.788) (154.718)	311.600	0,03
130.000	Call Futuros en eurodólares a 90 días	Vence 13/03/2023	Precio de ejercicio 93,00  Precio de ejercicio 97,75	(63.817)	165.100	0,09
140.000	Call Futuros en eurodólares a 90 días	Vence 19/06/2023	Precio de ejercicio 97,75	(72.842)	155.400	0,05
39.000	Call CBOE Volatility Index	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 26,00	(39.993)	103.350	0,03
47.000	Call CBOE Volatility Index	Vence 19/01/2022	Precio de ejercicio 25,00	43.252	197.400	0,06
47.000	Call CBOE Volatility Index	Vence 16/02/2022	Precio de ejercicio 26,00	55.500	218.550	0,07
1.234	Call Russell 2000 Index	Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 2.353,48	(33.036)	23.481	0,01
11.279.000	Call USD / Put CAD	Vence 09/11/2022	Precio de ejercicio 1,34	68.746	163.489	0,05
780.000	Call USD / Put CHF	Vence 07/03/2023	Precio de ejercicio 0,93	(9.840)	13.779	0,00
780.000	Call USD / Put JPY	Vence 07/03/2023	Precio de ejercicio 108,20	14.836	41.026	0,01
1.700.000	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 08/02/2022	Precio de ejercicio 1,80	(222.424)	36.076 1.538.383	0,01
	OLONIES ADOLUBIDAS			(222.424)	1.000.000	0,40
(coste USD 2.3	CIONES ADQUIRIDAS 319.474)				2.286.532	0,68
	Opciones suscritas GBP					
(158)	Put FTSE 100 Index	Vence 18/03/2022	Precio de ejercicio 6.135,90	7.020	(18.361)	(0,01)
	JPY		•			
(10.422)	Put NIKKEI 225 Index	Vence 30/12/2021	Precio de ejercicio 23.708,82	25.801	(9.380)	(0,00)
	USD					
(2.000.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 24/11/2021	Precio de ejercicio 2,07	25.050	(109.350)	(0,03)
(2.400.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 18/01/2022	Precio de ejercicio 2,00	(67.132)	(220.012)	(0,07)
(1.700.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 08/02/2022	Precio de ejercicio 1,45	(29.499)	(29.499)	(0,01)
(3.200.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 19/05/2022	Precio de ejercicio 1,76	(43.746)	(213.666)	(0,06)
(200)	Call S&P 500 Index	Vence 30/11/2021 Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 4.475,00	(2.060)	(31.870)	(0,01)
(200) (300)	Call S&P 500 Index Call S&P 500 Index	Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 4.485,00 Precio de ejercicio 4.510,00	(24.220) (4.538)	(29.940) (37.395)	(0,01) (0,01)
(200)	Call S&P 500 Index	Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 4.510,00  Precio de ejercicio 4.525,00	(10.300)	(21.970)	(0,01)
(100)	Call S&P 500 Index	Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 4.600,00	1.019	(3.715)	(0,00)
(100)	Call S&P 500 Index	Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 4.620,00	928	(2.160)	(0,00)
(700)	Call S&P 500 Index	Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 4.675,00	19.991	(717)	(0,00)
(700)	Call S&P 500 Index	Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 4.680,00	20.705	(490)	(0,00)
(700)	Call S&P 500 Index	Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 4.685,00	17.580	(350)	(0,00)
(700)	Call S&P 500 Index	Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 4.690,00	16.309	(245)	(0,00)
(700)	Call S&P 500 Index	Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 4.695,00	15.155	(157)	(0,00)
(800)	Call S&P 500 Index	Vence 01/12/2021	Precio de ejercicio 4.710,00	16.647	(960)	(0,00)
(800) (800)	Call S&P 500 Index Call S&P 500 Index	Vence 08/12/2021 Vence 15/12/2021	Precio de ejercicio 4.770,00 Precio de ejercicio 4.790,00	15.345 12.176	(1.740)	(0,00)
(800)	Call S&P 500 Index	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 4.790,00  Precio de ejercicio 4.790,00	8.198	(4.680) (10.120)	(0,00) (0,00)
(100)	Call S&P 500 Index	Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 4.790,00  Precio de ejercicio 4.520,00	(13.575)	(17.945)	(0,00)
(200)	Call S&P 500 Index	Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 4.670,00	2.317	(15.080)	(0,01)
(200)	Call S&P 500 Index	Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 4.715,00	(2.989)	(10.210)	(0,00)
(200)	Call S&P 500 Index	Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 4.765,00	150	(5.990)	(0,00)
(100)	Call S&P 500 Index	Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 4.805,00	950	(1.820)	(0,00)

Tenencias	Descripción del valor				Plusvalía/ (minusvalía) latente USD	Valor de mercado en USD	% de patrimoni
	Opciones suscritas – (continuación)						
(200)	USD – (continuación) Call S&P 500 Index	Vence 31/12/2021	Drooio do o	ejercicio 4.815,00	4.106	(3.190)	(0,00
, ,	Call S&P 500 Index	Vence 31/12/2021		ejercicio 4.810,00	1.237	(3.190)	(0,0)
, ,	Call S&P 500 Index	Vence 31/01/2022		ejercicio 4.860,00	1.820	(6.300)	(0,0)
, ,	Call S&P 500 Index	Vence 31/01/2022		ejercicio 4.865,00	1.255	(3.025)	(0,0)
, ,	Call S&P 500 Index	Vence 31/01/2022		ejercicio 4.870,00	1.095	(2.895)	(0,0)
, ,	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 08/02/2022		ejercicio 2,10	(10.573)	(10.573)	(0,0)
. ,	Put Health Care Select Sector Index	Vence 30/12/2022		ejercicio 1.286,61	(25.776)	(187.355)	(0,0
, ,	Put Russell 2000 Index	Vence 31/12/2021		ejercicio 2.066,47	(10.682)	(37.166)	(0,0
, ,	Put S&P 500 Index	Vence 30/11/2021		ejercicio 4.165,00	14.795	(5)	(0,0
. ,	Put S&P 500 Index	Vence 30/11/2021		ejercicio 4.180,00	16.027	(8)	(0,0)
, ,	Put S&P 500 Index	Vence 30/11/2021		ejercicio 4.185,00	12.055	(5)	(0,0)
. ,	Put S&P 500 Index	Vence 30/11/2021		ejercicio 4.210,00	6.657	(5)	(0,0
, ,	Put S&P 500 Index	Vence 30/11/2021		ejercicio 4.275,00	8.258	(3)	(0,0)
, ,	Put S&P 500 Index	Vence 30/11/2021		ejercicio 4.360,00	9.313	(3)	(0,0)
. ,	Put S&P 500 Index	Vence 30/11/2021		ejercicio 4.425,00	4.570	(8)	(0,0)
, ,		Vence 30/11/2021		•	27.777	. ,	
, ,	Put S&P 500 Index Put S&P 500 Index			ejercicio 4.500,00		(87)	(0,0
( /	Put S&P 500 Index Put S&P 500 Index	Vence 30/11/2021 Vence 30/11/2021		ejercicio 4.505,00	28.340	(70)	(0,0)
. ,				ejercicio 4.510,00	28.817	(87)	(0,0)
, ,	Put S&P 500 Index	Vence 30/11/2021		ejercicio 4.515,00	29.743	(87)	(0,0)
, ,	Put S&P 500 Index	Vence 30/11/2021		ejercicio 4.520,00	30.313	(105)	(0,0
	Put S&P 500 Index	Vence 01/12/2021		ejercicio 4.550,00	26.231	(3.760)	(0,0
, ,	Put S&P 500 Index	Vence 08/12/2021		ejercicio 4.600,00	1.211	(31.880)	(0,0
()	Put S&P 500 Index	Vence 15/12/2021		ejercicio 4.620,00	(18.266)	(52.640)	(0,0
, ,	Put S&P 500 Index	Vence 22/12/2021		ejercicio 4.600,00	(15.149)	(59.480)	(0,0
, ,	Put S&P 500 Index	Vence 31/12/2021		ejercicio 4.165,00	6.695	(2.245)	(0,0
(200)	Put S&P 500 Index	Vence 31/12/2021	Precio de e	ejercicio 4.380,00	960	(8.560)	(0,0
(200)	Put S&P 500 Index	Vence 31/12/2021	Precio de e	ejercicio 4.440,00	4.594	(10.380)	(0,00
(200)	Put S&P 500 Index	Vence 31/12/2021	Precio de e	ejercicio 4.505,00	1.234	(12.850)	(0,0
(200)	Put S&P 500 Index	Vence 31/12/2021	Precio de e	ejercicio 4.565,00	(4.761)	(15.700)	(0,0
(100)	Put S&P 500 Index	Vence 31/12/2021	Precio de e	ejercicio 4.585,00	(2.020)	(8.410)	(0,00
(100)	Put S&P 500 Index	Vence 31/12/2021	Precio de e	ejercicio 4.595,00	(2.715)	(8.705)	(0,00
(100)	Put S&P 500 Index	Vence 31/01/2022	Precio de e	ejercicio 4.530,00	(1.610)	(10.960)	(0,00
(200)	Put S&P 500 Index	Vence 31/01/2022	Precio de e	ejercicio 4.540,00	(4.482)	(22.450)	(0,0
(100)	Put S&P 500 Index	Vence 31/01/2022	Precio de e	ejercicio 4.555,00	(3.097)	(11.630)	(0,00
					142.433	(1.282.193)	(0,38
OTAL DE OPC	CIONES SUSCRITAS 485.188))					(1.309.934)	(0,39
OTAL DE OPO						070 500	
coste USD 83						976.598	0,2
Jonitratos de	permutas financieras – (0,12 %)					Plusvalía	
mporte teórico ocal neto	A pagar	A recibir		Divisa	Fecha de vencimiento	latente en USD	% d patrimon
	Permutas de incumplimiento crediticio	(CDS)					
1.978.	000 Variable (The Markit CDX North America						
	High Yield 34 Version 1 Index)	Fijo 5,000 %		USD	20/06/2025	56.468	0,0
2.675.	000 Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 34 Index)	Fijo 1,000 %		USD	20/06/2025	16.937	0,0
	ATENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIN	IIENTO CREDITICIO (CDS)				73.405	0,0
LUSVALÍA LA							
PLUSVALÍA LA	Permutas de rendimiento total		FUD)	EUR	19/09/2022	893.813	0,2
		Variable (LIBOR a 1	mes en EUR)				0,0
14.439.	Permutas de rendimiento total 888 Variable (EURO STOXX Index) 439 Variable (FTSE 100 Total Return Index)	Variable (LIBOR a 1 Variable (SONIA a 1	,	GBP	08/11/2022	117.911	
14.439. 2.519.	888 Variable (EURO STOXX Index)	,	mes en GBP)	GBP JPY	08/11/2022 31/01/2022	117.911 1.452.645	
14.439. 2.519. 2.802.757.	888 Variable (EURO STOXX Index) 439 Variable (FTSE 100 Total Return Index) 510 Variable (TOPIX Index)	Variable (SONIA a 1 Variable (LIBOR a 1	mes en GBP) mes en JPY)	JPY	31/01/2022		0,4
14.439. 2.519. 2.802.757. 31.695.	888 Variable (EURO STOXX Index) 439 Variable (FTSE 100 Total Return Index) 510 Variable (TOPIX Index) 790 Variable (Russell 1000 Total Return Index	Variable (SONIA a 1 Variable (LIBOR a 1 Variable (LIBOR a 1	mes en GBP) mes en JPY) mes en USD)		31/01/2022 02/12/2021	1.452.645 480.374	0,4 0,1
14.439. 2.519. 2.802.757. 31.695. 8.030.	888 Variable (EURO STOXX Index) 439 Variable (FTSE 100 Total Return Index) 510 Variable (TOPIX Index) 790 Variable (Russell 1000 Total Return Index) 691 Variable (S&P 500 Total Return Index)	Variable (SONIA a 1 Variable (LIBOR a 1 Variable (LIBOR a 1 Variable (LIBOR a 1	mes en GBP) mes en JPY) mes en USD) mes en USD)	JPY USD	31/01/2022	1.452.645	0,4 0,1
14.439. 2.519. 2.802.757. 31.695. 8.030. 1.202	888 Variable (EURO STOXX Index) 439 Variable (FTSE 100 Total Return Index) 510 Variable (TOPIX Index) 790 Variable (Russell 1000 Total Return Index) 691 Variable (S&P 500 Total Return Index) .1111 Variable (Alerian MLP Infrastructure Inde	Variable (SONIA a 1 Variable (LIBOR a 1 Variable (LIBOR a 1 Variable (LIBOR a 1 Variable (LIBOR a 3 Variable (LIBOR a 3 V)	mes en GBP) mes en JPY) mes en USD) mes en USD) meses en	JPY USD	31/01/2022 02/12/2021	1.452.645 480.374	0,4 0,1 0,0
14.439. 2.519. 2.802.757. 31.695. 8.030.	888 Variable (EURO STOXX Index) 439 Variable (FTSE 100 Total Return Index) 510 Variable (TOPIX Index) 790 Variable (Russell 1000 Total Return Index) 691 Variable (S&P 500 Total Return Index) .1111 Variable (Alerian MLP Infrastructure Inde	Variable (SONIA a 1 Variable (LIBOR a 1 Variable (LIBOR a 1 Variable (LIBOR a 1 Variable (LIBOR a 3 Variable (LIBOR a 3 VSD) Variable (LIBOR a 3	mes en GBP) mes en JPY) mes en USD) mes en USD) meses en	JPY USD USD	31/01/2022 02/12/2021 02/12/2021	1.452.645 480.374 82.111	0,4 0,1 0,0 0,0
14.439. 2.519. 2.802.757. 31.695. 8.030. 1.202	888 Variable (EURO STOXX Index) 439 Variable (FTSE 100 Total Return Index) 510 Variable (TOPIX Index) 790 Variable (Russell 1000 Total Return Index) 691 Variable (S&P 500 Total Return Index) .111 Variable (Alerian MLP Infrastructure Inde 064	Variable (SONIA a 1 Variable (LIBOR a 1 Variable (LIBOR a 1 Variable (LIBOR a 1 Variable (LIBOR a 3 Variable (LIBOR a 3 VSD) Variable (LIBOR a 3 USD)	mes en GBP) mes en JPY) mes en USD) mes en USD) meses en	JPY USD USD	31/01/2022 02/12/2021 02/12/2021 04/04/2022	1.452.645 480.374 82.111 29.369	0,4 0,1 0,0 0,0

Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente en USD	% de
						<b>P</b>
1.300.000	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1 Index)	Fijo 5,000 %	EUR	20/12/2026	(25.832)	(0,01
3.000.000	Variable (iTraxx Europe Series 36 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	EUR	20/12/2026	(12.353)	(0,00
9.325.000	Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 36 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2026	(1.343)	(0,00
1.700.000	Variable (The Markit CDX North America High Yield 37 Version 1 Index)	Fijo 5,000 %	USD	20/12/2026	(16.416)	(0,01
475.000	Variable (The Markit CDX North America High Yield 37 Version 1 Index)	Fijo 5,000 %	USD	20/12/2026	(5.129)	(0,00
4.100.000	Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(6.886)	(0,00
MINUSVALÍA LATE	ENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMIENTO	CREDITICIO (CDS)			nto USD  26 (25.832) 26 (12.353) 26 (13.43) 26 (16.416) 26 (5.129) 26 (6.886)  (67.959) 22 (720.356) 22 (113.619) 22 (15.88.888) 21 (954.552) 22 (118.807) (3.496.222) (3.564.181)  261.791.246  73.139.183 334.930.429  Valor de mercado en USD  270.154.651 1.988.034 (2.223.388)	(0,02
	Permutas de rendimiento total					
117.510	Variable (LIBOR a 1 mes en EUR)	Variable (JPGSFDEU Index)	EUR	19/09/2022	(720.356)	(0,22
25.005	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	Variable (JPGSFDUK Index)	GBP	08/11/2022	(113.619)	(0,03
209.913	Variable (LIBOR a 1 mes en JPY)	Variable (MLGSFDJP Index)	JPY	31/01/2022	(1.588.888)	(0,47
267.389	Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Variable (MLGSFDUS Index)	USD	02/12/2021	(954.552)	(0,28
2.318	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	Variable (Alerian MLP Infrastructure Index)	USD	04/04/2022	(118.807)	(0,04
MINUSVALÍA LATE	ENTE SOBRE PERMUTAS DE RENDIMIENTO TOT	TAL .			(3.496.222)	(1,04
TOTAL DE MINUS	VALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE PERMI	UTAS FINANCIERAS			(3.564.181)	(1,06
VALOR DE MERCA (coste USD 260.50	ADO DE LAS INVERSIONES 9.080)				261.791.246	78,16
OTROS ACTIVOS	Y PASIVOS				73.139.183	21,84
PATRIMONIO					334.930.429	100,00
				Val	or de mercado	
				va.		% de
TOTAL DE INVERS	SIONES				USD	patrimonio
Total inversiones ex	(cluyendo derivados (coste USD 259.674.794)				270.154.651	80,66
	bre contratos de futuros				1.988.034	0,59
	sobre contratos de futuros					(0,66
Minusvalía latente s					,	0.17
	bre contratos de divisas a plazo				588.957	
Plusvalía latente so	bre contratos de divisas a plazo					- ,
Plusvalía latente so Minusvalía latente s	sobre contratos de divisas a plazo	nes de cohertura			(712.392)	(0,21
Plusvalía latente so Minusvalía latente s Minusvalía latente s	sobre contratos de divisas a plazo sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fir	nes de cobertura			(712.392) (8.579.669)	(0,21 (2,56
Plusvalía latente so Minusvalía latente s Minusvalía latente s Valor de mercado d	sobre contratos de divisas a plazo sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fir le opciones compradas (coste USD 2.319.474)	nes de cobertura			(712.392) (8.579.669) 2.286.532	(0,21 (2,56 0,6
Plusvalía latente so Minusvalía latente s Minusvalía latente s Valor de mercado d Valor de mercado d	sobre contratos de divisas a plazo sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fir le opciones compradas (coste USD 2.319.474) le opciones suscritas (coste USD (1.485.188))	nes de cobertura			(712.392) (8.579.669) 2.286.532 (1.309.934)	(0,21 (2,56 0,6 (0,39
Plusvalía latente so Minusvalía latente s Minusvalía latente s Valor de mercado d Valor de mercado d Plusvalía latente so	sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fir le opciones compradas (coste USD 2.319.474) le opciones suscritas (coste USD (1.485.188)) libre contratos de permutas financieras	nes de cobertura			(712.392) (8.579.669) 2.286.532 (1.309.934) 3.162.636	(0,21 (2,56 0,66 (0,39 0,94
Plusvalía latente so Minusvalía latente s Minusvalía latente s Valor de mercado d Valor de mercado d Plusvalía latente so	sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fir de opciones compradas (coste USD 2.319.474) le opciones suscritas (coste USD (1.485.188)) libre contratos de permutas financieras sobre contratos de permutas financieras	nes de cobertura			(712.392) (8.579.669) 2.286.532 (1.309.934)	(0,21 (2,56 0,68 (0,39 0,94 (1,06

Los Comisionistas de futuros fueron Credit Suisse Securities (USA) LLC, Morgan Stanley & Co., Inc. y Newedge Group.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron BNP Paribas S.A. y Morgan Stanley & Co., Inc.

Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., Credit Suisse Securities (USA) LLC., Deutsche Bank AG, Morgan Stanley Capital Services., Inc, Morgan Stanley & Co. International Plc. y Morgan Stanley & Co., Inc.

Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Merrill Lynch International y Morgan Stanley.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,60 %.

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (d) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (e) Los tífulos se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional)).
- (f) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- (g) La valoración de este valor la realiza el Tasador. Consulte la Nota 4.

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - 62,42	iarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial %					
200 000	Banco do Brasil S.A. <sup>(c)</sup>	USD	9,000 %	Perp.	210.774	0,04
	Banco do Brasil S.A. <sup>(c)</sup>	USD	6,250 %	Perp.	192.490	0,04
200.000	Ballo do Brasil G.A.	OOD	0,230 /0	T CIP.	403.264	0,03
Islas Vírgenes	Británicas Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	4,625 %	03/06/2026	203.000	0,03
	Truatong Finance in Co., Etc.		4,023 /0	03/00/2020	203.000	0,03
Islas Caimán	Deide Inc	HOD	0.405.0/	07/04/0000	400 404	0.07
	Baidu, Inc. SA Global Sukuk Ltd.	USD	3,425 % 2,694 %	07/04/2030 17/06/2031	423.164 872.175	0,07 0,15
	Tencent Holdings Ltd.	USD	3,595 %	19/01/2028	300.017	0,15
	•	USD	2,880 %	22/04/2031	398.147	0,03
390.000	Tencent Holdings Ltd.	03D	2,000 70	22/04/2031	1.993.503	0,07
Colombia					1.993.303	0,34
	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	3,125 %	15/04/2031	233.867	0,04
República Dom	inicana					
150.000	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	4,500 %	30/01/2030	149.595	0,03
280.000	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	5,875 %	30/01/2060	261.713	0,04
					411.308	0,07
Egipto						
640.000	Bonos internacionales del Estado de Egipto	USD	8,875 %	29/05/2050	555.200	0,10
Finlandia						
50.000	Nokia OYJ	USD	3,375 %	12/06/2022	50.625	0,01
Francia						
200.000	Altice France S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,500 %	15/01/2028	197.250	0,03
250.000	Société Générale S.A.(c)	USD	6,750 %	Perp.	273.906	0,05
					471.156	0,08
Alemania						
400.000	Commerzbank AG <sup>(c)</sup>	EUR	6,125 %	Perp.	492.120	0,08
800.000	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	EUR	4,625 %	Perp.	911.901	0,16
					1.404.021	0,24
Indonesia						
200.000	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	3,050 %	12/03/2051	193.000	0,03
Irlanda	AarCan Iroland Canital DAC Via AarCan Clobal Aviation Trust	USD	6 500 %	15/07/2025	486.396	0,08
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust AIB Group Plc. <sup>(c)</sup>	EUR	6,500 % 6,250 %	15/07/2025 Perp.	556.318	0,08
430.000	Alb Gloup Fig. 97	LOIX	0,230 /6	r eip.	1.042.714	0,10
Isla de Man					1.042.714	0,10
	Sasol Financing International Ltd.	USD	4,500 %	14/11/2022	406.000	0,07
Israel						
20.775.000	Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 412	ILS	(0,140 %)	06/04/2022	6.605.004	1,13
22.850.000	Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 622	ILS	(0,120 %)	08/06/2022	7.264.709	1,24
300.000	Bonos internacionales del Estado de Israel	USD	3,800 %	13/05/2060	342.988	0,06
					14.212.701	2,43
Italia	Next On A	EUD	0.405.0/	00/04/0000	400 700	0.00
	Nexi SpA	EUR	2,125 %	30/04/2029	138.729	0,02
Costa de Marfil	Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	EUR	4,875 %	30/01/2032	106.741	0,02
	Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	USD	6,125 %	15/06/2033	359.237	0,02
330.000	Solido internacionales del Estado de Costa de Maliii	000	0,123 70	13/00/2033	465.978	0,08
 Japón		-			403.910	
	Depósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028	JPY	(0,147 %)	11/04/2022	111.838.106	19,12
	Depósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1033	JPY	(0,158 %)	31/01/2022	12.017.898	2,05
					123.856.004	21,17
						= -,

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos – (conti Jersey	inuación)					
200.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,625 %	31/03/2036	195.500	0,03
300.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,940 %	30/09/2040	297.375	0,05
					492.875	0,08
Luxemburgo						
100.000	ARD Finance S.A.	EUR	5,000 %	30/06/2027	115.852	0,02
	ARD Finance S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	6,500 %	30/06/2027	362.250	0,06
460.000	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.	USD	5,150 %	11/02/2026	500.250	0,09
					978.352	0,17
México	) Banco Mercantil del Norte S.A. (c)	1100	5.075.0/	D	400 474	0.00
	Cemex SAB de CV	USD USD	5,875 % 5,200 %	Perp. 17/09/2030	196.474 210.765	0,03 0,04
	Mexico City Airport Trust	USD	5,500 %	31/07/2047	193.200	0,04
	Mexico City Airport Trust 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,500 %	31/07/2047	270.480	0,05
	, .		-		870.919	0,15
Países Bajos						-, -
•	ABN AMRO Bank NV <sup>(c)</sup>	EUR	4,375 %	Perp.	599.027	0,10
155.000	AerCap Holdings NV <sup>(c)</sup>	USD	5,875 %	10/10/2079	162.011	0,03
400.000	Lukoil Securities BV	USD	3,875 %	06/05/2030	410.300	0,07
240.000	Prosus NV	USD	3,680 %	21/01/2030	244.911	0,04
	Prosus NV	USD	3,832 %	08/02/2051	180.656	0,03
160.000	Ziggo Bond Co. BV	EUR	3,375 %	28/02/2030	177.412	0,03
					1.774.317	0,30
Nigeria			/			
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	6,500 %	28/11/2027	331.925	0,06
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD USD	6,125 %	28/09/2028	621.633	0,11
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria     Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	7,375 % 7,696 %	28/09/2033 23/02/2038	493.425 178.250	0,08 0,03
200.000	Donot internationales del Estado de Nigeria	005	1,000 70	20/02/2000	1.625.233	0,28
Catar					1.020.200	0,20
	Qatar Energy	USD	2,250 %	12/07/2031	197.500	0,03
	Qatar Energy	USD	3,125 %	12/07/2041	291.305	0,05
270.000	Qatar Energy	USD	3,300 %	12/07/2051	277.256	0,05
560.000	Bonos internacionales del Estado de Catar	USD	3,375 %	14/03/2024	588.840	0,10
					1.354.901	0,23
Rumanía			/			
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,875 %	11/03/2029	72.282	0,01
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía     Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR USD	3,624 % 3,000 %	26/05/2030 14/02/2031	333.257 128.375	0,06 0,02
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía     Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,000 %	28/01/2032	73.975	0,02
	) Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	3,375 %	28/01/2050	96.070	0,01
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	USD	4,000 %	14/02/2051	214.637	0,04
					918.596	0,16
Sudáfrica						
200.000	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	4,300 %	12/10/2028	199.076	0,03
200.000	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	4,850 %	30/09/2029	201.852	0,04
					400.928	0,07
España				·		
	) Banco Santander S.A.(c)	EUR	4,375 %	Perp.	693.975	0,12
400.000	CaixaBank S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	5,875 %	Perp.	509.985	0,09
					1.203.960	0,21
Supranacional			0.004.01	4710510000	200.0:=	2.55
	African Export-Import Bank	USD	2,634 %	17/05/2026	200.612	0,03
200.000	African Export-Import Bank	USD	3,798 %	17/05/2031	203.238	0,04
					403.850	0,07
Suecia 525,000	Heimstaden Bostad AB <sup>(c)</sup>	EUR	3,625 %	Perp.	591.726	0,10
	From Stauch Dostau ADV	EUR	3,023 %	reip.	391.720	0, 10
<b>Suiza</b> 1.075.000	Credit Suisse Group AG 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	5,250 %	Perp.	1.101.875	0,19
			0,200 /0	. отр.		5,10

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos – (contir Turquía	nuación)					
•	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	4,250 %	14/04/2026	264.792	0,05
230.000	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	5,250 %	13/03/2030	202.668	0,03
230.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO	USD	5,250 %	05/02/2025	220.010	0,04
					687.470	0,12
Ucrania		1100	7.750.0/	04/00/0000	100 507	2.27
	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	7,750 %	01/09/2026	420.507	0,07
420.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	EUR	4,375 %	27/01/2030	409.319 829.826	0,07
Emiratos Árab	es Unidos				829.820	0,14
	Bonos internacionales del Estado de Abu Dabi	USD	3,875 %	16/04/2050	464.500	0,08
Reino Unido	a place a Fi		0.050.0/	05/00/0000	100 507	2.24
	Gazprom PJSC Via Gaz Finance Plc.	USD	3,250 %	25/02/2030	193.507	0,04
	Virgin Media Secured Finance Plc. 144A <sup>(d)</sup> Virgin Money UK Plc. <sup>(c)</sup>	USD GBP	5,500 % 9,250 %	15/05/2029	355.300 592.905	0,06
400.000	Virgin Money OK Pic.	GBP	9,250 %	Perp.	1.141.712	0,10
Estados Unido	DS				1.141.712	0,20
	American Axle & Manufacturing, Inc.	USD	6,250 %	15/03/2026	107.822	0,02
	American Axle & Manufacturing, Inc.	USD	6,500 %	01/04/2027	109.463	0,02
370.000	Apache Corp.	USD	4,625 %	15/11/2025	389.425	0,07
	Asbury Automotive Group, Inc.	USD	4,500 %	01/03/2028	19.143	0,00
	AT&T, Inc.	USD	1,650 %	01/02/2028	658.449	0,11
	AT&T, Inc.	USD	2,250 %	01/02/2032	796.240	0,14
	B&G Foods, Inc.	USD	5,250 %	01/04/2025	604.119	0,10
	B&G Foods, Inc.	USD	5,250 %	15/09/2027	111.107	0,02
	Boeing Co.	USD	5,150 %	01/05/2030	1.715.602	0,29
	Buckeye Partners LP	USD	4,350 %	15/10/2024	10.350	0,00
	Buckeye Partners LP Centene Corp.	USD USD	3,950 % 3,375 %	01/12/2026 15/02/2030	160.000 100.838	0,03 0,02
	Chemours Co.	USD	5,375 %	15/05/2027	131.250	0,02
	Cheniere Energy Partners LP	USD	4,500 %	01/10/2029	236.531	0,02
	Citigroup Global Markets Holdings, Inc.(c)	USD	3,872 %	20/09/2023	1.774.602	0,30
	Cleveland-Cliffs, Inc.	USD	5,875 %	01/06/2027	284.625	0,05
80.000	Dana, Inc.	USD	5,375 %	15/11/2027	83.800	0,01
3.125.000	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	5,850 %	15/07/2025	3.584.094	0,61
1.175.000	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	6,020 %	15/06/2026	1.376.007	0,24
230.000	DISH DBS Corp.	USD	5,875 %	15/07/2022	233.306	0,04
	DISH DBS Corp.	USD	5,875 %	15/11/2024	106.181	0,02
	DISH DBS Corp.	USD	7,750 %	01/07/2026	107.888	0,02
	DISH DBS Corp.	USD	7,375 %	01/07/2028	137.113	0,02
	Encompass Health Corp.	USD	4,500 %	01/02/2028	151.125	0,03
	Genesis Energy LP Via Genesis Energy Finance Corp.	USD	7,750 %	01/02/2028	265.612	0,05
	Global Partners LP Via GLP Finance Corp.	USD	7,000 %	01/08/2027	103.500	0,02
	Griffon Corp. Hilton Domestic Operating Co., Inc.	USD USD	5,750 % 4,875 %	01/03/2028 15/01/2030	77.438 471.937	0,01 0,08
	Icahn Enterprises LP Via Icahn Enterprises Finance Corp.	USD	4,875 % 4,750 %	15/09/2024	346.800	0,06
	Icahn Enterprises LP Via Icahn Enterprises Finance Corp.	USD	5,250 %	15/05/2027	235.750	0,04
	Kraft Heinz Foods Co.	USD	4,375 %	01/06/2046	129.123	0,02
	Kraft Heinz Foods Co.	USD	4,875 %	01/10/2049	386.284	0,07
	Lumen Technologies, Inc. – Serie T	USD	5,800 %	15/03/2022	206.409	0,04
165.000	Mercer International, Inc.	USD	5,500 %	15/01/2026	167.203	0,03
1.150.000	Navient Corp.	USD	6,750 %	25/06/2025	1.246.312	0,21
250.000	Netflix, Inc.	USD	5,500 %	15/02/2022	252.031	0,04
205.000	Occidental Petroleum Corp.	USD	8,000 %	15/07/2025	234.725	0,04
	Occidental Petroleum Corp.	USD	6,625 %	01/09/2030	879.062	0,15
	OneMain Finance Corp.	USD	5,375 %	15/11/2029	379.350	0,06
	Penske Automotive Group, Inc.	USD	3,500 %	01/09/2025	1.172.281	0,20
	Sprint Capital Corp.	USD	8,750 %	15/03/2032	489.637	0,08
	Starwood Property Trust, Inc.	USD	5,000 %	15/12/2021	43.081	0,01
	TransDigm, Inc.	USD	5,500 %	15/11/2027	1.148.550	0,20
	United Rentals North America, Inc.	USD	3,875 %	15/02/2031	175.438	0,03
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	0,375 %	31/12/2025	23.011.450	3,93
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	0,750 % 1 125 %	31/03/2026	53.528.140	9,15
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU. Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD USD	1,125 % 1,250 %	29/02/2028 31/03/2028	26.935.390 26.546.376	4,60 4.54
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	1,250 % 3,125 %	15/11/2028	12.704.344	4,54 2,17
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD				
3.300.000	r agaires Donos del resolto de EE. OO.	USD	4,250 %	15/05/2039	7.776.563	1,33

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos - (contin	nuación)					
	s – (continuación)					
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	3,750 %	15/11/2043	16.884.984	2,89
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	3,000 %	15/05/2047	7.761.084	1,33
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU. Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	2,750 % 2,000 %	15/11/2047 15/02/2050	1.533.487 2.941.431	0,26 0,50
	Cupones de bonos strip del Tesoro de Estados Unidos	USD	1,784 %	15/02/2038	985.638	0,50
	Cupones de bonos strip del Tesoro de Estados Unidos	USD	1,823 %	15/08/2038	1.806.103	0,31
	USA Compression Partners LP Via USA Compression Finance Corp.	USD	6,875 %	01/04/2026	260.738	0,04
					204.075.331	34,88
Venezuela						
4.885.000	Petroleos de Venezuela S.A.	USD	6,000 %	28/10/2022	195.400	0,03
TOTAL DE BON (coste USD 367					365.152.841	62,42
					Valor de mercado en	% del
Tenencias	Descripción del valor					patrimonio
Fondos de inv Irlanda	ersión – 3,97 %					
	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de accione distribución $X)^{(e)(f)}$	s de			23.241.970	3,97
TOTAL DE FON (coste USD 23.2	DOS DE INVERSIÓN 241.970)				23.241.970	3,97
	ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE					
VALORES OFIC (coste USD 390					388.394.811	66,39
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Valores mobili Bonos – 4,84 % Canadá	arios negociados en otro mercado regulado %					
650.000	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,250 %	30/01/2030	561.438	0,09
	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD	5,250 % 5,250 %	30/01/2030 15/02/2031	561.438 750.690	
						0,13
878.000  Islas Caimán					750.690	0,09 0,13 0,22
878.000  Islas Caimán	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,250 % 6,500 %	15/02/2031	750.690 1.312.128 416.102	0,13 0,22 0,07
878.000  Islas Caimán 429.525  Francia 1.600.000	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(d)</sup> BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	6,500 % 4,625 %	15/02/2031 15/09/2024 13/03/2027	750.690 1.312.128 416.102 1.777.984	0,13 0,22 0,07 0,31
878.000  Islas Caimán 429.525  Francia 1.600.000	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,250 % 6,500 %	15/02/2031	750.690 1.312.128 416.102	0,13 0,22 0,07 0,31
878.000 Islas Caimán 429.525 Francia 1.600.000 325.000	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(d)</sup> BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	6,500 % 4,625 %	15/02/2031 15/09/2024 13/03/2027	750.690 1.312.128 416.102 1.777.984	0,13 0,22 0,07 0,31 0,06
878.000  Islas Caimán 429.525  Francia 1.600.000 325.000  Luxemburgo	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(d)</sup> BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup> BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD	6,500 % 4,625 % 4,875 %	15/02/2031 15/09/2024 13/03/2027 01/04/2026	750.690 1.312.128 416.102 1.777.984 362.027 2.140.011	0,13 0,22 0,07 0,31 0,06 0,37
878.000  Islas Caimán 429.525  Francia 1.600.000 325.000  Luxemburgo 200.000	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(d)</sup> BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup> BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup> Altice Financing S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD	5,250 % 6,500 % 4,625 % 4,875 %	15/02/2031 15/09/2024 13/03/2027 01/04/2026	750.690 1.312.128 416.102 1.777.984 362.027 2.140.011	0,13 0,22 0,07 0,31 0,06 0,37
878.000  Islas Caimán 429.525  Francia 1.600.000 325.000  Luxemburgo 200.000	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(d)</sup> BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup> BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD	6,500 % 4,625 % 4,875 %	15/02/2031 15/09/2024 13/03/2027 01/04/2026	750.690 1.312.128 416.102 1.777.984 362.027 2.140.011 189.500 364.000	0,13 0,22 0,07 0,31 0,06 0,37
878.000  Islas Caimán	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(d)</sup> BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup> BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup> Altice Financing S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD	5,250 % 6,500 % 4,625 % 4,875 %	15/02/2031 15/09/2024 13/03/2027 01/04/2026	750.690 1.312.128 416.102 1.777.984 362.027 2.140.011	0,13 0,22 0,07 0,31 0,06 0,37
878.000  Islas Caimán 429.525  Francia 1.600.000 325.000  Luxemburgo 200.000 350.000  Países Bajos	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(d)</sup> BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup> BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup> Altice Financing S.A. 144A <sup>(d)</sup> Camelot Finance S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD USD	5,250 % 6,500 % 4,625 % 4,875 % 5,000 % 4,500 %	15/02/2031 15/09/2024 13/03/2027 01/04/2026 15/01/2028 01/11/2026	750.690 1.312.128 416.102 1.777.984 362.027 2.140.011 189.500 364.000 553.500	0,13 0,22 0,07 0,31 0,06 0,37 0,04 0,06
878.000  Islas Caimán 429.525  Francia 1.600.000 325.000  Luxemburgo 200.000 350.000  Países Bajos 265.000	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(d)</sup> BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup> BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup> Altice Financing S.A. 144A <sup>(d)</sup> Camelot Finance S.A. 144A <sup>(d)</sup> Alcoa Nederland Holding BV 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD USD USD	5,250 % 6,500 % 4,625 % 4,875 % 5,000 % 4,500 %	15/02/2031 15/09/2024 13/03/2027 01/04/2026 15/01/2028 01/11/2026	750.690 1.312.128 416.102 1.777.984 362.027 2.140.011 189.500 364.000 553.500	0,131 0,22 0,07 0,31 0,06 0,37 0,04 0,06
878.000  Islas Caimán 429.525  Francia 1.600.000 325.000  Luxemburgo 200.000 350.000  Países Bajos 265.000	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(d)</sup> BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup> BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup> Altice Financing S.A. 144A <sup>(d)</sup> Camelot Finance S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD USD	5,250 % 6,500 % 4,625 % 4,875 % 5,000 % 4,500 %	15/02/2031 15/09/2024 13/03/2027 01/04/2026 15/01/2028 01/11/2026	750.690 1.312.128 416.102 1.777.984 362.027 2.140.011 189.500 364.000 553.500 281.231 207.000	0,13 0,22 0,07 0,31 0,06 0,37 0,04 0,06 0,10
878.000  Islas Caimán 429.525  Francia 1.600.000 325.000  Luxemburgo 200.000 350.000  Países Bajos 265.000 200.000	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(d)</sup> BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup> BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup> Altice Financing S.A. 144A <sup>(d)</sup> Camelot Finance S.A. 144A <sup>(d)</sup> Alcoa Nederland Holding BV 144A <sup>(d)</sup> UPC Holding BV 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD USD USD	5,250 % 6,500 % 4,625 % 4,875 % 5,000 % 4,500 %	15/02/2031 15/09/2024 13/03/2027 01/04/2026 15/01/2028 01/11/2026	750.690 1.312.128 416.102 1.777.984 362.027 2.140.011 189.500 364.000 553.500	0,131 0,22 0,07 0,31 0,06 0,37 0,04 0,06
878.000  Islas Caimán	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(d)</sup> BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup> BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup> Altice Financing S.A. 144A <sup>(d)</sup> Camelot Finance S.A. 144A <sup>(d)</sup> Alcoa Nederland Holding BV 144A <sup>(d)</sup> UPC Holding BV 144A <sup>(d)</sup> BS  Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd.	USD USD USD USD USD USD	5,250 % 6,500 % 4,625 % 4,875 % 5,000 % 4,500 % 5,500 %	15/02/2031 15/09/2024 13/03/2027 01/04/2026 15/01/2028 01/11/2026	750.690 1.312.128 416.102 1.777.984 362.027 2.140.011 189.500 364.000 553.500 281.231 207.000 488.231	0,13 0,22 0,07 0,31 0,06 0,37 0,04 0,06 0,10
878.000  Islas Caimán	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(d)</sup> BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup> BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup> Altice Financing S.A. 144A <sup>(d)</sup> Camelot Finance S.A. 144A <sup>(d)</sup> Alcoa Nederland Holding BV 144A <sup>(d)</sup> UPC Holding BV 144A <sup>(d)</sup> IS  Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD USD USD USD USD	5,250 % 6,500 % 4,625 % 4,875 % 5,000 % 4,500 %	15/02/2031 15/09/2024 13/03/2027 01/04/2026 15/01/2028 01/11/2026	750.690 1.312.128 416.102 1.777.984 362.027 2.140.011 189.500 364.000 553.500 281.231 207.000	0,13 0,22 0,07 0,31 0,06 0,37 0,04 0,06 0,10
878.000  Islas Caimán	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(d)</sup> BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup> BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup> Altice Financing S.A. 144A <sup>(d)</sup> Camelot Finance S.A. 144A <sup>(d)</sup> Alcoa Nederland Holding BV 144A <sup>(d)</sup> UPC Holding BV 144A <sup>(d)</sup> BS  Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd.	USD USD USD USD USD USD USD	5,250 % 6,500 % 4,625 % 4,875 % 5,000 % 4,500 % 5,500 %	15/02/2031 15/09/2024 13/03/2027 01/04/2026 15/01/2028 01/11/2026	750.690 1.312.128 416.102 1.777.984 362.027 2.140.011 189.500 364.000 553.500 281.231 207.000 488.231	0,13 0,22 0,07 0,31 0,06 0,37 0,04 0,06 0,10 0,06
878.000  Islas Caimán	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(d)</sup> BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup> BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup> Altice Financing S.A. 144A <sup>(d)</sup> Camelot Finance S.A. 144A <sup>(d)</sup> Alcoa Nederland Holding BV 144A <sup>(d)</sup> UPC Holding BV 144A <sup>(d)</sup> Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd.	USD USD USD USD USD USD USD USD	5,250 % 6,500 % 4,625 % 4,875 % 5,000 % 4,500 % 5,500 % 5,500 % 13,000 %	15/02/2031 15/09/2024 13/03/2027 01/04/2026 15/01/2028 01/11/2026 15/12/2027 15/01/2028 25/05/2024 31/12/2025	750.690 1.312.128 416.102 1.777.984 362.027 2.140.011 189.500 364.000 553.500 281.231 207.000 488.231 149.656 81.775	0,13 0,22 0,07 0,31 0,06 0,37 0,04 0,06 0,10 0,03 0,03 0,03
878.000  Islas Caimán	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(d)</sup> BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup> BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup> Altice Financing S.A. 144A <sup>(d)</sup> Camelot Finance S.A. 144A <sup>(d)</sup> Alcoa Nederland Holding BV 144A <sup>(d)</sup> UPC Holding BV 144A <sup>(d)</sup> UPC Holding BV 144A <sup>(d)</sup> BS  Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD USD USD USD USD USD	5,250 %  6,500 %  4,625 %  4,875 %  5,000 %  4,500 %  5,500 %  5,500 %	15/02/2031 15/09/2024 13/03/2027 01/04/2026 15/01/2028 01/11/2026 15/12/2027 15/01/2028	750.690 1.312.128 416.102 1.777.984 362.027 2.140.011 189.500 364.000 553.500 281.231 207.000 488.231	0,13 0,22 0,07 0,31 0,06 0,37 0,04 0,06 0,05 0,03 0,03
S78.000	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(d)</sup> BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup> BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup> Altice Financing S.A. 144A <sup>(d)</sup> Camelot Finance S.A. 144A <sup>(d)</sup> Alcoa Nederland Holding BV 144A <sup>(d)</sup> UPC Holding BV 144A <sup>(d)</sup> UPC Holding BV 144A <sup>(d)</sup> BS  Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD USD USD USD USD USD	5,250 %  6,500 %  4,625 % 4,875 %  5,000 % 4,500 %  5,500 %  5,500 %  13,000 %	15/02/2031 15/09/2024 13/03/2027 01/04/2026 15/01/2028 01/11/2026 15/12/2027 15/01/2028 25/05/2024 31/12/2025	750.690 1.312.128 416.102 1.777.984 362.027 2.140.011 189.500 364.000 553.500 281.231 207.000 488.231 149.656 81.775 56.590	0,13 0,22 0,07 0,31 0,06 0,37 0,04 0,06 0,03 0,03 0,03 0,03
878.000  Islas Caimán	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(d)</sup> BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup> BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup> Altice Financing S.A. 144A <sup>(d)</sup> Camelot Finance S.A. 144A <sup>(d)</sup> Alcoa Nederland Holding BV 144A <sup>(d)</sup> UPC Holding BV 144A <sup>(d)</sup> B  Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> 144A <sup>(d)</sup> EG Global Finance Plc. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD USD USD USD USD USD	5,250 %  6,500 %  4,625 % 4,875 %  5,000 % 4,500 %  5,500 %  5,500 %  13,000 %	15/02/2031 15/09/2024 13/03/2027 01/04/2026 15/01/2028 01/11/2026 15/12/2027 15/01/2028 25/05/2024 31/12/2025	750.690 1.312.128 416.102 1.777.984 362.027 2.140.011 189.500 364.000 553.500 281.231 207.000 488.231 149.656 81.775 56.590	0,13 0,22 0,07 0,31 0,06 0,37 0,04 0,06 0,03 0,03 0,03 0,03
878.000  Islas Caimán	Bausch Health Cos., Inc. 144A <sup>(d)</sup> Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(d)</sup> BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup> BPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup> Altice Financing S.A. 144A <sup>(d)</sup> Camelot Finance S.A. 144A <sup>(d)</sup> Alcoa Nederland Holding BV 144A <sup>(d)</sup> UPC Holding BV 144A <sup>(d)</sup> BS  Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup> Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,250 % 6,500 % 4,625 % 4,875 % 5,000 % 4,500 % 5,500 % 5,500 % 13,000 % 8,000 %	15/02/2031 15/09/2024 13/03/2027 01/04/2026 15/01/2028 01/11/2026 15/12/2027 15/01/2028 25/05/2024 31/12/2025 31/12/2026	750.690 1.312.128 416.102 1.777.984 362.027 2.140.011 189.500 364.000 553.500 281.231 207.000 488.231 149.656 81.775 56.590 288.021	0,13 0,22 0,07 0,31 0,06 0,37 0,04 0,06 0,10 0,03 0,03 0,03 0,03

					Valor de mercado en	% del
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	USD	patrimonio
Bonos – (cont Estados Unidos	·					
395.000	Albertsons Cos., Inc. Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via Albertsons LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	7,500 %	15/03/2026	420.241	0,07
110.000	Albertsons Cos., Inc. Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via Albertsons LLC $144A^{(d)}$	USD	4,625 %	15/01/2027	114.263	0,02
326.000	Albertsons Cos., Inc. Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via Albertsons LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,875 %	15/02/2030	346.375	0,06
215.000	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp. 144A <sup>(d)</sup>	USD	6,625 %	15/07/2026	221.988	0,04
230.000	Bausch Health Americas, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	9,250 %	01/04/2026	242.075	0,04
887.000	Booz Allen Hamilton, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,875 %	01/09/2028	892.544	0,15
	Broadcom, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,137 %	15/11/2035	1.790.643	0,31
	Calpine Corp. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,625 %	01/02/2029	297.600	0,05
	CCO Holdings LLC Via CCO Holdings Capital Corp. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,250 %	01/02/2031	389.569	0,07
111.000	Cedar Fair LP Via Canada's Wonderland Co. Via Magnum Management Corp. Via Millennium Op 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,500 %	01/05/2025	114.885	0,02
105 000	CHS Via Community Health Systems, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	8,000 %	15/03/2026	110.119	0,02
	Continental Resources, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,750 %	15/01/2031	592.112	0,10
	CSC Holdings LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,750 %	15/01/2030	343.875	0,06
	CSC Holdings LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,375 %	15/02/2031	815.850	0,14
	DaVita, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,750 %	15/02/2031	1.496.662	0,26
57.000	Dun & Bradstreet Corp. 144A <sup>(d)</sup>	USD	10,250 %	15/02/2027	60.848	0,01
421.000	Group 1 Automotive, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,000 %	15/08/2028	416.790	0,07
330.000	GrubHub Holdings, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,500 %	01/07/2027	334.125	0,06
	H&E Equipment Services, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,875 %	15/12/2028	151.319	0,03
	Herc Holdings, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,500 %	15/07/2027	316.056	0,05
	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,375 %	01/05/2025	25.797	0,00
	iHeartCommunications, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,250 %	15/08/2027	152.438	0,03
	Ingevity Corp. 144A(d)	USD	3,875 % 7,000 %	01/11/2028 15/06/2025	168.000 203.615	0,03
	IRB Holding Corp. 144A <sup>(d)</sup> Iron Mountain, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,500 %	15/02/2031	1.061.562	0,03 0,18
	JELD-WEN, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,875 %	15/12/2027	274.937	0,15
	KBR, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,750 %	30/09/2028	207.555	0,03
	LABL, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	6,750 %	15/07/2026	103.125	0,02
	LCM Investments Holdings II LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,875 %	01/05/2029	136.013	0,02
200.000	Live Nation Entertainment, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	6,500 %	15/05/2027	218.000	0,04
100.000	LPL Holdings, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,625 %	15/11/2027	103.250	0,02
	Lumen Technologies, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,125 %	15/12/2026	105.656	0,02
	Manitowoc Co., Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	9,000 %	01/04/2026	280.900	0,05
	Mattel, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,875 %	15/12/2027	391.462	0,07
141.000	Mileage Plus Holdings LLC Via Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	6,500 %	20/06/2027	150.964	0,03
1 325 000	Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,500 %	15/08/2028	1.328.314	0,03
	Nexstar Media, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,625 %	15/07/2027	208.000	0,03
	Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,000 %	15/08/2027	86.488	0,01
	Par Pharmaceutical, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	7,500 %	01/04/2027	111.925	0,02
	Performance Food Group, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	6,875 %	01/05/2025	63.000	0,01
200.000	Performance Food Group, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,500 %	15/10/2027	207.000	0,03
100.000	Post Holdings, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,500 %	15/12/2029	104.000	0,02
	Prime Security Services Borrower LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	6,250 %	15/01/2028	170.690	0,03
	PTC, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,625 %	15/02/2025	92.394	0,01
	Sabre GLBL, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	9,250 %	15/04/2025	186.128	0,03
	Sealed Air Corp. 144A(d)	USD	4,000 %	01/12/2027	52.500	0,01
	Select Medical Corp. 144A <sup>(d)</sup>	USD	6,250 %	15/08/2026	157.500	0,03
	Staples, Inc. 144A <sup>(d)</sup> State of California	USD	7,500 %	15/04/2026	105.525	0,02
	State of California State of Illinois	USD	7,625 % 5,100 %	01/03/2040 01/06/2033	58.758	0,01 0,43
	State of Illinois	USD	6,630 %	01/02/2035	2.548.041 2.174.302	0,43
	Stericycle, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,375 %	15/07/2024	510.524	0,09
	Summit Materials LLC Via Summit Materials Finance Corp. 144A <sup>(d)</sup>	USD	6,500 %	15/03/2027	254.647	0,03
	Summit Materials LLC Via Summit Materials Finance Corp. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,250 %	15/01/2029	128.100	0,02
	Twitter, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,875 %	15/12/2027	276.262	0,05
	Uber Technologies, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	8,000 %	01/11/2026	168.273	0,03
250.000	Univar Solutions USA, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,125 %	01/12/2027	261.562	0,04
	VICI Properties LP Via VICI Note Co., Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,500 %	15/02/2025	401.445	0,07
12.000	Yum! Brands, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	7,750 %	01/04/2025	12.631	0,00
					22.719.222	3,88
TOTAL DE BONOS (coste USD 27.506.341)					28.337.365	4,84

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio	
Obligaciones con garantía de activos emitidos o garantizados por agencias – 6,87 % Estados Unidos							
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/04/2024	15.249	0,00	
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	2,000 %	01/09/2033	810	0,00	
1.965	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	2,238 %	01/09/2033	2.070	0,00	
1.841	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	2,215 %	01/10/2034	1.948	0,00	
292	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	2,150 %	01/11/2034	308	0,00	
1.295	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	2,150 %	01/11/2034	1.366	0,00	
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	2,260 %	01/11/2034	870	0,00	
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	2,375 %	01/11/2034	2.482	0,00	
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	2,276 %	01/02/2035	1.921	0,00	
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup>	USD	2,375 %	01/02/2035	1.818	0,00	
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	2,345 %	01/06/2035	56.047	0,01	
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup>	USD USD	2,125 % 0,439 %	01/05/2036 15/10/2036	15.061 54.285	0,00 0,01	
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	0,489 %	15/12/2036	32.091	0,01	
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup>	USD	0,689 %	15/09/2037	94.386	0,01	
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup>	USD	0,939 %	15/06/2039	24.916	0,02	
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup>	USD	0,459 %	15/03/2041	113.301	0,02	
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	5,911 %	15/05/2041	18.099	0,00	
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	5,511 %	15/05/2045	48.251	0,01	
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	6,011 %	15/05/2045	15.667	0,00	
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	5,958 %	25/10/2048	72.757	0,01	
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/03/2049	4.659.444	0,80	
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/07/2049	530.848	0,09	
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	6,008 %	25/08/2049	97.591	0,02	
1.994.954	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	25/06/2050	289.986	0,05	
2.592.887	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	25/08/2050	409.850	0,07	
2.440.095	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	2,000 %	25/09/2050	236.519	0,04	
562.285	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	25/09/2050	86.366	0,02	
210.000	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A(c)(d)	USD	1,700 %	25/01/2034	211.479	0,04	
7.096	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	1,880 %	01/02/2033	7.400	0,00	
1.047	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	1,584 %	01/06/2033	1.084	0,00	
59.607	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	1,764 %	01/07/2033	62.207	0,01	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	2,278 %	01/07/2033	813	0,00	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	2,391 %	01/04/2034	241	0,00	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	2,533 %	01/04/2034	33.355	0,01	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	1,838 %	01/09/2034	39.453	0,01	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	2,235 %	01/10/2034	65.752	0,01	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	1,933 %	01/11/2034	2.425	0,00	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	2,422 %	01/11/2034	346.651	0,06	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	1,881 %	01/02/2035	1.724	0,00	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD USD	2,321 %	01/02/2035	2.083 6.806	0,00 0,00	
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(c)</sup> Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(c)</sup>	USD	2,046 % 2,185 %	01/04/2035 01/04/2035	2.606	0,00	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	1,774 %	01/05/2035	13.981	0,00	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	1,606 %	01/06/2035	21.398	0,00	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	2,385 %	01/06/2035	6.328	0,00	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	2,000 %	01/08/2035	19.056	0,00	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	1,778 %	01/09/2035	19.967	0,00	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,492 %	25/06/2036	97.802	0,02	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,492 %	25/08/2036	113.383	0,02	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,492 %	25/08/2036	127.436	0,02	
50.241	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,442 %	25/04/2037	50.589	0,01	
59.695	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,542 %	25/08/2037	60.306	0,01	
455.094	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/10/2038	495.720	0,08	
3.329	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/04/2039	3.703	0,00	
2.245	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	01/08/2039	2.473	0,00	
946	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	01/09/2039	1.037	0,00	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	1,192 %	25/10/2039	14.847	0,00	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	5,858 %	25/12/2040	11.487	0,00	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/08/2041	104.351	0,02	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	6,458 %	25/12/2041	28.678	0,01	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	5,858 %	25/02/2042	15.242	0,00	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	6,578 %	25/07/2042	41.155	0,01	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	6,508 %	25/02/2044	38.219	0,01	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	6,058 %	25/02/2046	48.317	0,01	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/12/2046	841.002	0,14	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	6,008 %	25/05/2047	132.677	0,02	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	6,058 %	25/11/2047	67.648	0,01	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	2,500 %	25/03/2048	28.857	0,01	
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD USD	4,500 % 5,000 %	01/05/2048	59.016	0,01	
17.090	Federal National Mortgage Association (FNMA)	090	5,000 %	01/05/2048	18.830	0,00	

Tournelos	December 16 de Leville	Distan	Ti :(a)	5(b)	Valor de mercado en	% del
Obligaciones	Descripción del valor  con garantía de activos emitidos o garantizados por agenc	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	USD	patrimonio
•	s – (continuación)	ias – (continu	acioni			
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/06/2048	2.782.290	0,48
1.956.140	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	25/06/2048	323.580	0,06
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/07/2048	572.778	0,10
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/01/2049	421.384	0,07
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/02/2049	12.964	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/05/2049	631.679	0,11
	Federal National Mortgage Association (FNMA) Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	4,500 % 5,908 %	01/12/2049 25/01/2050	317.248 57.761	0,05 0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	25/06/2050	144.548	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	25/07/2050	58.218	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	2,000 %	25/09/2050	281.369	0,05
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	25/09/2050	79.199	0,01
303.649	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/10/2050	326.441	0,06
1.000.000	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(g)</sup>	USD	4,500 %	13/12/2051	1.075.039	0,18
1.000.000	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(9)</sup>	USD	5,000 %	13/12/2051	1.095.155	0,19
	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(g)</sup>	USD	4,500 %	14/01/2052	2.151.328	0,37
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,511 %	16/01/2040	32.295	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,589 %	20/03/2040	25.507	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,059 %	20/04/2043	14.640	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,009 %	20/06/2043	46.204	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,059 %	20/07/2043	11.717	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA) Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup>	USD USD	4,000 % 5,509 %	20/08/2044 20/08/2044	7.331 209.124	0,00 0,04
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/06/2045	5.877	0,04
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/06/2045	6.090	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4.000 %	20/08/2045	23.740	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,109 %	20/08/2045	10.504	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,159 %	20/08/2045	49.917	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,629 %	20/09/2045	13.724	0,00
93.123	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,609 %	20/10/2045	15.846	0,00
419.864	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,609 %	20/01/2048	64.954	0,01
388.890	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,109 %	20/06/2048	59.297	0,01
920.187	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,109 %	20/09/2048	152.186	0,03
1.040.794	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,059 %	20/10/2048	150.752	0,02
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/12/2048	5.134.338	0,88
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/01/2049	5.573.274	0,95
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,959 %	20/01/2049	94.557	0,02
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,059 %	20/01/2049	50.192	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)(C)	USD	3,699 %	20/02/2049	67.805	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/02/2049	2.300.139	0,39
	Government National Mortgage Association (GNMA) Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup>	USD	4,500 % 3,179 %	20/03/2049 20/06/2049	1.924.309 37.047	0,33 0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup>	USD	5,959 %	20/08/2049	131.992	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,009 %	20/08/2049	100.103	0,02
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,959 %	20/09/2049	437.463	0,08
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/10/2049	117.211	0,02
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/10/2049	908.635	0,16
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/12/2049	313.213	0,05
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/12/2049	277.543	0,05
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/12/2049	323.269	0,06
518.162	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,959 %	20/02/2050	83.439	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/04/2050	63.194	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/05/2050	158.013	0,03
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/06/2050	184.170	0,03
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	2,500 %	20/10/2050	513.576	0,09
539.552	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	2,500 %	20/11/2050	26.960	0,00
					40.203.019	6,87
TOTAL DE OBL (coste USD 40.0	IGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARAN 190.689)	ITIZADOS POR	AGENCIAS		40.203.019	6,87
-	con garantía de activos no emitidos ni garantizados por ag	jencias – 9,17	%			
Islas Caimán	AGL CLO 5 Ltd. 2020-5A "A1R" 144A(c)(d)	USD	4 202 0/	20/07/2024	2 227 405	0.57
	Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,292 % 3,374 %	20/07/2034 23/10/2034	3.327.195 3.184.675	0,57 0,54
	Canyon CLO 2018-1A Ltd. "A" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,194 %	15/07/2031	7.051.741	1,21
	CQS US CLO 2021-1A Ltd. "A" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	0,000 %	20/01/2035	5.794.200	0,99
	Jamestown CLO VI-R 2018-6RA Ltd. "A1" 144A(c)(d)	USD	1,274 %	25/04/2030	7.204.687	1,23
	Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,432 %	20/04/2033	3.202.835	0,55
			•			

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de
Obligaciones Islas Caimán –	con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia (continuación)	ıs – (cont	tinuación)			
2.000.000	Ocean Trails CLO IX 2020-9A "DR" 144A(c)(d)	USD	3,874 %	15/10/2034	1.988.452	0,34
3.600.000	Trinitas CLO XVII 2021-17A Ltd. "D" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,613 %	20/10/2034	3.579.066	0,61
					35.332.851	6,04
Irlanda						
	Magnolia Finance XI DAC 2018-3MGN "A"(C)	EUR	2,750 %	18/02/2025	2.483.448	0,43
1.771.731	Octagon Finance No 1 DAC "A"(c)	EUR	1,809 %	17/01/2023	1.955.486	0,33
Date - Halda					4.438.934	0,76
Reino Unido 672 218	Harben Finance 2017-1X Plc. "A"(C)	GBP	0,914 %	20/08/2056	898.487	0,1
	Red 2 Finance CLO 2018-1 DAC(c)	GBP	0,000 %	20/01/2028	1.563.062	0,27
	Stratton Mortgage Funding 2019-1 Plc. "A"(c)	GBP	1,250 %	25/05/2051	3.014.771	0,52
			-		5.476.320	0,94
Estados Unidos						
700.000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 "D" 144A(d)	USD	3,000 %	15/07/2049	649.324	0,1
300.000	Bank 2018-BNK10 "D" 144A(d)	USD	2,600 %	15/02/2061	262.417	0,0
	Bank 2018-BNK13 "D" 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,000 %	15/08/2061	260.445	0,04
	Bank 2018-BNK15 "D" 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,000 %	15/11/2061	470.036	0,08
	BBCMS Mortgage Trust 2017-C1 "D" 144A(c)(d)	USD	3,659 %	15/02/2050	277.658	0,0
	BBCMS Mortgage Trust 2018-C2 "D" 144A(d)	USD	3,000 %	15/12/2051	470.709	0,08
	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,000 %	15/09/2050	409.545	0,07
	COMM Mortgage Trust 2017-COR2 "D" 144A(d)	USD	3,000 %	10/09/2050	280.169 286.932	0,05 0,05
	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01 "1M2" 144A <sup>(c)(d)</sup> CSAIL Commercial Mortgage Trust 2018-C14 "D" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,600 % 5,088 %	25/10/2041 15/11/2051	200.932	0,03
	DBJPM 17-C6 Mortgage Trust "D" 144A(c)(d)	USD	3,227 %	10/06/2050	748.464	0,03
	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2017-C7 "D" 144A(d)	USD	3,000 %	15/10/2050	584.962	0,10
	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-L1 "D" 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,000 %	15/10/2051	775.299	0,13
	SLM Student Loan Trust 2005-4 "A3"(c)	USD	0,244 %	25/01/2027	140.518	0,02
939.098	SLM Student Loan Trust 2005-5 "A4"(c)	USD	0,264 %	25/10/2028	938.480	0,16
745.618	SLM Student Loan Trust 2008-5 "A4"(c)	USD	1,824 %	25/07/2023	754.114	0,13
400.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RB1 "D" 144A(d)	USD	3,401 %	15/03/2050	372.880	0,06
550.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RC1 "D" 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,250 %	15/01/2060	514.917	0,09
					8.397.763	1,43
(coste USD 52.	IGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS NO EMITIDOS NI GARANT 274.241)	IZADOS F	OR AGENCIAS		53.645.868	9,17
TOTAL DE VAL (coste USD 119	ORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO .871.271)	)			122.186.252	20,88
Otros valores						
Bonos – 0,02 <sup>o</sup> Estados Unidos						
	Novelis Corp. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,750 %	30/01/2030	101.500	0,02
TOTAL DE BON					101.500	0,02
TOTAL DE OTR	OS VALORES MOBILIARIOS					
(coste USD 100	·'				101.500	0,02
Certificados d	e depósito – 0,77 %					
Estados Unidos						
-	Svenska Handelsbanken AB <sup>(c)</sup>	USD	0,000 %	06/12/2021	4.499.988	0,77
TOTAL DE CER (coste USD 4.5	TIFICADOS DE DEPÓSITO 00.028)				4.499.988	0,77
Efectos come	rciales – 10,35 %					
Estados Unido						
	AT&T, Inc.	USD	0,000 %	14/12/2021	1.989.896	0,34
	AT&T, Inc.	USD	0,000 %	14/02/2022	5.997.315	1,03
	Banco Santander	USD	0,000 %	01/12/2021	7.499.986	1,28
	Citigroup Global Markets, Inc. (c)	USD	0,000 %	21/10/2022	7.973.928	1,36
	Collaterized Commercial Paper V Co., LLC Dominion Resources, Inc.(c)	USD USD	0,000 %	09/02/2022	10.996.702	1,88 1,04
	Dow Chemical Company	USD	0,000 % 0,000 %	07/12/2021 29/12/2021	6.099.852 6.499.089	1,04
0.500.000	Dow Onemical Company	USD	0,000 %	29/12/2021	0.499.009	1,11

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	erciales – (continuación)					
	s – (continuación)					
	Entergy Corp.(c)	USD	0,000 %	06/01/2022	8.498.323	1,45
5.000.000	VW CR, Inc. <sup>(c)</sup>	USD	0,000 %	05/01/2022	4.999.255	0,86
					60.554.346	10,35
TOTAL DE EFI (coste USD 60	ECTOS COMERCIALES .560.890)				60.554.346	10,35
VALOR DE ME (coste USD 57	RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS 5.970.943)				575.736.897	98,41
Contratos de	futuros – (0,58 %)					
Número de contratos	Descripción del valor			Compromiso Valor de mercado USD	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
	USD					
186	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022		Larga	24.377.625	135.936	0,02
PLUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS				135.936	0,02
Número de contratos	Descripción del valor			Compromiso Valor de mercado USD	Minusvalía latente en USD	% del patrimonio
	EUR					
(4)	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años 08/12/2	2021	Corta	(785.345)	(3.869)	(0,00)
(1)	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/2	2021	Corta	(247.983)	(3.891)	(0,00)
(8)	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/12/20	)21	Corta	(1.234.704)	(4.642)	(0,00)
				(2.268.032)	(12.402)	(0,00)
	USD					
	005		Corta	(14.901.125)	(360.958)	,
(92)	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022					(0,01)
(177)	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022		Corta	(38.767.149)	(82.527)	,
(177)	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022		Corta Corta	(38.767.149) (130.092.290)	(82.527) (1.270.154)	,
(177) (1.069) (109)	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022			, ,	, ,	(0,22)
(177) (1.069) (109)	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022		Corta	(130.092.290)	(1.270.154)	(0,22) (0,13)
(177) (1.069) (109)	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años		Corta Corta	(130.092.290) (21.772.750)	(1.270.154) (748.354)	(0,22) (0,13)

#### Contratos de divisas a plazo – (0,24 %)

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
BRL	2.861.823	USD	510.538	02/12/2021	466	0,00
EUR	846.354		3.902.251	06/12/2021	12.891	0,00
USD	5.139.411		3.902.231	07/12/2021	23.958	0,00
USD	200.393		2.544.971	10/12/2021	6.881	0,00
USD	207.600	ZAR	3.163.471	13/12/2021	9.530	0,00
USD	1.049.000		9.931.932			
				14/12/2021	295.208	0,05
CAD	3.940.589	EUR	2.647.098	15/12/2021	72.922	0,02
CHF	8.074.792		7.534.520	15/12/2021	242.697	0,04
CHF	8.809.345	USD	9.614.162	15/12/2021	7.826	0,00
CNH	74.008.386	USD	11.444.575	15/12/2021	165.078	0,02
EUR	438.843	CAD	632.209	15/12/2021	4.415	0,00
EUR	1.353.168	NZD	2.235.758	15/12/2021	11.680	0,00
EUR	1.334.741	PLN	6.137.647	15/12/2021	25.700	0,00
EUR	1.327.346	SEK	13.394.370	15/12/2021	24.706	0,00
GBP	2.264.511	EUR	2.652.329	15/12/2021	6.587	0,00
ILS	1.598.784	EUR	440.451	15/12/2021	7.118	0,00
JPY	228.061.394	EUR	1.771.754	15/12/2021	8.929	0,00
USD	3.888.657	AUD	5.224.002	15/12/2021	146.737	0,04
USD	18.535.860	CAD	23.402.492	15/12/2021	207.054	0,02
USD	1.039.562	CZK	22.898.684	15/12/2021	20.066	0,00
USD	48.479.578	EUR	41.601.172	15/12/2021	1.122.588	0,20
USD	30.242.389	GBP	22.034.994	15/12/2021	798.799	0,13
USD	511.695	HUF	160.022.484	15/12/2021	14.142	0,00
USD	35.314.035	JPY	3.938.004.608	15/12/2021	333.622	0,06
USD	2.558.398	MXN	52.480.215	15/12/2021	103.609	0,03
USD	8.736.853		74.784.199	15/12/2021	471.494	0,09

Contratos	de	divisas	а	plazo -	(continuación)
-----------	----	---------	---	---------	----------------

Divisa	Compra Divisa	a Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
USD	18.361.946 NZD	26.399.492	15/12/2021	311.191	0,05
USD	25.317.828 SEK	218.873.205	15/12/2021	1.030.845	0,19
USD	1.022.520 SGD	1.390.882	15/12/2021	2.686	0,00
USD	1.578.463 THB	52.863.557	15/12/2021	9.711	0,00
USD	4.151.761 TRY	38.149.850	15/12/2021	1.257.690	0,22
USD	2.999.243 ZAR	44.556.500	15/12/2021	210.302	0,04
USD	332.834 TRY	3.986.538	20/12/2021	31.113	0,00
USD	130.199 ILS	398.929	21/12/2021	3.267	0,00
USD	617.099 ILS	1.936.211	22/12/2021	997	0,00
ILS	4.446.253 USD	1.403.500	24/12/2021	11.477	0,00
USD	121.726 ILS	375.707	24/12/2021	2.161	0,00
TWD	25.033.122 USD	901.412	19/01/2022	6.308	0,00
SEK	3.819.315 USD	421.017	20/01/2022	3.350	0,00
USD	7.733.883 GBP	5.630.917	21/01/2022	204.762	0,04
CHF	316.384 USD	339.531	25/01/2022	6.601	0,00
USD	1.416.623 NOK	11.817.681	25/01/2022	111.005	0,02
USD	14.155.845 ILS	43.630.401	26/01/2022	255.360	0,04
USD	434.412 AUD	601.133	31/01/2022	3.622	0,00
USD	388.082 CAD	491.392	31/01/2022	3.101	0,00
USD	754.485 CLP	621.778.961	07/02/2022	15.697	0,00
EUR	826.371 USD	933.981	10/02/2022	8.447	0,00
USD	2.697.130 KRW	3.195.726.726	10/02/2022	3.934	0,00
USD	1.501.788 RUB	112.782.416	10/02/2022	3.103	0,00
USD	1.646.767 NZD	2.364.448	16/02/2022	31.477	0,01
USD	2.098.000 TRY	20.244.651	14/06/2022	707.891	0,12
PLUSVALÍA LAT	ENTE SOBRE CONTRATOS D	DE DIVISAS A PLAZO		8.380.801	1,43

					Minusvalía latente en	% del
Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	USD	patrimonio
USD	514.920	BRL	2.915.479	02/12/2021	(5.664)	(0,00)
PLN	810.857	EUR	176.300	06/12/2021	(3.173)	(0,00)
INR	388.564.222	USD	5.246.922	07/12/2021	(72.275)	(0,01)
USD	2.768.320	ZAR	44.223.708	09/12/2021	(2.207)	(0,00)
ZAR	52.029.453	USD	3.262.791	09/12/2021	(3.251)	(0,00)
ZAR	16.215.907	USD	1.057.857	13/12/2021	(42.554)	(0,01)
TRY	18.567.300	USD	2.098.000	14/12/2021	(688.819)	(0,12)
AUD	5.095.741	NZD	5.361.946	15/12/2021	(16.204)	(0,00)
AUD	27.023.839	USD	19.869.029	15/12/2021	(512.020)	(0,08)
CAD	18.848.641	USD	14.984.031	15/12/2021	(221.796)	(0,03)
CZK	33.401.757	EUR	1.315.775	15/12/2021	(10.708)	(0,00)
CZK	55.239.278	USD	2.557.096	15/12/2021	(97.733)	(0,02)
EUR	1.328.498	AUD	2.142.249	15/12/2021	(22.174)	(0,00)
EUR	885.087	CHF	957.700	15/12/2021	(38.500)	(0,01)
EUR	890.895	CZK	22.870.347	15/12/2021	(4.077)	(0,00)
EUR	452.413	GBP	388.270	15/12/2021	(3.806)	(0,00)
EUR	2.204.663	HUF	807.383.308	15/12/2021	(681)	(0,00)
EUR	1.776.401	JPY	233.364.048	15/12/2021	(50.741)	(0,01)
EUR	55.744.704	USD	64.424.782	15/12/2021	(967.400)	(0,18)
GBP	14.467.226	USD	19.709.226	15/12/2021	(377.838)	(0,05)
HUF	632.096.719	EUR	1.767.459	15/12/2021	(46.639)	(0,00)
HUF	151.508.740	USD	510.361	15/12/2021	(39.279)	(0,01)
JPY	3.119.776.730	USD	27.880.526	15/12/2021	(168.247)	(0,06)
MXN	32.145.062	USD	1.551.582	15/12/2021	(47.980)	(0,00)
NOK	27.126.445	EUR	2.648.772	15/12/2021	(17.157)	(0,00)
NOK	45.170.169	USD	5.223.360	15/12/2021	(231.026)	(0,04)
NZD	38.298.532	USD	27.186.463	15/12/2021	(999.693)	(0,18)
PLN	8.152.078	EUR	1.772.544	15/12/2021	(33.828)	(0,00)
PLN	6.306.591	USD	1.650.596	15/12/2021	(115.769)	(0,02)
SEK	8.819.536	EUR	880.192	15/12/2021	(23.324)	(0,00)
SEK	187.814.352	USD	21.348.576	15/12/2021	(508.000)	(0,09)
SGD	1.387.885	USD	1.029.317	15/12/2021	(11.682)	(0,00)
THB	47.344.554	USD	1.414.808	15/12/2021	(9.835)	(0,00)
TRY	21.976.235	USD	2.262.177	15/12/2021	(595.047)	(0,10)
USD	11.534.715	CHF	10.616.008	15/12/2021	(60.597)	(0,01)
USD	8.185.595	CNH	52.931.895	15/12/2021	(117.804)	(0,01)
USD	603.975		1.934.864	15/12/2021	(11.427)	(0,00)
ZAR	58.652.938		3.919.121	15/12/2021	(247.838)	(0,06)
ILS	3.373.828		1.078.822	22/12/2021	(5.268)	(0,00)
INR	48.833.548	USD	649.794	27/12/2021	(462)	(0,00)

Contratos	de	divisas	а	plazo -	(continuación)	)
-----------	----	---------	---	---------	----------------	---

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente en USD	% del patrimonio
USD	6.241.396	TWD	172.808.284	19/01/2022	(24.767)	(0,00)
USD	421.342	SEK	3.819.315	20/01/2022	(3.025)	(0,00)
GBP	209.634	USD	288.726	21/01/2022	(8.424)	(0,00)
NOK	5.016.446	USD	584.020	25/01/2022	(29.803)	(0,01)
AUD	906.366	USD	671.217	31/01/2022	(21.687)	(0,00)
CAD	1.429.696	USD	1.134.593	31/01/2022	(14.498)	(0,00)
USD	11.954.203	JPY	1.353.209.858	31/01/2022	(75.610)	(0,01)
CLP	810.012.703	USD	1.003.595	07/02/2022	(41.150)	(0,01)
IDR	11.327.221.348	USD	786.831	10/02/2022	(1.185)	(0,00)
RUB	130.050.490	USD	1.799.566	10/02/2022	(71.417)	(0,01)
USD	9.584.575	EUR	8.480.274	10/02/2022	(86.679)	(0,02)
USD	109.330.354	JPY	12.593.587.467	11/04/2022	(2.708.278)	(0,46)
TRY	10.996.667	USD	1.049.000	14/06/2022	(293.908)	(0,05)
MINUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRA	ATOS DE DIVISA	AS A PLAZO		(9.812.954)	(1,67)

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones - (2,94 %)

Divisa	Compra Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalia latente en USD	% del patrimonio
USD	9.779.862 GBP	7.212.198	21/01/2022	136.405	0,03
USD	201.505 AUD	276.392	31/01/2022	3.434	0,00
EUR	2.258.983 USD	2.550.830	10/02/2022	25.407	0,00

PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA	

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente en USD	% del patrimonio
GBP	429.300.367	USD	590.758.089	21/01/2022	(16.738.948)	(2,87)
AUD	25.092.004	USD	18.580.755	31/01/2022	(599.064)	(0,10)
USD	20.943	EUR	18.596	10/02/2022	(265)	(0,00)
MINUSVALÍA LA	ATENTE SOBRE CONTRA	ATOS DE D	DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA		(17.338.277)	(2,97)

Opciones - (0,52 %)

				Piusvalia/ valo	r de mercado	
Tenencias	Descripción del valor			(minusvalía) latente en USD	en USD	% de patrimonio
enencias	•			030	030	patrimonic
	Opciones adquiridas EUR					
1.763.000	Put EUR / Call PLN	Vence 02/12/2021	Precio de ejercicio 4,56	(4.604)	2	0,00
1.763.000	Put EUR / Call PLN	Vence 02/12/2021	Precio de ejercicio 4,56	(5.324)	2	0,00
14.220.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,12	(24.830)	20.517	0,00
15.501.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,12	(47.720)	15.962	0,00
13.983.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	(8.213)	50.675	0,01
13.987.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,14	25.307	79.226	0,02
			-	(65.384)	166.384	0,03
	GBP					
24.460.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,28	(38.858)	7.872	0,00
31.960.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,30	(51.282)	10.922	0,00
29.610.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,42	(48.518)	15.665	0,00
27.050.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,46	(42.987)	16.189	0,00
31.910.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 11/10/2022	Precio de ejercicio 0,92	(10.864)	76.231	0,01
25.170.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 13/10/2022	Precio de ejercicio 0,93	(9.295)	61.687	0,01
29.810.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 15/11/2022	Precio de ejercicio 0,52	(47.303)	22.728	0,01
27.150.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,54	(41.241)	22.619	0,01
			•	(290.348)	233.913	0,04
	JPY					
668.400.000	Put Swaption del LIBOR a 6 meses	Vence 26/05/2022	Precio de ejercicio 0,43	(71.743)	44.826	0,01
	USD					
26.510.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 0,63	(68.356)	5.755	0,00
26.250.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 07/01/2022	Precio de ejercicio 0,61	(67.921)	8.140	0,00
26.980.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/02/2022	Precio de ejercicio 0,47	(29.098)	5.256	0,00
26.510.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/03/2022	Precio de ejercicio 0,86	(64.118)	56.620	0,01
16.220.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 21/06/2022	Precio de ejercicio 1,05	(65.325)	79.398	0,0
20.600.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 14/11/2022	Precio de ejercicio 0,70	(160.842)	47.660	0,01
4.008.000	Call USD / Put ILS	Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 3,11	67.892	82.565	0,01

165.246

0,03

Opciones – (cont	adoion)			Plusvalía/		
enencias	Descripción del valor			(minusvalía) latente en USD	Valor de mercado en USD	% de
	Opciones adquiridas – (continuación)					
	USD - (continuación)					
4.020.000	Call USD / Put ILS	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 3,13	41.446	57.285	0,0
4.010.000	Call USD / Put ILS	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 3,14	38.665	54.664	0,0
7.972.000	Call USD / Put INR	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 75,26	16.622	38.545	0,0
3.041.000	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 15,90	8.910	34.394	0,0
6.015.000	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 16,15	(13.997)	29.245	0,0
OTAL DE OPCION	NES ADQUIRIDAS			(296.122)	499.527	0,0
oste USD 1.668.2					944.650	0,1
	Opciones suscritas EUR					
(7.630.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 0,20	(27.590)	(85.261)	(0,0
(7.630.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 0,19	(32.353)	(86.909)	(0,01
(7.630.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 0,23	(63.199)	(120.536)	(0,0
(7.630.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 06/01/2022	Precio de ejercicio 0,18	(25.284)	(90.265)	(0,0
(5.340.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(15.793)	(97.706)	(0,02
(5.340.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(23.345)	(97.706)	(0,0
(6.600.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(15.251)	(120.760)	(0,0
(4.950.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(6.869)	(90.570)	(0,0
(4.950.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	1.310	(90.570)	(0,0
(4.960.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(6.883)	(90.753)	(0,0
(4.960.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(6.883)	(90.753)	(0,0
(5.330.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	(30.458)	(118.697)	(0,0
(4.400.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	(24.362)	(97.987)	(0,0
(7.630.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 0,20	39.269	(18.402)	(0,0
(7.630.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 0,19	20.199	(34.356)	(0,0
(7.630.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 0,23	25.659	(31.678)	(0,0
(7.630.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 06/01/2022	Precio de ejercicio 0,18	11.089	(53.892)	(0,0
(11.780.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 26/05/2022	Precio de ejercicio 0,11	3.909	(116.528)	(0,0
(5.340.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	18.112	(51.958)	(0,0
(5.340.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	22.238	(51.958)	(0,0
(6.600.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	15.471	(64.217)	(0,0
(4.950.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(2.128)	(48.163)	(0,0
(4.950.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(1.937)	(48.163)	(0,0
(4.960.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(2.513)	(48.260)	(0,0
(4.960.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(2.513)	(48.260)	(0,0
(5.330.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	39.694	(44.430)	(0,0
(4.400.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	36.947	(36.677)	(0,0
(7.110.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	18.491	(25.767)	(0,0
(7.086.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	41.395	(25.680)	(0,0
(6.992.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,14	1.749	(39.604)	(0,0
	GBP			8.171	(2.066.466)	(0,3
(2.520.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,36	12.616	(34.035)	(0,0
(3.300.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,40	13.246	(48.994)	(0,0
(3.050.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,38	16.683	(47.455)	(0,0
(2.770.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,42	11.334	(47.902)	(0,0
(3.350.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 11/10/2022	Precio de ejercicio 1,04	(101.215)	(188.172)	(0,0
(2.650.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 13/10/2022	Precio de ejercicio 0,99	(66.282)	(137.343)	(0,0
(3.080.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 15/11/2022	Precio de ejercicio 0,55	(6.780)	(76.818)	(0,0
(2.800.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,60	(13.040)	(76.785)	(0,0
				(133.438)	(657.504)	(0,1
(0.400.555)	USD	V 00/12/22	Descio I I I I I I I			
(8.400.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 06/12/2021	Precio de ejercicio 1,58	(13.890)	(77.415)	(0,0
(8.400.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,64	(52.945)	(125.500)	(0,0
(8.400.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 1,67	(84.980)	(156.800)	(0,0
(8.610.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 1,30	56.922	(17.190)	(0,0
(8.400.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 1,60	(39.005)	(117.125)	(0,0
(8.520.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 07/01/2022	Precio de ejercicio 1,12	67.430	(8.576)	(0,0
(8.520.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/02/2022	Precio de ejercicio 0,85	27.630	(6.725)	(0,0
(8.610.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/03/2022	Precio de ejercicio 1,41	23.802	(96.937)	(0,0
(8.550.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 21/06/2022	Precio de ejercicio 1,38	26.171	(118.617)	(0,0
(4.000.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 14/11/2022	Precio de ejercicio 1,06	114.540	(93.228)	(0,0
(2.004.000)	Call USD / Put ILS	Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 3,06	(49.645)	(66.142)	(0,0
(2.010.000)	Call USD / Put ILS	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 3.08	(36.540)	(54.509)	(0.0

(36.540)

(34.991)

(54.509)

(53.698)

(0,01)

(0,01)

Precio de ejercicio 3,08

Precio de ejercicio 3,09

Vence 20/12/2021

Vence 22/12/2021

(2.010.000)

(2.005.000)

Call USD / Put ILS

Call USD / Put ILS

Opciones –	(continuación)
------------	----------------

				Plusvalía/		
Tenencias	Descripción del valor			(minusvalía) latente en Val USD	lor de mercado en USD	% del patrimonio
	Opciones suscritas – (continuación) USD – (continuación)					
(3.986.000)	Call USD / Put INR	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 74,72	(14.517)	(35.133)	(0,01)
(1.002.000)	Call USD / Put TRY	Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 12,30	(71.619)	(82.882)	(0,01)
(3.007.000)	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 15,90	3.890	(34.009)	(0,01)
(8.400.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 06/12/2021	Precio de ejercicio 1,58	50.398	(13.127)	(0,00)
(8.400.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,64	54.205	(18.350)	(0,00)
(8.400.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 1,67	44.759	(27.061)	(0,01)
(8.400.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 1,60	27.391	(50.729)	(0,01)
				99.006	(1.253.753)	(0,22)
TOTAL DE OPCION (coste USD (3.951.4					(3.977.723)	(0,68)
TOTAL DE OPCION (coste USD (2.283.2					(3.033.073)	(0,52)

Contratos de permutas financieras – (0,68 %)

Importe teórico	(0,00 /0)				Plusvalía latente en	% del
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	USD	patrimonio
	Permutas de tipos de interés					
15.570.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 2,000 %	AUD	17/03/2032	79.672	0,01
11.510.000	Fijo 5,800 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2023	88.198	0,02
4.410.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,400 %	BRL	02/01/2023	6.564	0,00
8.750.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,300 %	BRL	02/01/2024	15.434	0,00
2.770.000	Fijo 8,495 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	04/01/2027	39.294	0,01
5.250.000	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 11,230 %	BRL	04/01/2027	11.049	0,00
16.190.000	Fijo 1,000 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2023	101.716	0,02
22.270.000	Fijo 1,680 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	22/08/2028	303.019	0,05
13.740.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,500 %	CAD	14/10/2031	103.922	0,02
19.070.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,250 %	CAD	15/12/2051	316.350	0,05
2.360.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,180 %	CAD	22/08/2052	985	0,00
4.510.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,000 %	CHF	16/03/2027	19.475	0,00
20.380.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,000 %	CHF	16/03/2032	218.461	0,04
5.280.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,500 %	CHF	17/03/2032	39.348	0,01
42.242.391	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,500 %	CNY	15/09/2023	11.478	0,00
12.047.426	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,750 %	CNY	15/09/2026	12.949	0,00
4.220.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,500 %	CNY	15/12/2026	5.265	0,00
122.910.000	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	03/11/2023	154.285	0,03
270.000	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2023	75	0,00
11.932.347	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2026	43.894	0,01
18.050.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,200 %	EUR	03/11/2027	56.547	0,01
2.190.000	Fijo 0,000 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2028	23.139	0,00
5.030.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,500 %	EUR	26/11/2031	40.693	0,01
8.590.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2031	30.396	0,01
9.010.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,500 %	EUR	17/03/2032	47.008	0,01
7.281.920.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)	JPY	15/12/2026	3.844	0,00
8.895.890.000	Fijo 1,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en KRW)	KRW	16/03/2024	19.589	0,00
29.660.000	Fijo 6,200 %	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	13/12/2023	22.330	0,00
21.751.081	Fijo 6,700 %	Variable (TILE a 1 mes en MXN)	MXN	09/12/2026	26.438	0,00
8.200.000	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 3,000 %	NZD	16/09/2031	15.439	0,00
400.000	Fijo 1,700 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2026	5.329	0,00
1.430.000	Fijo 0,000 %	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	SEK	15/12/2023	3.329	0,00
243.950.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,500 %	SEK	16/03/2024	61.229	0,00
133.050.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,750 %	SEK	15/12/2031	55.740	0.01
37.520.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,730 % Fijo 1,000 %	SEK	17/03/2032	3.780	0,01
42.100.000	Fijo 0,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD	15/12/2023	95.219	0,00
131.840.000	Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD	25/07/2024	2.815	0,02
70.000	Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Fijo 1,250 %	USD	15/12/2026	2.615	0,00
	,	* '	USD		229.289	0,00
17.460.000 26.680.000	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	Fijo 1,530 %	USD	22/09/2031	158.815	0,04
	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	Fijo 1,750 %		15/12/2031		
9.125.000	Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	Fijo 7,400 %	ZAR	15/12/2031	11.102	0,00
PLUSVALÍA LATEN	TE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INT	rerés			2.480.277	0,42
	Permutas de incumplimiento crediticio	(CDS)				
1.820.000	Variable (Bonos internacionales	Fii- 4 000 %	1100	00/00/000:	40 747	2.22
0.075.000	del Estado de Indonesia)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2024	19.715	0,00
2.275.000	Variable (General Electric Co.)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2026	11.704	0,00

Importe					Plusvalía	
teórico local neto	Anagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	latente en USD	% de
local field	A pagar		DIVISA	recha de vencimiento	030	patrimoni
	Permutas de incumplimiento crediticio	, , ,				
3.110.000	Variable (Bonos internacionales del Estado		USD	20/42/2026	224	0.00
1.450.000	saudí) Variable (The Markit CMBX North	Fijo 1,000 %	090	20/12/2026	224	0,00
1.430.000	America BBB- 11 Index)	Fijo 3,000 %	USD	18/11/2054	353.478	0,06
950.000	Variable (The Markit CMBX North	•				
	America BBB- 8 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/10/2057	124.189	0,02
1.200.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index)	Fiio 2 000 9/	USD	17/10/2057	19.752	0,0
950.000	Variable (The Markit CMBX North	Fijo 3,000 %	090	17/10/2057	19.752	0,0
000.000	America BBB- 10 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/11/2059	168.571	0,03
DI LISVALÍA I ATEN	NTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMIE	NTO CREDITICIO (CDS)			697.633	0,12
FL03VALIA LATLI	TIE SOURE FERMOTAS DE INCOMPLIMIE	NTO CKEDITICIO (CD3)			037.033	0,12
	Permutas de inflación					
4.090.000	Fijo 2,250 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/10/2023	2.027	0,00
5.580.000	Fijo 3,250 %	Variable (LIBOR a 12 meses en USD)	USD	07/10/2022	64.580	0,0
PLUSVALÍA LATEN	NTE SOBRE PERMUTAS DE INFLACIÓN				66.607	0,0
TOTAL DE PLUSVA	ALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE P	ERMUTAS FINANCIERAS			3.244.517	0,5
Importe					Minusvalía	,-
importe teórico					latente en	% de
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	USD	patrimoni
	Permutas de tipos de interés					
124.950.000	Variable (BBSW a 3 meses en AUD)	Fijo 0,190 %	AUD	22/02/2023	(204.358)	(0,04
15.980.000	Variable (BBSW a 3 meses en AUD)	Fijo 0,250 %	AUD	15/12/2023	(53.787)	(0,01
132.280.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 1,250 %	AUD	15/12/2026	(1.817.929)	(0,31
20.170.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 2,000 %	AUD	15/12/2031	(260.605)	(0,05
4.960.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 10,565 %	BRL	02/01/2023	(7.261)	(0,00
12.540.000	Variable (LIBOR a 1 mes en BRL)	Fijo 7,200 %	BRL	02/01/2023	(84.922)	(0,01
850.000	Fijo 11,814 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(637)	(0,00
875.000	Fijo 11,905 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(737)	(0,00
4.530.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 4,930 %	BRL	02/01/2024	(72.014)	(0,01
7.575.412	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 9,200 %	BRL	02/01/2024	(16.490)	(0,00
31.380.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 1,560 %	CAD	22/08/2025	(272.402)	(0,05
26.290.000	Fijo 1,750 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2026	(54.960)	(0,01
20.260.000	Fijo 2,000 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2031	(242.510)	(0,04
476.578	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2023	(563)	(0,00
16.330.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/12/2026	(102.506)	(0,02
28.630.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	03/11/2027	(179.008)	(0,03
440.000	Fijo 0,000 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2031	(3.132)	(0,00
2.570.000	1 110 0,000 /6	Variable (EURIBOR a 6 meses en	LOIX	13/12/2031	(3.132)	(0,00
2.070.000	Fijo 0,750 %	EUR)	EUR	26/11/2041	(40.690)	(0,01
3.820.000	•	Variable (EURIBOR a 6 meses en			,	
	Fijo 0,250 %	EUR)	EUR	15/12/2051	(79.483)	(0,01
40.340.000	Fijo 0,500 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2026	(224.248)	(0,04
2.310.000	Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)	Fijo 4,060 %	GBP	15/12/2028	(235.505)	(0,04
27.600.000	Fijo 0,750 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2031	(198.677)	(0,03
21.530.000	Fijo 1,000 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	17/03/2032	(189.440)	(0,03
2.048.990.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)	JPY	15/12/2031	(21.306)	(0,00
1.778.560.000	Fijo 1,750 %	Variable (KWCDC a 3 meses en KRW)	KRW	15/09/2031	(38.680)	(0,01
13.190.000	Fijo 7,150 %	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	03/12/2031	(13.516)	(0,00
119.430.000	Fijo 2,000 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	16/03/2027	(148.102)	(0,03
121.730.000	Fijo 2,130 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	11/05/2031	(149.527)	(0,03
29.070.000	Fijo 2,000 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	16/03/2032	(60.207)	(0,01
328.330.000	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 0,500 %	NZD	15/09/2022	(643.588)	(0,11
13.100.000	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 1,250 %	NZD	15/12/2022	(16.261)	(0,00
30.880.000	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 1,750 %	NZD	15/12/2026	(353.268)	(0,06
11.080.000	Fijo 2,000 %	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	NZD	15/12/2031	(36.604)	(0,01
26.330.000	Fijo 0,250 %	Variable (WIBOR a 3 meses en PLN)	PLN	16/12/2021	(12.090)	(0,00
301.831	Fijo 1,750 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2023	(230)	(0,00
3.375.000	Fijo 2,000 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2031	(4.489)	(0,00
176.970.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,250 %	SEK	15/12/2026	(15.421)	(0,00
17.110.000	Fijo 0,250 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2024	(70.605)	(0,0
26.570.000	Fijo 1,000 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2027	(95.110)	(0,02
7.400.000	Fijo 2,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD	17/09/2031	(23.610)	(0,00
21.230.000	Fijo 1,630 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	22/09/2036	(216.696)	(0,0
8.360.000 79.385.364	Fijo 1,750 % Fijo 5,500 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD) Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	USD ZAR	16/03/2052 15/12/2023	(152.168)	(0,03

ZAR

15/12/2023

(14.942)

(6.428.284)

(0,00)

Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)

Fijo 5,500 %

MINUSVALÍA LATENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTERÉS

79.385.364

#### Contratos de permutas financieras - (continuación)

Importe teórico					Minusvalía latente en	% de
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	USD	patrimonio
	Permutas de incumplimiento crediticio (CE	OS)				
1.320.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Chile)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	(11.445)	(0,00
1.550.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Panamá)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	(15.506)	(0,00
3.070.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Chile)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2026	(32.648)	(0,00
1.290.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Indonesia)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(8.648)	(0,00
3.160.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de México)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(35.352)	(0,01
2.660.000	Variable (Bonos extranjeros rusos – Eurobono)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(38.537)	(0,01
MINUSVALÍA LATE	NTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMIEN	TO CREDITICIO (CDS)			(142.136)	(0,02)
	Permutas de inflación					
4.920.000	Fijo 1,920 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/11/2031	(37.877)	(0,00)
8.340.000	Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)	Fijo 4,170 %	GBP	15/11/2028	(639.104)	(0,11)
MINUSVALÍA LATE	NTE SOBRE PERMUTAS DE INFLACIÓN				(676.981)	(0,11)
TOTAL DE MINUS	/ALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE PEF	RMUTAS FINANCIERAS			(7.247.401)	(1,23
VALOR DE MERCA (coste USD 573.68	ADO DE LAS INVERSIONES 7.728)				546.732.024	93,45
OTROS ACTIVOS	Y PASIVOS				38.324.755	6,55
PATRIMONIO					585.056.779	100,00
TOTAL DE INVERS	CIONES				Valor de mercado en USD	% de
Total inversiones ex	cluyendo derivados (coste USD 575.970.943)				575.736.897	98,41
Plusvalía latente sol	bre contratos de futuros				135.936	0,02
	obre contratos de futuros				(3.499.668)	(0,60)
	bre contratos de divisas a plazo				8.380.801	1,43
	obre contratos de divisas a plazo				(9.812.954)	(1,67
	bre contratos de divisas a plazo celebrados con				165.246	0,03
	obre contratos de divisas a plazo celebrados con	n fines de cobertura			(17.338.277)	(2,97)
	e opciones compradas (coste USD 1.668.247)				944.650	0,16
	e opciones suscritas (coste USD (3.951.462)) bre contratos de permutas financieras				(3.977.723) 3.244.517	(0,68)
	contratos de permutas financieras				(7.247.401)	(1,23)
Otros activos y pasi	·				38.324.755	6,55
Patrimonio					585.056.779	100.00

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Australia & New Zealand Banking Group Ltd., Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Credit Suisse International, Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Natwest Markets Plc., Royal Bank of Canada, Standard Chartered Bank, State Street Bank & Trust y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc. y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Citibank N.A., Credit Suisse, JP Morgan Securities Inc., Merrill Lynch International, Morgan Stanley & Co. International Plc. y Norges Bank.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,65 %.

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (d) 144A. La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (e) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- $^{\rm (f)}~$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.
- (9) Los valores TBA (por confirmar) se compran sobre una vez suscrito un compromiso a plazo con un importe de principal aproximado (por lo general +/–2,5 %) y sin fecha definitiva de vencimiento. El importe real del principal y la fecha de vencimiento se determinarán tras la liquidación cuando se asignen los "pools" de hipotecas específicos.

Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolas de valores oficial Benos - 4,56,5 %   3107/2025   1,057.00	Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Valo Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	or de mercado en USD	% del patrimonio
1,00,000 am AQ 14AAP    USD   7,000 % 310772025   1,957500   Barbin   Sample   Sam	Bonos - 45,0						
1.010,000   Borno internacionales del Estado de Bardin   USD   5,625 %   18,06,003,04   93,188   Brasti   USD   6,250 %   Pern   2,002,027   236,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234,000   234		ams AG 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,000 %	31/07/2025	1.057.500	0,08
Paralle	Baréin					-	
2.150.000   Banca do Brisal S.A.   2.050   2.500   Perr.   2.068.287   340.000   BRF S.A.   USD   5.750   2.1009.2000   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.400   338.	1.010.000	Bonos internacionales del Estado de Baréin	USD	5,625 %	18/05/2034	953.188	0,08
340,000 BRF S.A.   USD   4,775 %   2401/20309   384-810		Danas de Brasil O A (d)	HOD	0.050.0/	D	0.000.007	0.47
Section   Sect							0,17 0,03
Islas Virgenes Británicas   2,592,179							0,03
							0,21
200.000   Easy Tacle Ltd	Islas Vírgenes	Británicas					
370.000   Hustrong Finance   I Co., Ltd.   USD   4,825 %   20104/2021   375,550   350,000   Hustrong Finance   I Co., Ltd.   USD   2,250 %   2304/2031   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   460,313   4	200.000	Easy Tactic Ltd.	USD	8,125 %	11/07/2024	103.000	0,01
380,000   Huarnog Finance II Co., Ltd.	110.000	Fortune Star BVI Ltd.	EUR	3,950 %	02/10/2026	119.218	0,01
		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					0,03
State Calman   720,000   Baldu, Inc.		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					0,03
Side Calmán   720 000   Baidu, Inc.   USD   3.425 %   07/04/2030   761.695   210.000   Ck Hutchison International 20 Ltd.   USD   2.500 %   08/05/2030   214.356   400.000   Ck Hutchison International 21 ttd.   USD   2.500 %   150/4/2031   408.818   400.000   Del World Crescut Itd.   USD   4.648 %   26/05/2028   449.000   1.840.000   SA Ciobal Sukuk Ltd.   USD   2.694 %   17/06/2031   1.844.600   1.840.000   SA Ciobal Sukuk Ltd.   USD   2.694 %   17/06/2031   1.844.600   2.000.000   Sanac Chinal Holdings Ltd.   USD   3.056 %   180/10/2028   300.017   202.000   30.000   Tencert Holdings Ltd.   USD   3.056 %   180/10/2028   300.017   202.000   2.000   Tencert Holdings Ltd.   USD   3.056 %   180/10/2028   300.017   202.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2.000   2	460.000	ISMC Global Ltd.	USD	2,250 %	23/04/2031		0,03
20,000 Baidu, Inc.						1.414.206	0,11
210.000   CK Hutchison International 20 Ltd.   USD   2,500 %   0505/2030   214,356		Baidu Inc	LISD	3 425 %	07/04/2030	761 695	0,06
May							0,02
1840.000 SA Global Sukuk Ltd	400.000	CK Hutchison International 21 Ltd.	USD	2,500 %	15/04/2031	408.818	0,03
200,000   Sunac China Holdings Ltd.	400.000	DP World Crescent Ltd.	USD	4,848 %	26/09/2028	449.000	0,04
280.000 Tencent Holdings Ltd. USD 3,595 % 19/01/2028 300.017 380.000 Tencent Holdings Ltd. USD 2,880 % 22/04/2031 387 938 200.000 Zhenro Properties Group Ltd. USD 5,375 % Perp. 82,350 200.000 Zhenro Properties Group Ltd. USD 7,100 % 10/09/2024 127.000 10/09/2024 127.000							0,15
380,000   Tencent Holdings Ltd.		•					0,01
270,000   Yuzhou Group Holdings Co., Ltd. (**)   USD   5,375 %   Perp.   82,350							0,02 0,03
Colombia   1,210,000   Bonos internacionales del Estado de Colombia   1,210,000   Bonos internacionales del Estado de Croacia   EUR   1,500 %   1,000,2024   1,220,000   1,000,2024   1,000,2024   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,000,2026   1,0		•					0,03
Colombia   1,210,000   Bonos internacionales del Estado de Colombia   USD   3,125 %   15,04/2031   1,088,383   2,920,000   Bonos internacionales del Estado de Colombia   USD   3,875 %   15,00/2061   2,221,748   3,310,131   2,221,748   3,310,131   2,221,748   3,310,131   2,221,748   3,310,000   Bonos internacionales del Estado de Croacia   EUR   1,500 %   17,06/2031   2,222,882   2,222,882   2,222,882   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,282   2,223,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,232   2,233,		, ,			•		0,01
1.210.000 Bonos internacionales del Estado de Colombia   USD   3.125 %   15/04/2031   1.088.383   2.920.000 Bonos internacionales del Estado de Colombia   USD   3.875 %   15/02/2061   2.221.748   3.310.131						4.713.774	0,38
2.920.000   Bonos internacionales del Estado de Colombia   USD   3,875 %   15/02/2061   2.221.748   3.310.131							
Croacia         1,940,000         Bonos internacionales del Estado de Croacia         EUR         1,500 %         17/06/2031         2,222,882           República Dominicana         198,000         Bonos internacionales de la República Dominicana         USD         8,625 %         20/04/2027         235,503         387,599         380,000         Bonos internacionales de la República Dominicana         USD         4,500 %         30/01/2030         887,599         887,599         880,000         Bonos internacionales de la República Dominicana         USD         5,875 %         30/01/2060         822,525         20/04/2027         235,503         30/01/2080         822,525         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         25         27         27         27         27         27         27							0,08
Croacia         1.940.000         Bonos internacionales del Estado de Croacia         EUR         1,500 %         17/06/2031         2.222.882           República Dominicana         USD         8,625 %         20/04/2027         235.503         387.599         887.599         880.000         Bonos internacionales de la República Dominicana         USD         4,500 %         30/01/2050         887.599         887.599         880.000         Bonos internacionales de la República Dominicana         USD         5,875 %         30/01/2060         822.525         1.945.627           Egipto         Bonos internacionales del Estado de Egipto         USD         8,150 %         20/11/2059         518.400           Francia         "15,000 Altice France S.A. 144A <sup>(c)</sup> USD         5,500 %         15/01/2028         705.169         2.200.000         Loxam SAS         EUR         3,250 %         14/01/2025         2.507.477         475.000         Loxam SAS         EUR         3,750 %         15/01/2026         546.462         3,759.108           Alemania         Lus         EUR         6,125 %         Perp.         1,230.301         1,230.301         1,230.301         2,230.000         2,250.400         2,250.400         2,250.400         2,250.400         2,250.400         2,250.400         2,250.400	2.920.000	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	3,875 %	15/02/2061		0,18
1,940,000   Bonos internacionales del Estado de Croacia   EUR   1,500 %   17/06/2031   2,222.882						3.310.131	0,26
República Dominicana		Bonos internacionales del Estado de Croacia	EUR	1.500 %	17/06/2031	2.222.882	0,18
198.000 Bonos internacionales de la República Dominicana 890.000 Bonos internacionales de la República Dominicana 890.000 Bonos internacionales de la República Dominicana 800.00 Bonos internacionales de la República Dominicana 810.00 Bonos internacionales de la República Dominicana 810.000 Bonos internacionales de la República Dominicana 810.000 Bonos internacionales de la República Dominicana 810.000 Bonos internacionales del Estado de Indonesia 810.000 Bono				,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,			
Result   R	•		USD	8,625 %	20/04/2027	235.503	0,02
Egipto   640.000   Bonos internacionales del Estado de Egipto   USD   8,150 %   20/11/2059   518.400	890.000	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	4,500 %	30/01/2030	887.599	0,07
Figipto   G40.000   Bonos internacionales del Estado de Egipto   USD   8,150 %   20/11/2059   518.400	880.000	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	5,875 %	30/01/2060	822.525	0,07
Section   Sect						1.945.627	0,16
Francia 715.000 Altice France S.A. 144A(c) 2.200.000 Loxam SAS 475.000 Loxam SAS 480.000 Commerzbank AG(d) 1.000.000 Commerzbank AG(d) 1.000.000 Deutsche Bank AG(d) 1.000.000 Deutsche Bank AG(d) 4.000.000 Deutsche Bank AG(d) 4.000 Deutsche Bank AG(d) 4.00		Ronos internacionales del Estado de Eginto	HSD	8 150 %	20/11/2059	518 400	0,04
715.000 Altice France S.A. 144A <sup>(c)</sup> 2.200.000 Loxam SAS 475.000 Loxam SAS 480.000 Loxam SAS 480.0000 Loxam SAS 480.000 Loxam SAS 480.0000 Loxam SAS 480.00000 Loxam SAS 480.0000 Loxam SAS 480.00000 Loxam SAS 480.00000 Loxam SAS 480.00000 Loxam SAS 480.00		Bollos internacionales del Estado de Egipto	000	0,130 70	20/11/2000	310.400	0,04
2.200.000   Loxam SAS   EUR   3,250 %   14/01/2025   2.507.477		Altice France S A 144A(c)	USD	5 500 %	15/01/2028	705 169	0,06
A75.000   Loxam SAS   EUR   3,750 %   15/07/2026   546.462							0,20
Alemania	475.000	Loxam SAS			15/07/2026		0,04
1.000.000   Commerzbank AG <sup>(d)</sup>   EUR   6,125 %   Perp.   1.230.301     1.600.000   Deutsche Bank AG <sup>(d)</sup>   EUR   4,625 %   Perp.   1.823.802     3.054.103     1.000.000   ReNew Power Pvt Ltd.   USD   5,875 %   05/03/2027   238.050     1.000.000   Bonos internacionales del Estado de Indonesia   USD   3,050 %   12/03/2051   781.650     870.000   Bonos internacionales del Estado de Indonesia   USD   3,350 %   12/03/2071   825.413     2.930.000   Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III   USD   2,550 %   09/06/2031   2.946.481						3.759.108	0,30
1.600.000   Deutsche Bank AG <sup>(d)</sup>   EUR   4,625 %   Perp.   1.823.802   3.054.103					_		
10dia   230.000   ReNew Power Pvt Ltd.   USD   5,875 %   05/03/2027   238.050   10donesia   810.000   Bonos internacionales del Estado de Indonesia   USD   3,050 %   12/03/2051   781.650   870.000   Bonos internacionales del Estado de Indonesia   USD   3,350 %   12/03/2071   825.413   2.930.000   Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia   USD   2,550 %   09/06/2031   2.946.481					·		0,10
India   230.000   ReNew Power Pvt Ltd.	1.000.000	Deutsche Bank AG	EUR	4,025 %	Perp.		0,14
230.000 ReNew Power Pvt Ltd.  USD 5,875 % 05/03/2027 238.050  Indonesia  810.000 Bonos internacionales del Estado de Indonesia  870.000 Bonos internacionales del Estado de Indonesia  USD 3,050 % 12/03/2051 781.650  870.000 Bonos internacionales del Estado de Indonesia  USD 3,350 % 12/03/2071 825.413  2.930.000 Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III  USD 2,550 % 09/06/2031 2.946.481	India					3.054.103	0,24
810.000       Bonos internacionales del Estado de Indonesia       USD       3,050 %       12/03/2051       781.650         870.000       Bonos internacionales del Estado de Indonesia       USD       3,350 %       12/03/2071       825.413         2.930.000       Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III       USD       2,550 %       09/06/2031       2.946.481		ReNew Power Pvt Ltd.	USD	5,875 %	05/03/2027	238.050	0,02
870.000 Bonos internacionales del Estado de Indonesia       USD       3,350 %       12/03/2071       825.413         2.930.000 Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III       USD       2,550 %       09/06/2031       2.946.481	Indonesia						
2.930.000 Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III USD 2,550 % 09/06/2031 2.946.481							0,06
							0,07
4.553.544	2.930.000	Perusanaan Penerdit SBSN Indonesia III	USD	2,550 %	09/06/2031		0,23
						4.553.544	0,36

Isla de Man	B Group Plc. <sup>(d)</sup> Island Bondco DAC 144A <sup>(c)</sup> Island Financing International Ltd.  Itras del Banco de Israel - Makam – Serie 412 Itras del Banco de Israel - Makam – Serie 622 Israel Banco de Israel - Makam – Serie 622 Israel Banco de Israel Banco de Israel	EUR USD  ILS ILS USD USD  EUR  EUR USD  JPY JPY JPY USD	6,250 % 6,625 %  4,500 %  (0,140 %) (0,120 %) 3,800 % 4,500 %  2,125 %  4,875 % 6,125 %  (0,153 %) (0,147 %) (0,158 %) 5,125 %	Perp. 15/11/2027 14/11/2022 06/04/2022 08/06/2022 13/05/2060 Perp. 30/04/2029 30/01/2032 15/06/2033	1.236.263 1.455.025 2.691.288 4.924.780 7.073.951 7.781.346 2.583.841 373.125 17.812.263 1.220.814 779.209 2.945.746 3.724.955 51.680.656 89.625.185	0,56 0,62 0,21 0,03 1,42 0,10 0,06 0,24 0,30
1.000.000 AIB 1.430.000 Moti  Isla de Man 4.852.000 Sas  Israel 22.250.000 Letr. 24.475.000 Eor. 300.000 Bon 300.000 Bon  Italia 1.100.000 Nex  Costa de Marfil 730.000 Bon 2.870.000 Bon 2.870.000 Dep 14.054.350.000 Dep 14.054.350.000 Dep 14.054.350.000 Gala 4.310.000 Gala 520.000 Gala  Kazajistán 1.320.000 Kaz  Luxemburgo 1.475.000 Altic 725.000 ARC 2.920.000 ARC 2.920.000 ARC 2.920.000 ARC 2.920.000 ARC 2.920.000 ARC 2.240.000 Tele	estion Bondco DAC 144A(c)  asol Financing International Ltd.  tras del Banco de Israel - Makam – Serie 412  tras del Banco de Israel - Makam – Serie 622  anos internacionales del Estado de Israel  anos internacionales del Estado de Israel  exi SpA  anos internacionales del Estado de Costa de Marfil  anos internacionales del Estado de Costa de Marfil  anos internacionales del Estado de Costa de Marfil  apósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028  apósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028  apósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028  apósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028  apósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1033	USD  USD  ILS ILS USD USD  EUR  USD  JPY JPY JPY	6,625 %  4,500 %  (0,140 %) (0,120 %) 3,800 % 4,500 %  2,125 %  4,875 % 6,125 %  (0,153 %) (0,147 %) (0,158 %)	15/11/2027 14/11/2022 06/04/2022 08/06/2022 13/05/2060 Perp. 30/04/2029 30/01/2032 15/06/2033	1.455.025 2.691.288 4.924.780 7.073.951 7.781.346 2.583.841 373.125 17.812.263 1.220.814 779.209 2.945.746 3.724.955	0,122 0,39 0,566 0,622 0,21 0,033 1,422 0,10 0,066 0,24 0,30 4,13
1.430.000   Motivariant	estion Bondco DAC 144A(c)  asol Financing International Ltd.  tras del Banco de Israel - Makam – Serie 412  tras del Banco de Israel - Makam – Serie 622  anos internacionales del Estado de Israel  anos internacionales del Estado de Israel  exi SpA  anos internacionales del Estado de Costa de Marfil  anos internacionales del Estado de Costa de Marfil  anos internacionales del Estado de Costa de Marfil  apósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028  apósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028  apósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028  apósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028  apósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1033	USD  USD  ILS ILS USD USD  EUR  USD  JPY JPY JPY	6,625 %  4,500 %  (0,140 %) (0,120 %) 3,800 % 4,500 %  2,125 %  4,875 % 6,125 %  (0,153 %) (0,147 %) (0,158 %)	15/11/2027 14/11/2022 06/04/2022 08/06/2022 13/05/2060 Perp. 30/04/2029 30/01/2032 15/06/2033	1.455.025 2.691.288 4.924.780 7.073.951 7.781.346 2.583.841 373.125 17.812.263 1.220.814 779.209 2.945.746 3.724.955	0,122 0,39 0,566 0,622 0,21 0,03 1,422 0,10 0,06 0,24 0,30 4,13
4.852.000 Sas   srael	tras del Banco de Israel - Makam – Serie 412 tras del Banco de Israel - Makam – Serie 622 sinos internacionales del Estado de Israel sinos internacionales del Estado de Israel sexi SpA  sinos internacionales del Estado de Costa de Marfil sinos internacionales del Estado de Costa de Marfil sinos internacionales del Estado de Costa de Marfil sepósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028 sepósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028 sepósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1033	ILS ILS USD USD  EUR  USD  JPY JPY JPY	(0,140 %) (0,120 %) 3,800 % 4,500 % 2,125 % 4,875 % 6,125 % (0,153 %) (0,147 %) (0,158 %)	06/04/2022 08/06/2022 13/05/2060 Perp. 30/04/2029 30/01/2032 15/06/2033	4.924.780 7.073.951 7.781.346 2.583.841 373.125 17.812.263 1.220.814 779.209 2.945.746 3.724.955 51.680.656	0,39 0,566 0,622 0,21 0,03 1,42 0,10 0,06 0,24 0,30 4,13
4.852.000 Sas   srael	tras del Banco de Israel - Makam – Serie 412 tras del Banco de Israel - Makam – Serie 622 sinos internacionales del Estado de Israel sinos internacionales del Estado de Israel sexi SpA  sinos internacionales del Estado de Costa de Marfil sinos internacionales del Estado de Costa de Marfil sinos internacionales del Estado de Costa de Marfil sepósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028 sepósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028 sepósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1033	ILS ILS USD USD  EUR  USD  JPY JPY JPY	(0,140 %) (0,120 %) 3,800 % 4,500 % 2,125 % 4,875 % 6,125 % (0,153 %) (0,147 %) (0,158 %)	06/04/2022 08/06/2022 13/05/2060 Perp. 30/04/2029 30/01/2032 15/06/2033	7.073.951 7.781.346 2.583.841 373.125 17.812.263 1.220.814 779.209 2.945.746 3.724.955	0,56 0,62 0,21 0,03 1,42 0,10 0,06 0,24 0,30
Srael   22.250.000   Letr   24.475.000   Bon   300.000   Bon	tras del Banco de Israel - Makam – Serie 412 tras del Banco de Israel - Makam – Serie 622 sinos internacionales del Estado de Israel sinos internacionales del Estado de Israel sexi SpA  sinos internacionales del Estado de Costa de Marfil sinos internacionales del Estado de Costa de Marfil sinos internacionales del Estado de Costa de Marfil sepósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028 sepósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028 sepósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1033	ILS ILS USD USD  EUR  USD  JPY JPY JPY	(0,140 %) (0,120 %) 3,800 % 4,500 % 2,125 % 4,875 % 6,125 % (0,153 %) (0,147 %) (0,158 %)	06/04/2022 08/06/2022 13/05/2060 Perp. 30/04/2029 30/01/2032 15/06/2033	7.073.951 7.781.346 2.583.841 373.125 17.812.263 1.220.814 779.209 2.945.746 3.724.955	0,39 0,56 0,62 0,21 0,03 1,42 0,10 0,06 0,24 0,30 4,13
22.250.000 Letr. 24.475.000 Letr. 2.260.000 Bon. 300.000 Bon.  Italia 1.100.000 Nex.  Costa de Marfil. 730.000 Bon. 2.870.000 Bon. 2.870.000 Dep. 14.054.350.000 Dep. 14.054.350.000 Dep. 14.054.350.000 Gala. 4.310.000 Gala. 520.000 Gala.  Kazajistán 1.320.000 Kaz  Luxemburgo 1.475.000 ARIC. 2.920.000 ARC. 2.920.000 ARC. 2.920.000 ARC. 2.240.000 Tele.	tras del Banco de Israel - Makam – Serie 622 unos internacionales del Estado de Israel unos internacionales del Estado de Israel exi SpA  unos internacionales del Estado de Costa de Marfil	EUR USD  JPY JPY JPY	(0,120 %) 3,800 % 4,500 % 2,125 % 4,875 % 6,125 % (0,153 %) (0,147 %) (0,158 %)	08/06/2022 13/05/2060 Perp. 30/04/2029 30/01/2032 15/06/2033	7.781.346 2.583.841 373.125 17.812.263 1.220.814 779.209 2.945.746 3.724.955	0,622 0,21 0,03 1,42 0,10 0,06 0,24 0,30
24.475.000 Letr 2.260.000 Bon 300.000 Bon 300.000 Bon  Italia 1.100.000 Nex  Costa de Marfil 730.000 Bon 2.870.000 Bon  2.870.000 Bon  2.870.000 Bon  Japón 5.816.450.000 Dep 10.086.450.000 Dep 230.000 Soft  Jersey 300.000 Gala 4.310.000 Gala 520.000 Gala  Kazajistán 1.320.000 Kaz  Luxemburgo 1.475.000 ARtic 725.000 ARtic 2.920.000 ARTic 2.920.000 ARTic 2.920.000 Gala 2.240.000 Tele	tras del Banco de Israel - Makam – Serie 622 unos internacionales del Estado de Israel unos internacionales del Estado de Israel exi SpA  unos internacionales del Estado de Costa de Marfil	EUR USD  JPY JPY JPY	(0,120 %) 3,800 % 4,500 % 2,125 % 4,875 % 6,125 % (0,153 %) (0,147 %) (0,158 %)	08/06/2022 13/05/2060 Perp. 30/04/2029 30/01/2032 15/06/2033	7.781.346 2.583.841 373.125 17.812.263 1.220.814 779.209 2.945.746 3.724.955	0,622 0,21 0,03 1,42 0,10 0,06 0,24 0,30
2.260.000 Bon 300.000 Bon 300.000 Bon 300.000 Bon  Italia 1.100.000 Nex  Costa de Marfil 730.000 Bon 2.870.000 Bon  5.816.450.000 Dep 10.086.450.000 Dep 14.054.350.000 Dep 230.000 Gala 4.310.000 Gala 520.000 Kaz  Luxemburgo 1.475.000 ARIC 725.000 ARIC 2.920.000 ARIC 2.920.000 ARIC 2.920.000 Gala 2.240.000 Tele	enos internacionales del Estado de Israel enos internacionales del Estado de Israel exi SpA  enos internacionales del Estado de Costa de Marfil enos internacionales del Estado de Costa de Marfil enos internacionales del Estado de Costa de Marfil espósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028 espósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028 espósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1033	EUR EUR USD  JPY JPY JPY	3,800 % 4,500 % 2,125 % 4,875 % 6,125 % (0,153 %) (0,147 %) (0,158 %)	30/04/2029 30/04/2029 30/01/2032 15/06/2033 25/03/2022 11/04/2022	2.583.841 373.125 17.812.263 1.220.814 779.209 2.945.746 3.724.955	0,21 0,03 1,42 0,10 0,06 0,24 0,30
Solution   Solution	exi SpA  exi	EUR EUR USD  JPY JPY JPY	4,500 %  2,125 %  4,875 % 6,125 %  (0,153 %) (0,147 %) (0,158 %)	30/04/2029 30/04/2029 30/01/2032 15/06/2033 25/03/2022 11/04/2022	373.125 17.812.263 1.220.814 779.209 2.945.746 3.724.955 51.680.656	0,03 1,42 0,10 0,06 0,24 0,30
1.100.000 Nex  Costa de Marfil 730.000 Bon 2.870.000 Bon  5.816.450.000 Dep 10.086.450.000 Dep 230.000 Soft  Jersey 300.000 Gala 4.310.000 Gala 520.000 Kaz  Luxemburgo 1.475.000 ARD 2.920.000 ARD 4.450.000 Gaz 2.240.000 Tele	onos internacionales del Estado de Costa de Marfil onos internacionales del Estado de Costa de Marfil epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1025 epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028 epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1033	EUR USD JPY JPY JPY	(0,153 %) (0,147 %) (0,158 %)	30/01/2032 15/06/2033 25/03/2022 11/04/2022	1.220.814 779.209 2.945.746 3.724.955 51.680.656	0,10 0,06 0,24 0,30
1.100.000 Nex  Costa de Marfil 730.000 Bon 2.870.000 Bon  5.816.450.000 Dep 10.086.450.000 Dep 230.000 Soft  Jersey 300.000 Gala 4.310.000 Gala 520.000 Kaz  Luxemburgo 1.475.000 ARIC 2.920.000 ARIC 2.920.000 ARIC 2.920.000 Gala 2.240.000 Tele	onos internacionales del Estado de Costa de Marfil onos internacionales del Estado de Costa de Marfil epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1025 epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028 epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1033	EUR USD JPY JPY JPY	(0,153 %) (0,147 %) (0,158 %)	30/01/2032 15/06/2033 25/03/2022 11/04/2022	779.209 2.945.746 3.724.955 51.680.656	0,06 0,24 0,30
Table   Tabl	onos internacionales del Estado de Costa de Marfil onos internacionales del Estado de Costa de Marfil epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1025 epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028 epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1033	EUR USD JPY JPY JPY	(0,153 %) (0,147 %) (0,158 %)	30/01/2032 15/06/2033 25/03/2022 11/04/2022	779.209 2.945.746 3.724.955 51.680.656	0,06 0,24 0,30
730.000 Bon 2.870.000 Bon 2.870.000 Bon 2.870.000 Bon  Japón 5.816.450.000 Dep 10.086.450.000 Dep 230.000 Gala 4.054.350.000 Gala 4.310.000 Gala 520.000 Kaz  Luxemburgo 1.475.000 ARL 2.920.000 ARL 4.540.000 Gaz 2.240.000 Tele	epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1025 epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028 epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1038 epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1033	JPY JPY JPY	(0,153 %) (0,147 %) (0,158 %)	15/06/2033 25/03/2022 11/04/2022	2.945.746 3.724.955 51.680.656	0,24 0,30 4,13
2.870.000 Bon  Japón 5.816.450.000 Dep 10.086.450.000 Dep 14.054.350.000 Gala 4.310.000 Gala 520.000 Kaz  Luxemburgo 1.475.000 ARIC 2.920.000 ARIC 4.540.000 Gaz 2.240.000 Tele	epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1025 epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028 epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1038 epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1033	JPY JPY JPY	(0,153 %) (0,147 %) (0,158 %)	15/06/2033 25/03/2022 11/04/2022	2.945.746 3.724.955 51.680.656	0,24 0,30 4,13
Japón 5.816.450.000 Dep 10.086.450.000 Dep 14.054.350.000 Dep 230.000 Soft  Jersey 300.000 Gala 4.310.000 Gala 520.000 Kaz  Kazajistán 1.320.000 Kaz  Luxemburgo 1.475.000 Altic 725.000 ARL 2.920.000 ARL 2.920.000 Gaz 2.240.000 Tele	epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1025 epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028 epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1033	JPY JPY JPY	(0,153 %) (0,147 %) (0,158 %)	25/03/2022 11/04/2022	3.724.955 51.680.656	0,30
5.816.450.000 Dep 10.086.450.000 Dep 14.054.350.000 Dep 230.000 Soft   Jersey 300.000 Gala 4.310.000 Gala 520.000 Kaz   Kazajistán 1.320.000 Kaz  Luxemburgo 1.475.000 ARti 725.000 ARTi 2.920.000 ARTi 4.540.000 Gaz 2.240.000 Tele	pósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028 epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1033	JPY JPY	(0,147 %) (0,158 %)	11/04/2022	51.680.656	4,13
5.816.450.000 Dep 10.086.450.000 Dep 14.054.350.000 Dep 230.000 Soft    Jersey 300.000 Gala 4.310.000 Gala 520.000 Kaz   Kazajistán 1.320.000 Kaz  Luxemburgo 1.475.000 Altic 725.000 ARC 2.920.000 ARC 4.540.000 Gaz 2.240.000 Tele	pósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028 epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1033	JPY JPY	(0,147 %) (0,158 %)	11/04/2022		
10.086.450.000 Dep 14.054.350.000 Dep 230.000 Gala  1.300.000 Gala 1.320.000 Kaz  Luxemburgo 1.475.000 Altic 725.000 ARC 2.920.000 Gaz 2.240.000 Tele	pósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028 epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1033	JPY JPY	(0,147 %) (0,158 %)	11/04/2022		
14.054.350.000 Dep 230.000 Soft  Jersey 300.000 Gala 4.310.000 Gala 520.000 Kaz  Kazajistán 1.320.000 Kaz  Luxemburgo 1.475.000 Altic 725.000 ARC 2.920.000 ARC 4.540.000 Gaz 2.240.000 Tele	epósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1033			31/01/2022		7,16
300.000 Gala   4.310.000 Gala   520.000 Gala	oftBank Group Corp.	USD	5 125 %		124.850.308	9,97
300.000 Gala 4.310.000 Gala 520.000 Gala  Kazajistán 1.320.000 Kaz  Luxemburgo 1.475.000 Altic 725.000 ARC 2.920.000 ARC 4.540.000 Gaz 2.240.000 Tele			3,123 /0	19/09/2027	229.138	0,02
300.000 Gala 4.310.000 Gala 520.000 Gala  Kazajistán 1.320.000 Kaz  Luxemburgo 1.475.000 Altic 725.000 ARC 2.920.000 ARC 4.540.000 Gaz 2.240.000 Tele					266.385.287	21,28
4.310.000 Gala 520.000 Gala  Kazajistán 1.320.000 Kaz  Luxemburgo 1.475.000 Altic 725.000 ARC 2.920.000 Gaz 2.240.000 Tele						
S20.000 Gala   Kazajistán	alaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,625 %	31/03/2036	293.250	0,03
Kazajistán 1.320.000 Kaz Luxemburgo 1.475.000 Altio 725.000 ARC 2.920.000 ARC 4.540.000 Gaz 2.240.000 Tele	alaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD USD	2,940 %	30/09/2040	4.272.287	0,34
1.320.000 Kaz  Luxemburgo 1.475.000 Altio 725.000 ARC 2.920.000 ARC 4.540.000 Gaz 2.240.000 Tele	alaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	03D	3,250 %	30/09/2040	521.300	0,04
1.320.000 Kaz  Luxemburgo 1.475.000 Altio 725.000 ARC 2.920.000 ARC 4.540.000 Gaz 2.240.000 Tele					0.000.007	
1.475.000 Altio 725.000 ARD 2.920.000 ARD 4.540.000 Gaz 2.240.000 Tele	zMunayGas National Co., JSC	USD	5,375 %	24/04/2030	1.516.680	0,12
725.000 ARE 2.920.000 ARE 4.540.000 Gaz 2.240.000 Tele						
2.920.000 ARE 4.540.000 Gaz 2.240.000 Tele	tice Financing S.A.	EUR	4,250 %	15/08/2029	1.617.784	0,13
4.540.000 Gaz 2.240.000 Tele	RD Finance S.A.	EUR	5,000 %	30/06/2027	839.923	0,07
2.240.000 Tele	RD Finance S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,500 %	30/06/2027	3.022.200	0,24
	azprom PJSC Via Gaz Capital S.A.	USD USD	5,150 % 7,200 %	11/02/2026 18/07/2036	4.937.250 2.461.200	0,39 0,20
	lecom Italia Capital S.A.	USD	7,200 % 7,721 %	04/06/2038	2.461.200	0,20
210.000 10.0	Nama Capital C.J. I.	002	.,,	0 110012000	13.119.857	1,05
México						
	nco Mercantil del Norte S.A. (d)	USD	5,875 %	Perp.	913.604	0,07
200.000 Cen	emex SAB de CV	USD	7,375 %	05/06/2027	218.840	0,02
460.000 Cen	emex SAB de CV	USD	5,200 %	17/09/2030	484.760	0,04
	exico City Airport Trust	USD	4,250 %	31/10/2026	425.724	0,03
	exico City Airport Trust	USD	5,500 %	31/10/2046	280.633	0,02
	exico City Airport Trust	USD	5,500 %	31/07/2047	1.949.388	0,16
	exico City Airport Trust 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	30/04/2028	760.803	0,06
	exico City Airport Trust 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	31/10/2046	193.540	0,02
	exico City Airport Trust 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	31/07/2047	241.500	0,02
	nos internacionales del Estado de México	USD	2,659 %	24/05/2031	1.794.021	0,14
	onos internacionales del Estado de México onos internacionales del Estado de México	USD USD	3,771 % 3,750 %	24/05/2061 19/04/2071	1.804.650 402.738	0,15 0,03
					9.470.201	0,76
Marruecos						
200.000 OCF	CP S.A.	USD	3,750 %	23/06/2031	193.500	0,01
340.000 OCF		USD	5,125 %	23/06/2051	321.181	0,03
	CP S.A.	USD	3,750 %	23/06/2031	387.000	0,03
360.000 OCF	CP S.A. CP S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,125 %	23/06/2051	340.074	0,03
	CP S.A.				1.241.755	0,10

				Vole	r de mercado en	0/ -1-1
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	r de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos – (con	tinuación)					
Países Bajos	ABN AMRO Bank NV <sup>(d)</sup>	EUR	4,375 %	Perp.	1.317.860	0,10
	AerCap Holdings NV <sup>(d)</sup>	USD	5,875 %	10/10/2079	1.452.874	0,10
	Greenko Dutch BV	USD	3,850 %	29/03/2026	198.970	0,02
	Lukoil Securities BV	USD	3,875 %	06/05/2030	3.959.395	0,32
	Prosus NV	USD	3,680 %	21/01/2030	857.188	0,07
	Prosus NV	USD	4,027 %	03/08/2050	570.350	0,04
	Prosus NV	USD	3,832 %	08/02/2051	180.656	0,01
	Trivium Packaging Finance BV 144A <sup>(c)</sup>	USD	5.500 %	15/08/2026	1.137.125	0,09
	Trivium Packaging Finance BV 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,500 %	15/08/2027	765.587	0,06
	Ziggo Bond Co. BV	EUR	3,375 %	28/02/2030	1.275.148	0,10
	Ziggo Bond Co. BV 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,125 %	28/02/2030	478.563	0,04
170.000	2.990 20.10 00: 21 1		5,120 75	25/52/2000	12.193.716	0,97
Nigeria						-,-:
-	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	6,125 %	28/09/2028	301.398	0,02
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	7,875 %	16/02/2032	2.935.687	0,24
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	7,375 %	28/09/2033	237.575	0,02
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	7,696 %	23/02/2038	730.825	0,06
020.000	Zonoc montaco do Zodaco do Mgona		1,000 70	25/52/2000	4.205.485	0,34
Omán					4.200.400	0,04
	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	4,750 %	15/06/2026	2.097.169	0,17
1.640.000	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	5,375 %	08/03/2027	1.688.175	0,13
					3.785.344	0,30
Catar						
730.000	Qatar Energy	USD	2,250 %	12/07/2031	720.875	0,06
2.440.000	Qatar Energy	USD	3,125 %	12/07/2041	2.450.980	0,19
2.280.000	Qatar Energy	USD	3,300 %	12/07/2051	2.341.275	0,19
					5.513.130	0,44
Rumanía						
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	3,624 %	26/05/2030	2.159.996	0,17
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	USD	3,000 %	14/02/2031	553.000	0,04
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,000 %	28/01/2032	306.466	0,03
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	3,375 %	28/01/2050	576.421	0,05
2.590.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	USD	4,000 %	14/02/2051	2.526.868	0,20
					6.122.751	0,49
Sudáfrica 1 470 000	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	4,300 %	12/10/2028	1.463,205	0,12
	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	4,850 %	30/09/2029	1.453.338	0,12
					2.916.543	0,23
España						
	Banco Santander S.A. (d)	EUR	4,375 %	Perp.	1.156.625	0,09
1.000.000	CaixaBank S.A. <sup>(d)</sup>	EUR	5,875 %	Perp.	1.274.962	0,10
		•			2.431.587	0,19
Supranacional	les					
730.000	African Export-Import Bank	USD	2,634 %	17/05/2026	732.234	0,06
1.190.000	African Export-Import Bank	USD	3,798 %	17/05/2031	1.209.266	0,10
200.000	African Export-Import Bank 144A(c)	USD	2,634 %	17/05/2026	200.612	0,01
		•			2.142.112	0,17
Suecia						
1.100.000	Heimstaden Bostad AB <sup>(d)</sup>	EUR	3,625 %	Perp.	1.239.808	0,10
Suiza	Cradit Svices Craws AC 444A(c)(d)	Heb	E 250 0/	Dom	2 240 750	0.26
	Credit Suisse Group AG 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	5,250 %	Perp.	3.310.750	0,26
Turquía 1.370.000	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	4,250 %	14/04/2026	1.250.913	0,10
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	5,250 %	13/03/2030	652.064	0,05
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	5,950 %	15/01/2031	226.562	0,03
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	5,875 %	26/06/2031	414.000	0,02
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	5,750 %	11/05/2047	611.996	0,05
, 55.500	200000000000000000000000000000000000000	000	5,. 55 70		3550	3,30

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Valor Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	de mercado en USD	% del patrimonio
Bonos – (con	<del>-</del>					<b>F</b>
Turquía – (con	•					
	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO	USD	8,125 %	28/03/2024	208.681	0,02
1.930.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO	USD	5,250 %	05/02/2025	1.846.170	0,15
		,			5.210.386	0,42
Ucrania	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	7,750 %	01/09/2024	1.132.421	0,09
	Bonos internacionales del Estado de Octania	USD	6,876 %	21/05/2029	1.146.975	0,09
	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	EUR	4,375 %	27/01/2030	2.007.612	0,16
	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	7,253 %	15/03/2033	383.350	0,03
		,			4.670.358	0,37
Emiratos Árab	as Unidos					
	Bonos internacionales del Estado de Abu Dabi	USD	3,875 %	16/04/2050	2.543.137	0,20
	DP World Plc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,850 %	02/07/2037	197.438	0,02
			·		2.740.575	0,22
Reino Unido						
	Gazprom PJSC Via Gaz Finance Plc.	USD	3,250 %	25/02/2030	416.040	0,03
	Vedanta Resources Ltd.	USD	6,125 %	09/08/2024	517.901	0,04
	Virgin Media Secured Finance Plc. 144A(c)	USD	5,500 %	15/05/2029	3.223.825	0,26
	Virgin Money UK Plc. (d)	GBP	9,250 %	Perp.	1.222.867	0,10
				·	5.380.633	0,43
Estados Unido	ne .				0.000.000	
	American Axle & Manufacturing, Inc.	USD	6,250 %	15/03/2026	739.350	0,06
	Apache Corp.	USD	4,625 %	15/11/2025	720.963	0,06
3.300.000	B&G Foods, Inc.	USD	5,250 %	01/04/2025	3.350.576	0,27
735.000	B&G Foods, Inc.	USD	5,250 %	15/09/2027	742.394	0,06
1.210.000	Buckeye Partners LP	USD	4,350 %	15/10/2024	1.252.350	0,10
	Buckeye Partners LP	USD	3,950 %	01/12/2026	2.536.000	0,20
	Chemours Co.	USD	5,375 %	15/05/2027	897.750	0,07
	Cheniere Energy Partners LP	USD	4,500 %	01/10/2029	2.417.875	0,19
	Citigroup Global Markets Holdings, Inc. (d)	USD	3,872 %	20/09/2023	4.090.608	0,33
	Cleveland-Cliffs, Inc. DISH DBS Corp.	USD USD	5,875 % 5,875 %	01/06/2027 15/07/2022	936.675 1.876.594	0,07 0,15
	DISH DBS Corp.	USD	5,875 %	15/11/2024	733.156	0,15
	DISH DBS Corp.	USD	7,750 %	01/07/2026	719.250	0,06
	DISH DBS Corp.	USD	7,375 %	01/07/2028	1.052.828	0,08
	Encompass Health Corp.	USD	4,500 %	01/02/2028	1.309.750	0,10
1.922.000	Genesis Energy LP Via Genesis Energy Finance Corp.	USD	7,750 %	01/02/2028	1.890.767	0,15
3.315.000	Global Partners LP Via GLP Finance Corp.	USD	7,000 %	01/08/2027	3.431.025	0,27
	Griffon Corp.	USD	5,750 %	01/03/2028	691.775	0,06
	Hilton Domestic Operating Co., Inc.	USD	4,875 %	15/01/2030	1.916.066	0,15
	Icahn Enterprises LP Via Icahn Enterprises Finance Corp.	USD	4,750 %	15/09/2024	2.534.700	0,20
	iHeartCommunications, Inc.	USD	8,375 %	01/05/2027	699.913	0,06
	Kraft Heinz Foods Co. Kraft Heinz Foods Co.	USD	5,000 %	15/07/2035	3.287.932	0,26
	Kraft Heinz Foods Co. Kraft Heinz Foods Co.	USD USD	4,375 % 4,875 %	01/06/2046 01/10/2049	1.067.572 2.142.005	0,09 0,17
	Lumen Technologies, Inc. – Serie T	USD	5,800 %	15/03/2022	2.154.712	0,17
	Mercer International, Inc.	USD	5,500 %	15/01/2026	1.494.693	0,12
	MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.	USD	4,625 %	01/08/2029	2.889.416	0,23
	Navient Corp.	USD	6,750 %	25/06/2025	1.192.125	0,09
975.000	Navient Corp.	USD	5,000 %	15/03/2027	982.313	0,08
2.150.000	Navient Corp.	USD	5,625 %	01/08/2033	1.999.500	0,16
3.440.000	Netflix, Inc.	USD	5,500 %	15/02/2022	3.467.950	0,28
	Occidental Petroleum Corp.	USD	8,000 %	15/07/2025	1.946.500	0,16
	Occidental Petroleum Corp.	USD	6,625 %	01/09/2030	1.636.875	0,13
	Penske Automotive Group, Inc.	USD	3,500 %	01/09/2025	2.212.044	0,18
	Sprint Capital Corp.	USD	8,750 % 5,000 %	15/03/2032	3.650.025	0,29
	Starwood Property Trust, Inc. T-Mobile USA, Inc.	USD USD	5,000 % 2,875 %	15/12/2021 15/02/2031	708.326 3.095.730	0,06 0,25
	TransDigm, Inc.	USD	5,500 %	15/11/2027	382.850	0,23
	United Rentals North America, Inc.	USD	3,875 %	15/02/2031	1.338.337	0,03
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	1,250 %	30/11/2026	68.593.071	5,48
	USA Compression Partners LP Via USA Compression Finance		,			-,
	Corp.	USD	6,875 %	01/04/2026	858.900	0,07
					139.641.241	11,16

				Va	lor de mercado en	% del
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	USD	patrimonio
Bonos - (con	ntinuación)					
Venezuela	Petroleos de Venezuela S.A.	USD	6,000 %	28/10/2022	4.915.600	0,39
		030	0,000 %	20/10/2022	4.915.000	0,39
TOTAL DE BO (coste USD 63					563.947.428	45,05
	5				Valor de mercado	% del
Tenencias	Descripción del valor				en USD	patrimonio
Irlanda	versión – 0,47 %					
5.901.989	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distribución X) $^{(e)(f)}$				5.901.989	0,47
TOTAL DE FOI (coste USD 5.9	NDOS DE INVERSIÓN 901.989)				5.901.989	0,47
	LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA LORES OFICIAL 5 819 865)				569.849.417	45,52
(00010 000 04	0.010.000,			V-		
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	lor de mercado en USD	% del patrimonio
	iliarios negociados en otro mercado regulado					
Bonos – 14,1 Canadá	7 %					
	Bausch Health Cos., Inc. 144A(c)	USD	5,250 %	30/01/2030	1.122.875	0,09
2.405.000	First Quantum Minerals Ltd. 144A(c)	USD	7,250 %	01/04/2023	2.436.566	0,19
2.145.000	GFL Environmental, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,375 %	15/08/2029	2.086.012	0,17
					5.645.453	0,45
Islas Caimán						
	Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,500 %	15/09/2024	3.692.913	0,29
1.285.000	Transocean, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	11,500 %	30/01/2027	1.220.750	0,10
					4.913.663	0,39
Francia 655.000	Constellium S.E. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,625 %	15/06/2028	684.475	0,06
Luxemburgo						
_	Altice Financing S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	15/01/2028	1.705.500	0,14
	Altice France Holding S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	10,500 %	15/05/2027	2.581.200	0,21
3.050.000	Camelot Finance S.A. 144A(c)	USD	4,500 %	01/11/2026	3.172.000	0,25
3.700.000	Intelsat Jackson Holdings S.A. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,000 %	15/02/2024	3.778.625	0,30
2.650.000	Nielsen Co. Luxembourg SARL 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	01/02/2025	2.690.411	0,21
					13.927.736	1,11
Países Bajos						
1.710.000	Alcoa Nederland Holding BV 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/12/2027	1.814.738	0,15
Supranacional						
	Clarios Global LP Via Clarios US Finance Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,500 %	15/05/2027	2.422.100	0,19
	Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144		8,750 %	25/05/2024	1.808.334	0,14
	Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144		13,000 %	31/12/2025	988.115	
	Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144		8,000 %	31/12/2026	683.802	0,06
1.995.000	Titan Acquisition Ltd. Via Titan Co-Borrower LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,750 %	15/04/2026	1.997.494	0,16
					7.899.845	0,63
Suiza 2.950.000	Credit Suisse Group AG 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	4,194 %	01/04/2031	3.249.454	0,26
Reino Unido			7,107 /0	0110412001	5.2-10-104	
	eG Global Finance Plc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,750 %	07/02/2025	1.788.075	0,14
	eG Global Finance Plc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,500 %	30/10/2025	1.453.913	
					3.241.988	0,26
Estados Unido	os					
2.960.000	Acrisure LLC Via Acrisure Finance, Inc. 144A(c)	USD	7,000 %	15/11/2025	2.953.593	0,24
775.000	Albertsons Cos., Inc. Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via Albertsons LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,500 %	15/03/2026	824.523	0,07
	AIDCHOURS LLG 144A177	บอบ	7,000 %	13/03/2026	024.023	0,07

Valor de mercado en						
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>		% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
Estados Unido	s – (continuación)					
1.235.000	Albertsons Cos., Inc. Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via Albertsons LLC 144A $^{(c)}$	USD	4,625 %	15/01/2027	1.282.856	0,10
752.000	Albertsons Cos., Inc. Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via Albertsons LLC 144A $^{(c)}$	USD	4,875 %	15/02/2030	799.000	0,06
1.685.000	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp. 144A(c)	USD	6,625 %	15/07/2026	1.739.762	0,14
1.675.000	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp. 144A(c)	USD	9,750 %	15/07/2027	1.759.797	0,14
755.000	Bausch Health Americas, Inc. 144A(c)	USD	9,250 %	01/04/2026	794.638	0,06
1.495.000	Berry Global, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	15/02/2026	1.512.688	0,12
1.663.000	Booz Allen Hamilton, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	01/09/2028	1.673.394	0,13
1.878.000	Broadcom, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,137 %	15/11/2035	1.859.971	0,15
285.000	Calpine Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	15/02/2028	285.713	0,02
2.360.000	Calpine Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 %	01/02/2029	2.265.600	0,18
	Castle US Holding Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	9,500 %	15/02/2028	1.447.125	0,12
	CCO Holdings LLC Via CCO Holdings Capital Corp. 144A(c)	USD	4,250 %	01/02/2031	2.874.919	0,23
2.124.000	Change Healthcare Holdings LLC Via Change Healthcare Finance, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,750 %	01/03/2025	2.124.130	0,17
	CHS Via Community Health Systems, Inc. 144A(c)	USD	8,000 %	15/03/2026	760.344	0,06
	Continental Resources, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,750 %	15/01/2031	4.332.387	0,35
	CSC Holdings LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,750 %	15/01/2030	2.554.500	0,20
	CSC Holdings LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,375 %	15/02/2031	820.444	0,07
	Cumulus Media New Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,750 %	01/07/2026	2.233.312	0,18
	DaVita, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,750 %	15/02/2031	2.811.487	0,22
485.000	Diamond Sports Group LLC Via Diamond Sports Finance Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,375 %	15/08/2026	215.825	0,02
	Diamond Sports Group LLC Via Diamond Sports Finance Co. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,625 %	15/08/2027	294.650	0,02
	Envision Healthcare Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,750 %	15/10/2026	1.555.500	0,12
	EQT Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,625 %	15/05/2031	3.257.787	0,26
	Flex Acquisition Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,875 %	15/01/2025	1.550.295	0,12
	Flex Acquisition Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,875 %	15/07/2026	776.116	0,06
	Freedom Mortgage Corp. 144A(c)	USD	7,625 %	01/05/2026	3.194.150	0,26
	Group 1 Automotive, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	15/08/2028	774.180	0,06
	GrubHub Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	01/07/2027	3.189.375	0,26
	GTCR AP Finance, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,000 %	15/05/2027	1.574.562	0,13
	Herc Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/07/2027	2.668.344	0,21
	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,375 %	01/05/2025	144.463	0,01
	iHeartCommunications, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,250 %	15/08/2027	1.473.563	0,12
	Ingevity Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	01/11/2028	1.219.200	0,10
	IRB Holding Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,000 %	15/06/2025	1.528.695	0,12
	Iron Mountain, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,250 %	15/07/2030	3.259.500	0,26
	KBR, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	30/09/2028	1.581.322	0,13
	LABL, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,750 %	15/07/2026	721.875	0,06
	LABL, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	10,500 %	15/07/2027	757.800	0,06
	Lamb Weston Holdings, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,875 %	15/05/2028	1.910.250	0,15
	LCM Investments Holdings II LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	4,875 %	01/05/2029	1.158.625 1.798.500	0,09 0,14
	Live Nation Entertainment, Inc. 144A <sup>(c)</sup>		6,500 %	15/05/2027 15/12/2026		
	Lumen Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup> Manitowoc Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD USD	5,125 % 9,000 %	01/04/2026	724.500 922.200	0,06 0,07
		USD			3.108.462	0,07
	Match Group Holdings II LLC 144A <sup>(c)</sup> Mattel, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,625 % 5,875 %	01/06/2028 15/12/2027	1.898.325	0,25
	Molina Healthcare, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	15/11/2030	1.155.000	0,13
	Nexstar Media, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,625 %	15/07/2027	1.612.000	0,09
	Outfront Media Capital LLC Via Outfront Media Capital Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,000 %	15/08/2027	2.101.137	0,13
	Par Pharmaceutical, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,500 %	01/04/2027	758.038	0,17
	Performance Food Group, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/10/2027	1.811.250	0,14
	Prime Security Services Borrower LLC 144A(c)	USD	6,250 %	15/01/2028	1.549.340	0,14
	PTC. Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,625 %	15/02/2025	847.611	0,12
	Rocket Mortgage LLC Via Rocket Mortgage Co-Issuer, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	01/03/2031	1.621.203	0,13
	Sabre GLBL. Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	9,250 %	15/04/2025	1.831.001	0,15
	Scripps Escrow II, Inc. 144A(c)	USD	5,375 %	15/01/2031	833.250	0,13
	Scripps Escrow, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,875 %	15/07/2027	2.321.075	0,19
	Sealed Air Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,000 %	01/12/2027	577.500	0,05
	Select Medical Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,250 %	15/08/2026	1.470.000	0,03
	Sensata Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,750 %	15/02/2031	1.807.125	0,12
	Staples, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	7,500 %	15/04/2026	718.575	0,06
	State of Illinois	USD	5,100 %	01/06/2033	9.899.287	0,79
	State of Illinois	USD	7,350 %	01/07/2035	3.400.271	0,73
	Station Casinos LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,500 %	15/02/2028	2.750.861	0,22
	Summit Materials LLC Via Summit Materials Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,500 %	15/03/2027	836.697	0,07
	Summit Materials LLC Via Summit Materials Finance Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,250 %	15/01/2029	946.050	0,08
	Tenet Healthcare Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,125 %	01/10/2028	2.031.960	0,16
	Terrier Media Buyer, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,875 %	15/12/2027	2.417.187	0,19
	Twitter, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,875 %	15/12/2027	2.460.300	0,20
		-	.,			-, -

	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	or de mercado en	% del patrimonio
Bonos – (con		Divisa	Tipo de lilleres	r echa de vencimiento		patimonio
,	es – (continuación)					
	Uber Technologies, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,000 %	01/11/2026	855.211	0,07
	USI, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	6,875 %	01/05/2025	2.531.250	0,20
	Venture Global Calcasieu Pass LLC 144A(c)	USD	4,125 %	15/08/2031	924.188	0,07
	Verscend Escrow Corp. 144A(c)	USD	9,750 %	15/08/2026	1.445.105	0,12
	VICI Properties LP Via VICI Note Co., Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,500 %	15/02/2025	918.458	0,07
	Waste Pro USA, Inc. 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,500 %	15/02/2026	3.233.750	0,26
	Wolverine Escrow LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	8,500 %	15/11/2024	666.348	0,05
708.000	Wolverine Escrow LLC 144A <sup>(c)</sup>	USD	9,000 %	15/11/2026	667.290	0,05
TOTAL DE BO	NOS				135.966.565	10,86
(coste USD 175	5.312.583)				177.343.917	14,17
•	con garantía de activos emitidos o garantizados por ager	ncias – 12,34 %				
Estados Unido		HOD	0.000.0/	05/40/0007	050.040	0.00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(d)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(d)</sup>	USD USD	3,992 % 5,092 %	25/12/2027 25/12/2028	252.213 170.491	0,02 0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(d)</sup>	USD	2,238 %	01/09/2033	802	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(d)</sup>	USD	2,375 %	01/11/2034	1.324	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(d)</sup>	USD	2,375 %	01/02/2035	970	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(d)</sup>	USD	2,345 %	01/06/2035	22.924	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(d)</sup>	USD	2,125 %	01/05/2036	5.892	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(d)</sup>	USD	0,439 %	15/10/2036	33.827	0,00
20.311	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(d)	USD	0,489 %	15/12/2036	20.455	0,00
68.062	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(d)	USD	0,689 %	15/09/2037	69.232	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(d)</sup>	USD	0,939 %	15/06/2039	15.901	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(d)	USD	0,459 %	15/03/2041	86.121	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(d)	USD	5,911 %	15/05/2041	161.827	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(d)	USD	5,911 %	15/09/2043	572.807	0,05
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(d)	USD	5,511 %	15/05/2045	578.897	0,05
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(d)	USD USD	6,011 %	15/05/2045	287.225	0,02 0,05
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(d)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,911 % 5,000 %	15/05/2046 01/10/2048	646.149 23.823	0,03
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(d)</sup>	USD	5,958 %	25/10/2048	321.345	0,03
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/01/2049	252.984	0,03
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/03/2049	372.167	0,03
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/05/2049	2.667.400	0,21
642.757	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/07/2049	702.810	0,06
2.423.493	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/10/2049	2.649.919	0,21
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/12/2049	1.119.515	0,09
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	01/05/2050	992.721	0,08
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	25/06/2050	1.313.597	0,10
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	25/07/2050	137.923	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	25/07/2050	1.039.186	0,08
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	25/08/2050	112.521	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	2,000 %	25/09/2050	765.347	0,06
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD USD	4,000 % 6,050 %	25/09/2050 25/08/2033	290.499 641.478	0,02 0,05
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	2,100 %	25/12/2033	1.286.225	0,03
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,450 %	25/10/2041	374.913	0,10
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	7,550 %	25/10/2041	1.143.166	0,03
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,698 %	25/11/2041	901.071	0,07
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	7,848 %	25/11/2041	310.271	0,02
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,342 %	25/07/2049	1.239.513	0,10
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A(c)(d)	USD	1,792 %	25/01/2050	1.859.337	0,15
5.410.000	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A(c)(d)	USD	4,192 %	25/03/2050	5.587.232	0,45
525.904	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A(c)(d)	USD	3,842 %	25/08/2050	530.565	0,04
153.946	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,242 %	25/09/2050	154.886	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)</sup>	USD	5,342 %	25/09/2050	1.096.700	0,09
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	4,850 %	25/10/2050	2.442.543	0,20
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	2,650 %	25/11/2050	537.961	0,04
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	4,050 %	25/11/2050	1.190.451	0,09
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A(c)(d)	USD	7,450 %	25/11/2050	683.908	0,05
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A(c)(d)	USD	5,700 %	25/12/2050	897.061	0,07
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	4,800 %	25/01/2051	1.484.600	0,12
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD	6,842 % 5,302 %	25/08/2028	1.743.683	0,14
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD	5,392 %	25/10/2028 25/05/2030	2.494.887	0,20
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup> Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD USD	2,492 % 1,880 %	25/05/2030 01/02/2033	332.246 2.886	0,03 0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD	1,764 %	01/07/2033	24.897	0,00
20.007			2,533 %	01/04/2034		0,00
13 000	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD			13.742	

Valor de mercado er										
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>		% del patrimonio				
Obligaciones con garantía de activos emitidos o garantizados por agencias – (continuación)										
	os – (continuación)	1100	4.000.0/	04/00/0004	10.104	0.00				
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup> Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD USD	1,838 % 2,235 %	01/09/2034 01/10/2034	16.131 26.632	0,00 0,00				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(d)	USD	1,933 %	01/11/2034	1.063	0,00				
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD	2,422 %	01/11/2034	141.873	0,01				
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD	1,881 %	01/02/2035	747	0,00				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(d)	USD	2,321 %	01/02/2035	1.014	0,00				
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD	2,046 %	01/04/2035	2.688	0,00				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(d)	USD	2,185 %	01/04/2035	1.390	0,00				
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup> Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD USD	1,774 % 1,606 %	01/05/2035 01/06/2035	5.686 8.521	0,00 0,00				
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD	2,385 %	01/06/2035	2.588	0,00				
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD	2,000 %	01/08/2035	7.455	0,00				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(d)	USD	1,778 %	01/09/2035	8.310	0,00				
60.697	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD	0,492 %	25/06/2036	61.157	0,00				
71.057	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD	0,492 %	25/08/2036	71.736	0,01				
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD	0,492 %	25/08/2036	81.629	0,01				
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD	0,442 %	25/04/2037	103.042	0,01				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(d)	USD	0,542 %	25/08/2037	47.163	0,00				
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD	1,192 %	25/10/2039	9.588	0,00				
	Federal National Mortgage Association (FNMA) Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD USD	4,500 % 6,358 %	01/12/2040 25/10/2041	4.637 301.204	0,00 0,02				
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD	5,858 %	25/02/2042	202.206	0,02				
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD	6,578 %	25/07/2042	512.070	0,02				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/11/2043	10.120	0,00				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(d)	USD	6,058 %	25/02/2046	592.860	0,05				
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD	6,058 %	25/11/2047	87.943	0,01				
445.885	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(d)</sup>	USD	6,058 %	25/01/2048	75.728	0,01				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/06/2048	1.349.380	0,11				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/07/2048	915.865	0,07				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/08/2048	51.662	0,00				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/09/2048	10.599	0,00				
	Federal National Mortgage Association (FNMA) Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD USD	5,000 % 4,500 %	01/10/2048 01/11/2048	8.012 899.036	0,00 0,07				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/01/2049	902.928	0,07				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/01/2049	4.194	0,00				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/03/2049	778.214	0,07				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/04/2049	1.382.161	0,11				
828.119	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/06/2049	892.187	0,07				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/06/2049	274.050	0,02				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/12/2049	64.549	0,01				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/03/2050	2.305.999	0,18				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	25/06/2050 25/07/2050	482.091 232.874	0,04				
	Federal National Mortgage Association (FNMA) Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD USD	4,000 % 4,000 %	25/09/2050	266.392	0,02 0,02				
	Federal National Mortgage Association (FNMA) 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,350 %	25/11/2041	1.962.422	0,16				
	Federal National Mortgage Association (FNMA) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	6,250 %	25/11/2041	138.782	0,01				
	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(g)(h)</sup>	USD	4,500 %	13/12/2051	(4.300.156)	(0,34)				
8.000.000	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	5,000 %	13/12/2051	8.761.239	0,70				
5.028.194	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	6,159 %	20/02/2040	876.707	0,07				
1.182.548	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	5,589 %	20/03/2040	192.083	0,02				
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	16/12/2042	83.472	0,01				
	Government National Mortgage Association (GNMA)(d)	USD	6,059 %	20/04/2043	158.358	0,01				
	Government National Mortgage Association (GNMA)(d)	USD	6,009 %	20/06/2043	18.714	0,00				
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD USD	6,059 % 6,349 %	20/07/2043 20/07/2043	358.378 1.256.786	0,03 0,10				
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	6,009 %	20/10/2043	423.411	0,10				
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/08/2044	194.905	0,02				
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/06/2045	85.023	0,01				
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/08/2045	645.086	0,05				
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	6,109 %	20/08/2045	339.329	0,03				
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	16/09/2045	223.277	0,02				
	Government National Mortgage Association (GNMA)(d)	USD	5,609 %	20/09/2045	113.435	0,01				
	Government National Mortgage Association (GNMA)(d)	USD	5,609 %	20/09/2045	131.156	0,01				
	Government National Mortgage Association (GNMA)(d)	USD	5,629 %	20/09/2045	409.169	0,03				
	Government National Mortgage Association (GNMA)(d)	USD USD	6,109 %	20/09/2045	195.298	0,02				
	Government National Mortgage Association (GNMA) Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	4,000 % 5,609 %	20/10/2045 20/10/2045	438.551 444.108	0,03 0,04				
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	6,109 %	20/11/2045	463.424	0,04				
	Government National Mortgage Association (GNMA)(d)	USD	6,109 %	20/11/2045	859.550	0,07				
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	6,159 %	20/11/2045	561.659	0,04				
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	5,559 %	20/01/2046	480.834	0,04				

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Valor Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	de mercado en USD	% del patrimonio
Obligaciones	con garantía de activos emitidos o garantizados por agencias –	(continu	ıación)			
Estados Unido	os – (continuación)					
	Government National Mortgage Association (GNMA)(d)	USD	5,569 %	20/07/2047	69.736	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	5,609 %	20/01/2048	84.476	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	6,109 %	20/05/2048	189.061	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)(d)	USD	6,109 %	20/06/2048	119.668	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)(d)	USD	6,109 %	20/09/2048	590.261	0,05
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/10/2048	353.662	0,03
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD USD	6,059 % 6 100 %	20/10/2048 20/10/2048	244.067 664.792	0,02 0,05
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	6,109 % 5,000 %	20/12/2048	9.306.526	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/01/2049	8.376.739	0,67
	Government National Mortgage Association (GNMA)(d)	USD	6,059 %	20/01/2049	203.397	0,02
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	3,699 %	20/02/2049	354.643	0,03
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/03/2049	1.446.119	0,12
	Government National Mortgage Association (GNMA)(d)	USD	3,179 %	20/06/2049	196.019	0,02
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/06/2049	122.020	0,0
4.332.924	Government National Mortgage Association (GNMA)(d)	USD	5,959 %	20/08/2049	600.448	0,0
3.409.104	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	6,009 %	20/08/2049	532.408	0,04
5.831.641	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/10/2049	530.818	0,04
6.869.641	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/12/2049	950.843	0,08
341.907	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/12/2049	368.494	0,03
252.567	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/01/2050	27.585	0,00
1.012.223	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	5,959 %	20/02/2050	162.997	0,01
1.066.277	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/04/2050	132.925	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	5,959 %	20/04/2050	773.000	0,06
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/05/2050	621.506	0,05
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/06/2050	973.897	0,08
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(d)</sup>	USD	6,059 %	20/06/2050	642.770	0,05
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	2,500 %	20/10/2050	1.351.055	0,11
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	2,500 %	20/11/2050	124.690	0,01
50.000.000	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(h)</sup>	USD	4,500 %	20/12/2051	53.006.732	4,23
					154.504.764	12,34
TOTAL DE OB	LIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZAD	OS POR	AGENCIAS			
(coste USD 15		,00101	AGENTOIAG		154.504.764	12,34
	con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia	s = 21 6	8 %			
Islas Caimán		,.	• ,0			
	AGL CLO 1 Ltd. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	0,000 %	20/10/2034	6.920.956	0,55
	Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A(c)(d)	USD	1,182 %	18/04/2034	1.297.847	0,10
	Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,032 %	18/04/2034	1.291.740	0,10
	Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-2A "D" 144A(c)(d)	USD	3,272 %	16/07/2034	1.094.283	0,09
	CQS US CLO 2021-1A Ltd. "A" 144A(c)(d)	USD	0,000 %	20/01/2035	9.340.650	0,75
	CQS US CLO Ltd. 2021-1A "D1" 144A <sup>(c)</sup> (d)	USD	0,000 %	20/01/2035	8.175.500	0,65
	Dryden 57 CLO Ltd. 2018-57A "B" 144A(c)(d)	USD	1,506 %	15/05/2031		0,03
	Dryden 57 CLO Ltd. 2018-57A B 144A(c)(d)	USD	1,856 %	15/05/2031	3.901.213	0,31
	Gallatin CLO VIII Ltd. 2017-1A "A" 144A <sup>(c)(d)</sup>				1.892.786	
		USD	1,424 %	15/07/2027	3.345.974	0,27
	ICG US CLO Ltd. 2016-1A "CRR" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,779 %	29/04/2034	2.993.790	0,24
	MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(c)(d)	USD	1,189 %	16/07/2036	2.049.964	0,16
	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 31 Ltd. 2019-31A "DR" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,382 %	20/04/2031	1.401.000	0,11
	Ocean Trails CLO 8 144A(c)(d)	USD	3,874 %	15/07/2034	1.493.131	0,12
	Ocean Trails CLO IX 2020-9A "DR" 144A(c)(d)	USD	3,874 %	15/10/2034	4.474.017	0,36
	Ocean Trails Clo XI "D" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,852 %	20/07/2034	5.455.802	0,44
	Tikehau US CLO I Ltd. 2021-1A "E" 144A(c)(d)	USD	0,000 %	18/01/2035	960.500	0,08
	Trinitas CLO XVII 2021-17A Ltd. "D" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,613 %	20/10/2034	7.555.806	0,60
	Trinitas CLO XVIII Ltd. 2021-18A "A1" 144A(c)	USD	0,000 %	20/01/2035	18.994.300	1,52
1.700.000	Whitehorse XII Ltd. 2018-12A "C" 144A(c)(d)	USD	2,794 %	15/10/2031	1.679.491	0,14
					84.318.750	6,74
						-,-
Irlanda						_
	Magnolia Finance XI DAC 2018-3MGN "A"(d)	EUR	2,750 %	18/02/2025	3.828.648	0,30
5.062.088	Octagon Finance No 1 DAC "A"(d)	EUR	1,809 %	17/01/2023	5.587.103	0,45
					9.415.751	0,75
						-,
Jersey	PAVAL				10.0====:	
10.971.039	Saranac CLO VII Ltd. 2014-2A "A1AR" 144A(c)(d)	USD	1,390 %	20/11/2029	10.973.771	
10.971.039	Saranac CLO VII Ltd. 2014-2A "A1AR" 144A <sup>(c)(d)</sup> Saranac Clo VII Ltd. 2014-2A "BR" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD USD	1,390 % 1,910 %	20/11/2029 20/11/2029	10.973.771 6.780.332	
10.971.039						0,54
10.971.039 6.878.000					6.780.332	0,54
10.971.039 6.878.000 Reino Unido	Saranac Clo VII Ltd. 2014-2A "BR" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD .	1,910 %	20/11/2029	6.780.332 17.754.103	0,54 1,42
10.971.039 6.878.000 Reino Unido					6.780.332	0,88 0,54 1,42

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Valo Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	or de mercado en USD	% del patrimonio
•	con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agenci	as – (con	tinuación)			
	(continuación)					
	Red 2 Finance CLO 2018-1 DAC	GBP	0,000 %	20/01/2028	7.164.032	0,57
5.247.580	Stratton Mortgage Funding 2019-1 Plc. "A"(d)	GBP -	1,250 %	25/05/2051	7.034.466	0,56
					18.583.741	1,48
Estados Unido	Alternative Loan Trust 2005-26CB "A1" <sup>(d)</sup>	USD	0,592 %	25/07/2035	23.193	0,00
	Alternative Loan Trust 2005-50CB "1A1"	USD	5,500 %	25/11/2035	64.535	0,00
	Alternative Loan Trust 2005-77T1 "1A3"(d)	USD	0,492 %	25/02/2036	72.229	0,01
366.325	Alternative Loan Trust 2006-19CB "A22"	USD	6,000 %	25/08/2036	295.783	0,02
	Alternative Loan Trust 2006-19CB "A7"	USD	6,000 %	25/08/2036	191.123	0,02
	Alternative Loan Trust 2007-16CB(d)	USD	0,492 %	25/08/2037	314.426	0,03
	Alternative Loan Trust 2007-16CB "4A3"(d)	USD	0,592 %	25/08/2037	268.935	0,02 0,09
	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 "D" 144A <sup>(c)</sup> Banc of America Funding 2006-7 Trust "T2A1" <sup>(d)</sup>	USD	3,000 % 5,878 %	15/07/2049 25/10/2036	1.159.508 344.337	0,09
	Banc of America Funding 2006-H Trust "6A1"(d)	USD	0,471 %	20/10/2036	806.482	0,03
	Banc of America Funding 2006-I Trust "6A1"(d)	USD	0,471 %	20/12/2046	716.393	0,06
	Bank 2018-BNK10 "D" 144A(c)	USD	2,600 %	15/02/2061	481.098	0,04
	Bank 2018-BNK13 "D" 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,000 %	15/08/2061	737.929	0,06
	Bank 2018-BNK14 "D" 144A(c)	USD	3,000 %	15/09/2060	669.740	0,05
	Bank 2018-BNK15 "D" 144A(c)	USD	3,000 %	15/11/2061	884.774	0,07
	Bayview Commercial Asset Trust 2005-2A "A1" 144A(c)(d)	USD	0,557 %	25/08/2035	1.892.147	0,15
	Bayview Commercial Asset Trust 2005-2A "A2" 144A <sup>(c)(d)</sup> BBCMS Mortgage Trust 2017-C1 "D" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	0,617 % 3,659 %	25/08/2035 15/02/2050	379.326 555.316	0,03 0,04
	BBCMS Mortgage Trust 2018-C2 "D" 144A(c)	USD	3,000 %	15/12/2051	847.276	0,07
	BCAP LLC Trust 2007-AA1 "2A1"(d)	USD	0,272 %	25/03/2037	800.904	0,06
	BCAP LLC Trust 2007-AA3 "2A1A"(d)	USD	0,532 %	25/05/2047	939.391	0,08
	Benchmark Mortgage Trust 2018-B6 "D" 144A(c)(d)	USD	3,261 %	10/10/2051	1.239.952	0,10
	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C6 "D" 144A(c)(d)	USD	4,338 %	10/11/2049	1.095.892	0,09
	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2007-14 "A19"	USD	6,000 %	25/09/2037	172.947	0,01
	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2007-15 "2A2" Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-GC36 "C"(d)	USD	6,500 % 4,908 %	25/09/2037 10/02/2049	270.632 775.178	0,02 0,06
	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P7 "D" 144A <sup>(c)</sup>	USD	3,250 %	14/04/2050	242.976	0,00
	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(c)	USD	3,000 %	15/09/2050	1.046.615	0,08
	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-HE2 "M1"(d)	USD	0,382 %	25/08/2036	1.724.188	0,14
619.372	CitiMortgage Alternative Loan Trust Series 2006-A7 "1A1"(d)	USD	6,000 %	25/12/2036	612.944	0,05
	CitiMortgage Alternative Loan Trust Series 2007-A4 "1A5"	USD	5,750 %	25/04/2037	408.809	0,03
	COMM Mortgage Trust 2017-COR2 "D" 144A(c)	USD	3,000 %	10/09/2050	840.507	0,07
	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R03 "1M2" 144A(c)(d)	USD	2,242 %	25/09/2031	104.005	0,01
	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01 "1M2" 144A <sup>(c)(d)</sup> Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	2,142 % 6,050 %	25/01/2040 25/10/2041	433.503 1.571.028	0,03 0,13
	Countrywide Asset-Backed Certificates 2006-ABC1 "A2"(d)	USD	0,412 %	25/05/2036	19.890	0,00
	CSAIL Commercial Mortgage Trust 2018-C14 "D" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	5,088 %	15/11/2051	753.353	0,06
	CSMC 2014-USA OA LLC "E" 144A(c)	USD	4,373 %	15/09/2037	2.009.995	0,16
	DBJPM 17-C6 Mortgage Trust "D" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,227 %	10/06/2050	1.403.369	0,11
	DBJPM Mortgage Trust 16-C1 "D" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,480 %	10/05/2049	1.029.602	0,08
	Deutsche Alt-A Securities Mortgage Loan Trust Series 2007-OA2 "A1"(d)	USD	0,853 %	25/04/2047	256.748	0,02
	DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR6 "2A1A"(d)	USD	0,669 %	19/10/2045	1.769.257	0,14
	First Horizon Mortgage Pass-Through Trust 2007-AR2 "1A2"(d) GMACM Home Equity Loan Trust 2007-HE3 "2A1"(d)	USD	2,590 % 7,000 %	25/08/2037 25/09/2037	276.975 487.529	0,02 0,04
	GSAA Home Equity Trust 2006-17 "A1"(d)	USD	0,212 %	25/11/2036	392.488	0,04
	GSAA Home Equity Trust 2006-5 "2A3"(d)	USD	0,632 %	25/03/2036	172.454	0,01
	GSR Mortgage Loan Trust 2006-OA1 "2A2"(d)	USD	0,612 %	25/08/2046	3.869.374	0,31
	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-15 "3A11"(d)	USD	2,083 %	20/10/2045	1.063.650	0,08
1.101.372	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-5 "1A1A"(d)	USD	0,709 %	19/07/2045	894.093	0,07
	HarborView Mortgage Loan Trust 2006-3 "2A1A"(d)	USD	2,626 %	19/06/2036	190.250	0,02
	Home Equity Loan Trust 2007-FRE1 "2AV3"(d)	USD	0,322 %	25/04/2037	1.428.891	0,11
	Impac Secured Assets Trust 2007-1 "A2"(d)	USD	0,252 %	25/03/2037	1.539.257	0,12
	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2004-AR4 "1A"(d)  JP Morgan Alternative Loan Trust 2006-A7 "1A1"(d)	USD USD	2,678 %	25/08/2034	8.167 572 304	0,00
	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2017-C7 "D" 144A(c)	USD	0,412 % 3,000 %	25/12/2036 15/10/2050	572.394 1.077.074	0,05 0,09
	Lehman XS Trust Series 2005-7N "1A1A"(d)	USD	0,632 %	25/12/2035	703.724	0,06
	Lehman XS Trust Series 2006-14N "1A1A"(d)	USD	0,472 %	25/09/2046	2.215.973	0,18
	Lehman XS Trust Series 2007-15N "2A1"(d)	USD	0,342 %	25/08/2037	4.253.408	0,34
	Lehman XS Trust Series 2007-16N "2A2"(d)	USD	0,942 %	25/09/2047	928.055	0,07
	Luminent Mortgage Trust 2006-7 "1A1"(d)	USD	0,452 %	25/12/2036	193.338	0,02
	Luminent Mortgage Trust 2007-1 "1A1"(d)	USD	0,412 %	25/11/2036	116.787	0,01
	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2006-OA2 "1A1"(d)	USD	0,883 %	25/12/2046	314.713	0,03
	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2006-OA2 "4A1A"(d) Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C23 "D" 144A(c)(d)	USD USD	0,933 % 4,282 %	25/12/2046 15/07/2050	62.278 599.474	0,01 0,05
		UOL	4.404 70	10/07/2000	099.4/4	0.05

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Valor de mercado Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup> U	en % de SD patrimonio
-	<u> </u>		•	r echa de vencimiento.	D patrimonic
•	con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias es – (continuación)	s – (COII	unuacion)		
	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-L1 "D" 144A(c)	USD	3,000 %	15/10/2051 1.119.8	77 0,09
5.605.148	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2006-16AX "1A"(d)	USD	0,432 %	25/11/2036 1.586.1	68 0,13
1.074.516	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2007-11AR "2A3"(d)	USD	2,632 %	25/06/2037 808.6	
	RALI Series 2005-QS10 Trust "3A1"(d)	USD	0,592 %	25/08/2035 17.9	
	RALI Series 2006-QO1 Trust "3A1"(d)	USD	0,632 %	25/02/2046 613.8	
	RALI Series 2006-QO7 Trust "1A1"(d)	USD	0,883 %	25/09/2046 424.3	
	RALI Serie 2006-QS4 Trust "A9" RALI Series 2007-QH9 Trust "A1"(d)	USD	6,000 %	25/04/2036 160.8	
	RALI Series 2007-QH9 Trust "A1"(d)	USD USD	1,324 % 0,392 %	25/11/2037 2.802.7 25/02/2047 5.160.3	
	RALI Series 2007-QOT Hust #1-9  RALI Series 2007-QS1 Trust "2A8"(d)	USD	0,392 %	25/02/2047 5.160.3	
	Ready Capital Mortgage Financing LLC 2021-FL7 "A" 144A <sup>(c)</sup>	USD	1,280 %	25/11/2036 2.907.1	
	Residential Asset Securitization Trust 2005-A11CB "2A1"	USD	4,850 %	25/10/2035 1.104.1	
	SLM Student Loan Trust 2003-1 "A5A" 144A(c)(d)	USD	0,226 %	15/12/2032 18.157.2	
22.099.816	SLM Student Loan Trust 2007-2 "A4"(d)	USD	0,184 %	25/07/2022 21.773.8	66 1,74
5.326.821	SLM Student Loan Trust 2008-3 "A3"(d)	USD	1,124 %	25/10/2021 5.349.3	24 0,43
10.987.902	SLM Student Loan Trust 2008-4 "A4"(d)	USD	1,774 %	25/07/2022 11.141.7	79 0,89
5.118.966	SLM Student Loan Trust 2008-5 "A4"(d)	USD	1,824 %	25/07/2023 5.177.2	98 0,4
396.231	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust Series 2006-4 "5A1"(d)	USD	2,920 %	25/05/2036 331.5	61 0,03
558.981	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR3 "3A1"(d)	USD	0,472 %	25/02/2036 297.0	33 0,02
349.000	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 2007-BC3 "2A4"(d)	USD	0,352 %	25/05/2047 319.9	91 0,03
2.175.046	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 2007-EQ1 "A1"(d)	USD	0,522 %	25/03/2037 1.762.4	24 0,14
2.666	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR6 Trust "2A1A"(d)	USD	0,552 %	25/04/2045 2.6	50 0,00
	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR10 Trust "1A1"(d)	USD	2,843 %	25/09/2036 1.062.0	- , - , - ,
	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA2 Trust "1A"(d)	USD	0,783 %	25/03/2047 539.8	41 0,04
757.567	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2005-3 Trust "1CB3"(d)	USD	0.540.0/	25/05/2025 642.2	04 00
2 036 471	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT	บอบ	0,542 %	25/05/2035 642.3	84 0,05
2.030.471	Series 2007-OA5 Trust "A1A"(d)	USD	0,923 %	25/05/2047 1.946.2	53 0,16
120.639	Wells Fargo Alternative Loan 2007-PA6 Trust "A1"(d)	USD	2,697 %	28/12/2037 115.4	
	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C37 "D" 144A(c)(d)	USD	3,342 %	15/12/2049 466.4	
	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C38 "D" 144A(c)	USD	3,000 %	15/07/2050 632.9	
	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RB1 "D" 144A(c)	USD	3,401 %	15/03/2050 652.5	39 0,05
950.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RC1 "D" 144A(c)	USD	3,250 %	15/01/2060 889.4	02 0,07
200.000	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012-C6 "B"	USD	4,697 %	15/04/2045 200.5	83 0,02
		-		141.306.6	70 11,29
TOTAL DE OBI	LIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS NO EMITIDOS NI GARANTIA	ZADOS	POR AGENCIAS		
(coste USD 26	7.093.164)			271.379.0	15 21,68
TOTAL DE VAL (coste USD 59	ORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO 7.316.664)			603.227.6	96 48,19
Otros valores	mobiliarios				
Bonos - 0,10 %	6				
Estados Unido					
1.200.000	Novelis Corp. 144A <sup>(c)</sup>	USD	4,750 %	30/01/2030 1.218.0	00 0,10
TOTAL DE BOI	NOS				
(coste USD 1.2				1.218.0	00 0,10
TOTAL DE OTE (coste USD 1.2	ROS VALORES MOBILIARIOS 200.000)			1.218.0	00 0,10
Certificados o	de depósito – 0,40 %				
Estados Unido	os.				
	MUFG Bank Ltd.	USD	0,380 %	04/11/2022 4.998.1	19 0,40
	RTIFICADOS DE DEPÓSITO			4 000 4	40 04
(coste USD 5.0	erciales – 8,34 %			4.998.1	19 0,40
	•				
Estados Unido	S AT&T, Inc.	USD	0,000 %	14/12/2021 1.999.8	96 0,16
		USD	0,000 %	19/01/2022 3.999.0	
4.000.000 AT&T, Inc. 10.000.000 AT&T, Inc.			0,000 %	20/01/2022 9.997.6	
	AT&T, Inc.	USD USD	0,000 %	14/02/2022 4.997.7	
	Banco Santander	USD	0,000 %	20/01/2022 19.996.4	
	Chesham FNC Via Chesham LLC	USD	0,000 %	21/01/2022 3.499.3	
	Dow Chemical Company	USD	0,000 %	29/12/2021 14.997.8	
	Entergy Corp.	USD	0,000 %	06/01/2022 15.996.8	
	о, г		-,		.,

Tenencias	Descripción del valor			Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fec	Va ha de vencimiento <sup>(b)</sup>	alor de mercado en USD	% de
	erciales – (continuació	on)			·				•
	os – (continuación)	,							
9.000.000	Fidelity National Informa	ation Services		USD	0,000 %		02/12/2021	8.999.938	0,72
13.000.000	Ionic Capital II Trust			USD	0,000 %		09/02/2022	12.996.103	1,04
	Telus Corp.			USD	0,000 %		18/01/2022	1.999.564	0,16
5.000.000	Walt Disney Co.			USD _	0,000 %		26/08/2022	4.989.352	0,40
TOTAL DE EEL	ECTOS COMERCIALES							104.469.864	8,34
(coste USD 10								104.469.864	8,34
VALOR DE ME (coste USD 1.3	RCADO DE LAS INVER 353.806.769)	SIONES EXCL	UYENDO DERIVADOS					1.283.763.096	102,55
Contratos de	futuros – (0,15 %)								
							Compromiso Valor de mercado	Plusvalía	
Número de							en	latente	% de
contratos	Descripción del valor						USD	USD	patrimonio
1	<b>EUR</b> Futuros sobre bonos de	la República F	Federal de Alemania a 30 años 08/	12/2021		Larga	247.983	6.873	0,00
	USD								
			EE. UU. a 10 años 22/03/2022			Larga	273.134.250	4.393.683	0,35
PLUSVALÍA LA	ATENTE SOBRE CONTR	ATOS DE FU	TUROS					4.400.556	0,35
							Compromiso		
Número de							Valor de mercado en	Minusvalía latente	% del
contratos	Descripción del valor						USD	USD	patrimonio
	EUR								
(15)		la República F	ederal de Alemania a 10 años 08/	12/2021		Corta	(2.945.042)	(29.436)	(0,00)
. ,			Federal de Alemania a 5 años 08/1			Corta	(4.475.803)	(16.169)	(0,00)
							(7.420.845)	(45.605)	(0,00)
(12)	USD Euturos sobre bonos de	l Tosoro de EE	. UU. a largo plazo 22/03/2022			Corta	(1.943.625)	(47.081)	(0,00)
			EE. UU. a 2 años 31/03/2022			Corta	(141.927.188)	(424.631)	(0,04)
, ,			EE. UU. a 5 años 31/03/2022			Corta	(270.163.595)	(2.580.370)	(0,21)
. ,			. UU. a muy largo plazo 22/03/202	22		Corta	(15.580.500)	(535.519)	(0,04)
. ,			EE. UU. a muy largo plazo a 10 añ		)22	Corta	(127.876.406)	(2.608.772)	(0,21)
							(557.491.314)	(6.196.373)	(0,50)
MINUSVALÍA I	ATENTE SOBRE CONT	RATOS DE FL	ITUROS				,	(6.241.978)	(0,50)
	divisas a plazo – (0,0							(* /	(-,,
oominatoo ao	arrious a piazo (o,o	<i>5</i> 70,						Plusvalía	
Divisa	Compra	Divisa	Venta	a			Fecha de vencimiento	latente en USD	% del patrimonio
BRL	7.215.803	USD	1.287.270	)			02/12/2021	1.175	0,00
EUR	2.107.965	PLN	9.719.104				06/12/2021	32.106	0,00
USD	13.010.562	INR	972.399.927				07/12/2021	60.769	0,00
USD	505.182	TRY	6.415.766				10/12/2021	17.345	0,00
USD	517.800	ZAR	7.890.392				13/12/2021	23.770	0,00
USD	2.662.000	TRY	25.203.816				14/12/2021	749.135	0,06
CAD	10.018.915	EUR	6.730.246				15/12/2021	185.380	0,02
CHF	20.426.993	EUR	19.059.337				15/12/2021	615.005	0,05
CHF	26.509.612	USD	28.931.183				15/12/2021	23.882	0,00
CNH	187.249.902	USD	28.955.005				15/12/2021	418.786	0,03
EUR EUR	1.101.607 4.508.076	CAD NZD	1.587.002 7.448.423				15/12/2021 15/12/2021	11.083 38.912	0,00 0,00
EUR	3.370.882	PLN	15.500.343				15/12/2021	64.967	0,00
EUR	3.358.893	SEK	33.896.891				15/12/2021	62.295	0,00
GBP	5.738.103	EUR	6.720.776				15/12/2021	16.721	0,00
ILS	3.980.645	EUR	1.096.634				15/12/2021	17.722	0,00
JPY	576.721.122	EUR	4.480.375				15/12/2021	22.618	0,00
USD	12.089.166	AUD	16.226.380				15/12/2021	466.311	0,04
USD	56.077.333	CAD	70.783.410				15/12/2021	639.842	0,05
USD	2.604.396	CZK	57.367.691				15/12/2021	50.272	0,00
USD	143.302.394	EUR	122.744.169	9			15/12/2021	3.575.690	0,30
LICD	07.044.750	ODD	70.045.400	•			45/40/0004	0.500.470	0.04

15/12/2021

0,21

2.583.179

70.915.430

400.839.094

USD

USD

97.341.758 GBP

1.281.742 HUF

#### Contratos de divisas a plazo – (continuación)

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
	·					
USD	108.474.006	JPY	12.099.456.678	15/12/2021	997.245	0,08
USD	6.463.929	MXN	132.591.346	15/12/2021	261.902	0,03
USD	26.321.923	NOK	225.010.800	15/12/2021	1.453.098	0,13
USD	58.937.307	NZD	84.765.059	15/12/2021	978.872	0,08
USD	80.156.027	SEK	692.984.333	15/12/2021	3.259.915	0,28
USD	2.608.775	SGD	3.548.586	15/12/2021	6.854	0,00
USD	4.053.002	THB	135.720.177	15/12/2021	25.439	0,00
USD	11.652.698	TRY	106.755.130	15/12/2021	3.554.193	0,29
USD	7.548.906	ZAR	112.112.490	15/12/2021	531.407	0,04
USD	839.060	TRY	10.049.895	20/12/2021	78.435	0,00
USD	328.940	ILS	1.007.872	21/12/2021	8.255	0,00
USD	1.555.028	ILS	4.879.060	22/12/2021	2.511	0,00
ILS	11.201.009	USD	3.535.700	24/12/2021	28.913	0,00
USD	306.652	ILS	946.482	24/12/2021	5.443	0,00
TWD	59.299.429	USD	2.135.300	19/01/2022	14.944	0,00
USD	800.876	SEK	6.898.588	20/01/2022	34.368	0,00
USD	27.149.093	GBP	19.747.709	21/01/2022	744.357	0,06
USD	1.275.369	MXN	26.090.614	24/01/2022	64.240	0,01
USD	1.622.051	CHF	1.480.354	25/01/2022	2.510	0,00
USD	15.161.761	ILS	46.730.784	26/01/2022	273.506	0,02
USD	2.125.160	CAD	2.645.664	31/01/2022	52.415	0,00
USD	1.727.829	CLP	1.423.921.101	07/02/2022	35.947	0,00
EUR	1.430.887	USD	1.617.217	10/02/2022	14.625	0,00
USD	5.684.146	KRW	6.734.002.416	10/02/2022	9.073	0,00
USD	3.918.638	PLN	15.952.000	10/02/2022	52.487	0,00
USD	3.793.995	RUB	284.911.558	10/02/2022	8.006	0,00
USD	5.600.279	NZD	8.040.947	16/02/2022	107.045	0,01
USD	5.324.000	TRY	51.373.938	14/06/2022	1.796.382	0,14
PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO						1,93

						% del
Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de de vencimiento	latente USD	patrimonio
USD	1.279.802	BRL	7.246.238	02/12/2021	(14.077)	(0,00)
PLN	2.019.553	EUR	439.100	06/12/2021	(7.902)	(0,00)
INR	959.158.008	USD	12.951.157	07/12/2021	(177.712)	(0,01)
USD	6.962.222	ZAR	111.214.697	09/12/2021	(5.158)	(0,00)
ZAR	130.759.350	USD	8.201.108	09/12/2021	(9.295)	(0,00)
ZAR	40.446.035	USD	2.638.529	13/12/2021	(106.139)	(0,01)
TRY	47.117.400	USD	5.324.000	14/12/2021	(1.747.985)	(0,14)
AUD	15.971.664	NZD	16.809.812	15/12/2021	(53.372)	(0,01)
AUD	83.143.493	USD	61.101.914	15/12/2021	(1.546.748)	(0,13)
CAD	55.030.847	USD	43.726.035	15/12/2021	(625.939)	(0,04)
CZK	84.212.868	EUR	3.317.431	15/12/2021	(27.095)	(0,00)
CZK	135.912.570	USD	6.290.959	15/12/2021	(239.860)	(0,02)
EUR	3.373.725	AUD	5.440.249	15/12/2021	(56.312)	(0,00)
EUR	2.251.397	CHF	2.436.102	15/12/2021	(97.933)	(0,01)
EUR	2.241.703	CZK	57.544.488	15/12/2021	(10.137)	(0,00)
EUR	1.171.068	GBP	1.005.034	15/12/2021	(9.852)	(0,00)
EUR	5.571.623	HUF	2.040.326.987	15/12/2021	(1.433)	(0,00)
EUR	4.481.536	JPY	588.728.052	15/12/2021	(127.950)	(0,01)
EUR	151.926.724	USD	175.584.883	15/12/2021	(2.638.010)	(0,23)
GBP	46.205.657	USD	62.963.496	15/12/2021	(1.222.595)	(0,10)
HUF	1.605.748.924	EUR	4.490.074	15/12/2021	(118.598)	(0,00)
HUF	363.306.024	USD	1.223.805	15/12/2021	(94.188)	(0,01)
JPY	9.753.331.704	USD	87.122.091	15/12/2021	(485.429)	(0,05)
MXN	80.901.186	USD	3.904.943	15/12/2021	(120.748)	(0,00)
NOK	68.988.385	EUR	6.736.422	15/12/2021	(43.664)	(0,00)
NOK	145.607.620	USD	16.837.252	15/12/2021	(744.288)	(0,06)
NZD	122.413.858	USD	86.891.585	15/12/2021	(3.190.636)	(0,27)
PLN	20.623.822	EUR	4.484.379	15/12/2021	(85.631)	(0,00)
PLN	15.279.216	USD	3.998.963	15/12/2021	(280.478)	(0,02)
SEK	22.209.279	EUR	2.216.481	15/12/2021	(58.724)	(0,00)
SEK	612.815.256	USD	69.678.581	15/12/2021	(1.678.328)	(0,13)
SGD	3.498.711	USD	2.594.800	15/12/2021	(29.448)	(0,00)
THB	120.967.874	USD	3.615.350	15/12/2021	(25.569)	(0,00)
TRY	55.624.227	USD	5.725.451	15/12/2021	(1.505.763)	(0,13)
USD	33.260.392	CHF	30.620.743	15/12/2021	(185.047)	(0,01)
USD	19.259.806	CNH	124.485.216	15/12/2021	(268.123)	(0,01)
USD	1.545.852	ILS	4.952.211	15/12/2021	(29.248)	(0,00)

Contratos d	e divisas a	a plazo –	(continuación)

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de de vencimiento	Minusvalía latente USD	% del patrimonio
ZAR	149.305.025	USD	9.975.853	15/12/2021	(630.348)	(0,06)
ILS	8.501.712	USD	2.718.524	22/12/2021	(13.277)	(0,00)
INR	122.843.449	USD	1.634.593	27/12/2021	(1.161)	(0,00)
USD	15.686.892	TWD	434.334.364	19/01/2022	(62.415)	(0,00)
GBP	6.240.222	USD	8.548.561	21/01/2022	(204.737)	(0,02)
MXN	26.301.876	USD	1.259.846	24/01/2022	(38.910)	(0,00)
NOK	14.341.554	USD	1.669.659	25/01/2022	(85.203)	(0,01)
AUD	2.929.600	USD	2.169.539	31/01/2022	(70.099)	(0,01)
CAD	5.231.493	USD	4.202.255	31/01/2022	(103.644)	(0,01)
USD	124.188.609	JPY	14.058.088.457	31/01/2022	(785.494)	(0,06)
ZAR	19.749.001	USD	1.279.981	03/02/2022	(52.173)	(0,00)
CLP	2.041.142.767	USD	2.528.980	07/02/2022	(103.724)	(0,01)
IDR	26.278.301.412	USD	1.825.389	10/02/2022	(2.749)	(0,00)
PLN	20.892.000	USD	5.132.158	10/02/2022	(68.741)	(0,01)
RUB	293.760.580	USD	4.064.895	10/02/2022	(161.318)	(0,01)
USD	32.241.292	EUR	28.526.563	10/02/2022	(291.577)	(0,02)
NZD	9.427.815	USD	6.513.904	16/02/2022	(73.222)	(0,01)
USD	50.556.333	JPY	5.821.046.117	25/03/2022	(1.220.063)	(0,10)
USD	87.662.422	JPY	10.091.189.623	11/04/2022	(2.113.671)	(0,17)
TRY	27.905.746	USD	2.662.000	14/06/2022	(745.837)	(0,06)
MINUSVALÍA	LATENTE SOBRE CONT	RATOS DE DIVISA		(24.497.777)	(1,96)	

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones – (1,30 %)

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
USD	14.168	SEK	123.290	20/01/2022	470	0,00
USD	11.288.387	GBP	8.313.672	21/01/2022	172.145	0,01
USD	1.043	AUD	1.445	31/01/2022	8	0,00
EUR	232.823.524	USD	262.902.925	10/02/2022	2.618.621	0,22
JPY	5.060.286.786	USD	44.462.000	16/02/2022	529.634	0,04
PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA					3.320.878	0,27

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de de vencimiento	Plusvalia latente USD	% del patrimonio
SEK	5.270.254	USD	613.242	20/01/2022	(27.660)	(0,00)
GBP	499.990.392	USD	688.034.278	21/01/2022	(19.495.239)	(1,56)
CHF	4.667.426	USD	5.113.399	25/01/2022	(7.127)	(0,00)
USD	116.352	CHF	107.068	25/01/2022	(782)	(0,00)
AUD	141.732	USD	104.953	31/01/2022	(3.384)	(0,00)
SGD	177.576	USD	131.581	07/02/2022	(1.407)	(0,00)
USD	4.687.641	EUR	4.169.698	10/02/2022	(67.654)	(0,01)
MINUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA					(19.603.253)	(1,57)

Opciones - (0,72 %)

Tenencias	Descripción del valor			Plusvalía/ (minusvalía) latente USD	Valor de mercado en USD	% del patrimonio de los Accionistas
	Opciones adquiridas EUR					
4.391.000	Put EUR / Call PLN	Vence 02/12/2021	Precio de ejercicio 4,56	(11.467)	5	0,00
4.391.000	Put EUR / Call PLN	Vence 02/12/2021	Precio de ejercicio 4,56	(13.260)	5	0,00
35.835.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,12	(62.574)	51.702	0,00
39.048.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,12	(120.209)	40.210	0,00
35.478.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	(20.838)	128.574	0,01
35.268.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,14	63.811	199.766	0,02
				(164.537)	420.262	0,03
	GBP					
75.060.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,28	(119.243)	24.157	0,00
98.080.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,30	(157.376)	33.517	0,00
89.940.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,42	(147.373)	47.582	0,00
82.150.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,46	(130.550)	49.167	0,00
100.940.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 11/10/2022	Precio de ejercicio 0,92	(34.365)	241.140	0,02
79.610.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 13/10/2022	Precio de ejercicio 0,93	(29.400)	195.108	0,02

Opciones –	(continuación)
------------	----------------

enencias	Descripción del valor			Plusvalía/ (minusvalía) latente USD	Valor de mercado en USD	patrimonio de los Accionistas
	Opciones adquiridas – (continuación) GBP – (continuación)					
94.620.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 15/11/2022	Precio de ejercicio 0,52	(150.145)	72.141	0,01
86.120.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,54	(130.815)	71.746 734.558	0,01
				(899.267)	734.556	0,00
81.070.000	USD Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 0,63	(209.039)	17.600	0,00
80.470.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 07/01/2022	Precio de ejercicio 0,61	(208.213)	24.954	0,00
82.680.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/02/2022	Precio de ejercicio 0,47	(89.170)	16.106	0,00
81.070.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/03/2022	Precio de ejercicio 0,86	(196.079)	173.150	0,01
49.790.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 21/06/2022	Precio de ejercicio 1,05	(200.525)	243.727	0,02
55.300.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 14/11/2022	Precio de ejercicio 0,70	(431.775)	127.942	0,01
10.127.000	Call USD / Put ILS	Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 3,11	171.541	208.616	0,02
10.131.000 10.101.000	Call USD / Put ILS Call USD / Put ILS	Vence 20/12/2021 Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 3,13	104.451 97.394	144.367 137.697	0,01 0,01
20.053.000	Call USD / Put INR	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 3,14 Precio de ejercicio 75,26	97.394 41.811	96.956	0,0
7.704.000	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 75,20 Precio de ejercicio 15,90	22.573	87.132	0,01
15.152.000	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 16,15	(35.259)	73.669	0,01
				(932.290)	1.351.916	0,11
OTAL DE OPCION	NES ADQUIRIDAS				2.506.736	
	Opciones suscritas				2.300.730	0,20
	EUR					
(30.590.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 0,20	(110.613)	(341.824)	(0,03
(30.590.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 0,19	(129.710)	(348.434)	(0,03
(30.590.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 0,23	(253.376)	(483.251)	(0,04
(30.590.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 06/01/2022	Precio de ejercicio 0,18	(101.367)	(361.887)	(0,03
(20.930.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(29.046)	(382.956)	(0,03
(20.920.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	5.538	(382.773)	(0,03
(20.930.000) (20.920.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13 Precio de ejercicio 0,13	(29.046) (29.032)	(382.956) (382.773)	(0,03 (0,03
(18.600.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,73	(102.985)	(414.216)	(0,03
(30.590.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 0,20	157.435	(73.777)	(0,00
(30.590.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 0,19	80.983	(137.741)	(0,01
(30.590.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 0,23	102.872	(127.003)	(0,01
(30.590.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 06/01/2022	Precio de ejercicio 0,18	44.457	(216.063)	(0,02
(20.930.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(8.996)	(203.646)	(0,02
(20.920.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(8.188)	(203.549)	(0,02
(20.930.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(10.605)	(203.646)	(0,02
(20.920.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(10.600)	(203.549)	(0,02
(18.600.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses Put EUR / Call USD	Vence 01/11/2022 Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 0,22	156.186	(155.045)	(0,01
(17.917.000) (17.851.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13 Precio de ejercicio 1,13	46.598 104.282	(64.932) (64.693)	(0,00 (0,00
(17.739.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,14	4.438	(100.478)	(0,00
(111100.000)	. 4. 20.1.7 64.1 665	701100 1071272021	1 100.0 40 0,010.0.0 1,11	(120.775)	(5.235.192)	(0,42
	GBP			( /	( , , , ,	(-)
(7.750.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,36	38.799	(104.670)	(0,01
(10.120.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,40	40.622	(150.248)	(0,01
(9.270.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,38	50.705	(144.233)	(0,01
(8.400.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,42	34.371	(145.262)	(0,01
(10.610.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 11/10/2022	Precio de ejercicio 1,04	(320.567)	(595.972)	(0,05
(8.380.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 13/10/2022	Precio de ejercicio 0,99	(209.602)	(434.315)	(0,03
(9.780.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 15/11/2022	Precio de ejercicio 0,55	(21.528)	(243.923)	(0,02
(8.890.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,60	(41.402) (428.602)	(243.792)	(0,02
	USD			· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		
(34.530.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 06/12/2021	Precio de ejercicio 1,58	(57.099)	(318.232)	(0,03
(34.530.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,64	(217.642)	(515.895)	(0,04
(34.530.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 1,67	(349.330)	(644.561)	(0,05
(26.330.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 1,30	174.071	(52.568)	(0,00
(34.530.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 1,60	(160.337)	(481.466)	(0,04
(26.110.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 07/01/2022	Precio de ejercicio 1,12	206.642	(26.282)	(0,00
	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/02/2022	Precio de ejercicio 0,85	84.674	(20.609)	(0,00
(26.110.000) (26.330.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/03/2022	Precio de ejercicio 1,41	72.790	(296.439)	(0,02

Opciones - (co	ntinuación)
----------------	-------------

Tenencias	Descripción del valor			Plusvalía/ (minusvalía) latente USD	Valor de mercado en USD	% del patrimonio de los Accionistas
	Opciones suscritas – (continuación)					
	USD – (continuación)					
(10.800.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses		ecio de ejercicio 1,06	309.259	(251.717)	(0,02)
(5.063.000)	Call USD / Put ILS		ecio de ejercicio 3,06	(125.426)	(167.104)	(0,01
(5.065.000)	Call USD / Put ILS		ecio de ejercicio 3,08	(92.077)	(137.358)	(0,01
(5.051.000)	Call USD / Put ILS		ecio de ejercicio 3,09	(88.150)	(135.276)	(0,01
(10.027.000)	Call USD / Put INR		recio de ejercicio 74,72	(36.518)	(88.378)	(0,01
(2.526.000)	Call USD / Put TRY		recio de ejercicio 12,30	(180.548)	(208.943)	(0,02
(7.576.000)	Call USD / Put ZAR		recio de ejercicio 15,90	9.800	(85.684)	(0,01
(34.530.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses		ecio de ejercicio 1,58	207.173	(53.960)	(0,00
(34.530.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses		recio de ejercicio 1,64	222.822	(75.431)	(0,01
(34.530.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses		ecio de ejercicio 1,67	183.993	(111.238)	(0,01
(34.530.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 29/12/2021 P	recio de ejercicio 1,60	112.596 356.981	(208.534)	(0,02
TOTAL DE OPCIO	ONES SUSCRITAS				(11.541.179)	
TOTAL DE OPCIO					(11.041.110)	(0,92)
(coste USD (6.84	5.953))				(9.034.443)	(0,72)
Contratos de pe	ermutas financieras – (0,76 %)					
Importe					Plusvalía	
teórico					latente en	% del
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	USD	patrimonio
	Permutas de tipos de interés					
52.130.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 2,000 %	AUD	17/03/2032	265.156	0,02
97.220.000	Fijo 5,800 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2023	744.930	0,06
8.360.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,400 %	BRL	02/01/2023	12.445	0,00
46.520.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,300 %	BRL	02/01/2024	71.951	0,01
84.720.330	Fijo 6,320 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2025	1.442.958	0,12
51.430.000	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 11,230 %	BRL	04/01/2027	63.400	0,00
54.840.000	Fijo 1,000 %	Variable (CDOR a 3 meses en CA	,	15/12/2023	344.571	0,03
91.460.000	Fijo 1,680 %	Variable (CDOR a 3 meses en CA	,	22/08/2028	1.244.682	0,10
45.870.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,500 %	CAD	14/10/2031	347.055	0,03
60.590.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,250 %	CAD	15/12/2051	940.482	0,07
9.680.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,180 %	CAD	22/08/2052	4.034	0,00
14.380.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,000 %	CHF	16/03/2027	62.096	0,00
67.690.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,000 %	CHF	16/03/2032	726.174	0,06
18.130.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,500 %	CHF	17/03/2032	135.623	0,01
337.140.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,500 %	CNY	15/09/2023	89.725	0,01
100.440.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,750 %	CNY	15/09/2026	107.963	0,01
35.900.000 268.520.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,500 %	CNY EUR	15/12/2026 03/11/2023	44.784 265.157	0,00 0,02
4.680.000	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	Fijo 0,000 % Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2023	1.310	0,02
50.871.654	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EU		15/12/2026	213.621	0,00
39.450.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,200 %	EUR	03/11/2027	44.109	0,02
7.620.000	Fijo 0,000 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en		15/12/2028	49.227	0,00
21.510.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,500 %	EUR	26/11/2031	174.090	0,00
37.020.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2031	133.458	0,01
29.910.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,500 %	EUR	17/03/2032	155.995	0,01
9.150.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,720 %	EUR	02/12/2036	31.149	0,00
9.960.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,257 %	EUR	02/12/2046	40.675	0,00
23.295.350.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en JF		15/12/2026	7.551	0,00
75.703.850.000	Fijo 1,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en KR		16/03/2024	201.930	0,02
588.260.000	Fijo 6,200 %	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	13/12/2023	442.966	0,04
158.353.064	Fijo 6,700 %	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	09/12/2026	192.365	0,02
27.960.000	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 3,000 %	NZD	16/09/2031	37.435	0,00
3.175.000	Fijo 1,700 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PL	N) PLN	15/12/2026	42.302	0,00
11.650.000	Fijo 0,000 %	Variable (STIBOR a 3 meses en S	,	15/12/2023	683	0,00
809.900.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,500 %	SEK	16/03/2024	176.702	0,01
431.780.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,750 %	SEK	15/12/2031	189.615	0,02
126.580.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 1,000 %	SEK	17/03/2032	12.798	0,00
140.380.000	Fijo 0,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en US		15/12/2023	318.815	0,03
585.360.000	Fijo 1,000 %	Fijo 1,000 %	USD	25/07/2024	12.447	0,00
80.000	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	Fijo 1,250 %	USD	15/12/2026	57	0,00
74.590.000	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	Fijo 1,530 %	USD	22/09/2031	73.524	0,01
94.690.000	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	Fijo 1,750 %	USD	15/12/2031	511.847	0,04
77.800.000	Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	Fijo 7,400 %	ZAR	15/12/2031	94.725	0,01

Contratos	de	permutas	financieras -	(continuación)

Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
	Permutas de incumplimiento crediticio	(CDS)				
9.910.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Indonesia)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2024	107.390	0,01
1.640.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Catar)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2024	13.792	0,00
700.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Catar)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	6.716	0,00
3.640.000	Variable (Bonos internacionales del Estado saudí)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	45.544	0,00
39.265.600	Variable (The Markit CDX North America High Yield 34 Version 1 Index)	Fijo 5,000 %	USD	20/06/2025	4.131.767	0,33
5.725.000	Variable (General Electric Co.)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2026	29.453	0,00
8.080.000	Variable (Bonos internacionales del Estado saudí)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	581	0,00
3.500.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 11 Index)	Fijo 3,000 %	USD	18/11/2054	767.228	0,06
3.800.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 11 Index)	Fijo 3,000 %	USD	18/11/2054	221.013	0,02
2.400.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 11 Index)	Fijo 3,000 %	USD	18/11/2054	71.618	0,01
2.750.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/10/2057	362.419	0,03
1.700.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/10/2057	77.003	0,01
1.700.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/10/2057	33.677	0,00
3.500.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/10/2057	57.611	0,01
2.400.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 10 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/11/2059	208.924	0,02
750.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 10 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/11/2059	54.867	0,00
3.900.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 10 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/11/2059	228.645	0,02
1.600.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 10 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/11/2059	50.119	0,00
PLUSVALIA LAT	ENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLI	MIENTO CREDITICIO (CDS)			6.468.367	0,52
10 700 000	Permutas de inflación	V : II (IIDOD 10 EID)	5115	45/40/0000		0.00
16.700.000 22.790.000	Fijo 2,250 % Fijo 3,250 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (LIBOR a 12 meses en USD)	EUR USD	15/10/2023 07/10/2022	8.377 263.771	0,00 0,02
	ENTE SOBRE PERMUTAS DE INFLACIÓN		03D	07/10/2022	272.148	
	SVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS D				16.813.097	1,34
Importe					Minusvalía	
teórico					latente en	% del
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	USD	patrimonio
	Permutas de tipos de interés					
381.190.000	Variable (BBSW a 3 meses en AUD)	Fijo 0,190 %	AUD	22/02/2023	(622.333)	(0,05)
53.080.000	Variable (BBSW a 3 meses en AUD)	Fijo 0,250 %	AUD	15/12/2023	(178.632)	(0,01)
440.590.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 1,250 %	AUD	15/12/2026	(6.246.477)	(0,50)
68.010.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 2,000 %	AUD	15/12/2031	(882.118)	(0,07)
11.830.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 10,565 %	BRL	02/01/2023	(17.318)	(0,00)
104.620.000	Variable (LIBOR a 1 mes en BRL)	Fijo 7,200 %	BRL	02/01/2023	(708.492)	(0,06)
7.250.000	Fijo 11,814 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(5.435)	(0,00)
7.400.000	Fijo 11,905 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(6.234)	(0,00)
9.825.000	Fijo 12,185 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(16.310)	(0,00)
30.905.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 4,930 %	BRL	02/01/2024	(492.755)	(0,04)
123.139.878	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 9,200 %	BRL	02/01/2024	(320.990)	(0,03)
24.300.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 9,900 %	BRL	04/01/2027	(23.748)	(0,00)
128.880.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 1,560 %	CAD	22/08/2025	(1.118.498)	(0,09)
83.250.000	Fijo 1,750 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2026	(187.181)	(0,01)
67.730.000	Fijo 2,000 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2031	(820.418)	(0,07)
3.288.889	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2023	(3.882)	(0,00)
57.770.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/12/2026	(365.673)	(0,03)
62.550.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	03/11/2027	(275.739)	(0,02)
1.660.000	Fijo 0,000 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2031	(11.729)	(0,00)
10.970.000	Fijo 0,750 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	26/11/2041	(173.542)	(0,01)
19.080.000	Fijo 0,531 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	02/12/2041	(83.813)	(0,01)
950.000	Fijo 0,500 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2041	(2.248)	(0,00)

#### Contratos de permutas financieras – (continuación)

Importe teórico					Minusvalía latente en	% del
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	USD	patrimonio
	Permutas de tipos de interés - (contin	uación)				
12.680.000	Fijo 0,250 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2051	(263.509)	(0,02
130.980.000	Fijo 0,500 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2026	(734.096)	(0,06
9.780.000	Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)	Fijo 4,060 %	GBP	15/12/2028	(997.009)	(0,08)
90.340.000	Fijo 0,750 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2031	(700.826)	(0,06
71.870.000	Fijo 1,000 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	17/03/2032	(631.038)	(0,05
6.865.750.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)	JPY	15/12/2031	(67.052)	(0,01
15.146.440.000	Fijo 1,750 %	Variable (KWCDC a 3 meses en KRW)	KRW	15/09/2031	(329.402)	(0,03
112.130.000	Fijo 7,150 %	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	03/12/2031	(114.897)	(0,01
339.130.000	Fijo 2,000 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	16/03/2027	(420.546)	(0,03
380.690.000	Fijo 2,130 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	11/05/2031	(422.469)	(0,03)
64.650.000	Fijo 2,000 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	16/03/2032	(133.894)	(0,01)
963.530.000	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 0,500 %	NZD	15/09/2022	(1.888.281)	(0,15)
41.590.000	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 1,250 %	NZD	15/12/2022	(51.604)	(0,00
111.660.000	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 1,750 %	NZD	15/12/2026	(1.369.994)	(0,11)
36.660.000	Fijo 2,000 %	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	NZD	15/12/2031	(121.099)	(0,01)
197.970.000	Fijo 0,250 %	Variable (WIBOR a 3 meses en PLN)	PLN	16/12/2021	(90.900)	(0,01)
2.438.422	Fijo 1,750 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2023	(1.591)	(0,00
28.700.000	Fijo 2,000 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2031	(38.200)	(0,00
642.240.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,250 %	SEK	15/12/2026	(59.144)	(0,00)
56.930.000	Fijo 0,250 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2024	(195.114)	(0,02)
82.890.000	Fijo 1,000 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2027	(296.713)	(0,02)
24.520.000	Fijo 2,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD	17/09/2031	(76.168)	(0,01)
89.670.000	Fijo 1,630 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	22/09/2036	(124.117)	(0,01)
26.680.000	Fijo 1,750 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2052	(485.680)	(0,04)
684.189.795	Fijo 5,500 %	Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	ZAR	15/12/2023	(128.748)	(0,01)
	TENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS D		2	10/12/2020	(22.305.656)	(1,78)
					(==::::::)	(-,,
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)					
3.820.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Chile)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	(33.123)	(0,00)
3.220.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Panamá)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	(32.212)	(0,00)
9.210.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Chile)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2026	(97.943)	(0,01)
13.040.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de México)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(145.882)	(0,01)
2.290.000	Variable (Bonos extranjeros rusos – Eurobono)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(33.177)	(0,00)
57.710.000	Variable (The Markit CDX Emerging Markets 36 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(1.044.710)	(0,09)
MINUSVALÍA LA	TENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMP	LIMIENTO CREDITICIO (CDS)			(1.387.047)	(0,11)
-	Permutas de inflación				,	
19.340.000	Fijo 1,920 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/11/2031	(149.020)	(0,01)
32.060.000	Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)	Fijo 4,170 %	GBP	15/11/2028	(2.457.022)	(0,20)
	TENTE SOBRE PERMUTAS DE INFLACI		-		(2.606.042)	(0,21)
TOTAL DE MINU	SVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS	DE PERMUTAS FINANCIERAS			(26.298.745)	(2,10)
	CADO DE LAS INVERSIONES				1.246.736.207	00.50
CTROS ACTIVO	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					99,59
OTROS ACTIVO	5 Y PASIVUS				5.041.919	0,41
PATRIMONIO					1.251.778.126	100,00

	Valor de mercado en	% del
TOTAL DE INVERSIONES	USD	patrimonio
Total inversiones excluyendo derivados (coste USD 1.353.806.769)	1.283.763.096	102,55
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	4.400.556	0,35
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(6.241.978)	(0,50)
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	24.114.776	1,93
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	(24.497.777)	(1,96)
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	3.320.878	0,27
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	(19.603.253)	(1,57)
Valor de mercado de opciones compradas (coste USD 4.502.830)	2.506.736	0,20
Valor de mercado de opciones suscritas (coste USD (11.348.783))	(11.541.179)	(0,92)
Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	16.813.097	1,34
Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	(26.298.745)	(2,10)
Otros activos y pasivos	5.041.919	0,41
Patrimonio	1.251.778.126	100,00

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Australia & New Zealand Banking Group Ltd., Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Credit Suisse International, Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Natwest Markets Plc., Standard Chartered Bank, State Street Bank & Trust y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc. y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Barclays Bank Plc., Citibank N.A. y Morgan Stanley & Co. International Plc.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 1,62 %.

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los típos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (d) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (e) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- $^{(f)}$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.
- (g) Estos valores representan ventas por confirmar (TBA) cubiertas con posiciones FNMA largas. Estos importes se declaran por separado en el Balance de situación como Valores hipotecarios a plazo cubiertos.
- (h) Los valores TBA (por confirmar) se compran sobre una vez suscrito un compromiso a plazo con un importe de principal aproximado (por lo general +/-2,5 %) y sin fecha definitiva de vencimiento. El importe real del principal y la fecha de vencimiento se determinarán tras la liquidación cuando se asignen los "pools" de hipotecas específicos.

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en EUR	% del patrimonio
Valores mobili Bonos – 69,75 Australia	arios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial %					
	Westpac Banking Corp. (c)	USD	2,668 %	15/11/2035	2.391.032	0,13
Austria			-			
	Bonos del Estado de Austria 144A <sup>(d)</sup>	EUR	2,100 %	Perp.	1.730.807	0,09
1.020.000	Bonos del Estado de Austria 144A <sup>(d)</sup>	EUR	0,850 %	Perp.	999.834	0,05
2.900.000	Volksbank Wien AG	EUR	0,875 %	23/03/2026	2.918.618	0,16
					5.649.259	0,30
Baréin 1 720 000	Bonos internacionales del Estado de Baréin	USD	5,625 %	18/05/2034	1.426.593	0,08
Bélgica	25.150 III.O.II.a.i.o. a.i. 25.12.0 de 20.51.			10,00,2001	20.000	
-	Bonos del Estado de Bélgica – Serie 60 144A <sup>(d)</sup>	EUR	4,250 %	28/03/2041	12.466.619	0,66
	Bonos del Estado de Bélgica – Serie 80 144A <sup>(d)</sup>	EUR	2,150 %	22/06/2066	926.664	0,05
350.000	Bonos del Estado de Bélgica – Serie 83 144A <sup>(d)</sup>	EUR	2,250 %	22/06/2057	511.749	0,03
		-			13.905.032	0,74
Brasil						
	Banco do Brasil S.A. <sup>(c)</sup>	USD	6,250 %	Perp.	888.142	0,05
	BRF S.A.	USD	4,875 %	24/01/2030	181.519	0,01
200.000	BRF S.A.	USD -	5,750 %	21/09/2050	165.673	0,01
					1.235.334	0,07
Islas Vírgenes E	Britanicas China Cinda 2020 I Management Ltd.	USD	3,000 %	20/01/2031	180.754	0,01
	Huarong Finance 2017 Co., Ltd. (c)	USD	4,000 %	Perp.	269.719	0,01
	Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	USD	3,625 %	30/09/2030	207.079	0,01
230.000	Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	4,875 %	22/11/2026	205.673	0,01
390.000	TSMC Global Ltd.	USD	2,250 %	23/04/2031	342.984	0,02
					1.206.209	0,06
Canadá						
	Bank of Nova Scotia	GBP	1,250 %	17/12/2025	5.370.182	0,29
	Bonos del Estado de Canadá Bonos del Estado de Canadá	CAD CAD	0,500 % 2,750 %	01/09/2025 01/12/2048	12.819.671 11.476.400	0,69 0,61
	Provincia de Columbia Británica, Canadá	CAD	4,300 %	18/06/2042	264.033	0,01
	Provincia de Columbia Británica, Canadá – Serie BCCD	CAD	4,950 %	18/06/2040	2.806.064	0,15
	Provincia de Ontario, Canadá	CAD	2,850 %	02/06/2023	11.479.707	0,61
10.700.000	Provincia de Ontario, Canadá	CAD	2,600 %	02/06/2025	7.651.240	0,41
1.500.000	Provincia de Ontario, Canadá	CAD	4,650 %	02/06/2041	1.356.008	0,07
	Provincia de Quebec, Canadá	CAD	4,250 %	01/12/2043	264.231	0,02
	Provincia de Quebec, Canadá	CAD	3,500 %	01/12/2045	1.557.567	0,08
2.150.000	Suncor Energy, Inc.	USD -	3,100 %	15/05/2025	1.986.914	0,11
Jalan Calmán					57.032.017	3,05
Islas Caimán 1.000.000	Baidu, Inc.	USD	3,425 %	07/04/2030	929.744	0,05
	CK Hutchison International 19 II Ltd.	USD	2,750 %	06/09/2029	183.154	0,01
	CK Hutchison International 20 Ltd.	USD	2,500 %	08/05/2030	412.656	0,02
440.000	CK Hutchison International 21 Ltd.	USD	2,500 %	15/04/2031	395.219	0,02
	DP World Crescent Ltd.	USD	4,848 %	26/09/2028	621.501	0,03
	DP World Crescent Ltd.	USD	3,875 %	18/07/2029	187.283	0,01
	SA Global Sukuk Ltd. Tencent Holdings Ltd.	USD USD	2,694 % 3,595 %	17/06/2031 19/01/2028	1.198.224 668.592	0,06 0,04
	Tencent Holdings Ltd. Tencent Holdings Ltd.	USD	2,880 %	22/04/2031	870.293	0,04
	Vale Overseas Ltd.	USD	6,250 %	10/08/2026	178.049	0,03
	Vale Overseas Ltd.	USD	3,750 %	08/07/2030	8.804	0,00
200.000	Zhenro Properties Group Ltd.	USD	7,100 %	10/09/2024	111.614	0,01
					5.765.133	0,31
China 24 620 000	Agricultural Development Rank of China Socio 1996	CNY	2 740 0/	12/07/2020	2 545 040	0.40
	Agricultural Development Bank of China – Serie 1906 Agricultural Development Bank of China – Serie 2004	CNY	3,740 % 2,960 %	12/07/2029 17/04/2030	3.515.810 12.348.223	0,19 0,66
	Agricultural Development Bank of China – Serie 2105	CNY	3,520 %	24/05/2031	6.531.270	0,35
	China Development Bank – Serie 1710	CNY	4,040 %	10/04/2027	1.816.486	0,10
	China Development Bank – Serie 1909	CNY	3,500 %	13/08/2026	6.328.291	0,34
40.610.000	China Development Bank – Serie 1915	CNY	3,450 %	20/09/2029	5.690.015	0,30

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en EUR	% del patrimonio
Bonos - (conti	inuación)					
China – (continu	•					
	China Development Bank – Serie 2010	CNY	3,090 %	18/06/2030	16.977.223	0,91
	China Development Bank – Serie 2012	CNY	3,340 %	14/07/2025	8.473.972	0,45
	China Development Bank – Serie 2103	CNY	3,300 %	03/03/2026	12.019.629	0,64
	Bonos del Estado de China	CNY	1,990 %	09/04/2025	13.091.952	0,70
	Bonos del Estado de China	CNY	2,850 %	04/06/2027	9.444.563	0,51
	Bonos del Estado de China	CNY	2,910 %	14/10/2028	16.199.839	0,87
	Bonos del Estado de China Bonos del Estado de China – Serie 1824	CNY CNY	3,390 % 4,080 %	16/03/2050 22/10/2048	3.099.779 3.060.436	0,17 0,16
	Bonos del Estado de China – Serie 1827	CNY	3,250 %	22/11/2028	5.533.119	0,10
	Bonos del Estado de China – Serie 1906	CNY	3,290 %	23/05/2029	5.611.212	0,30
	Bonos del Estado de China – Serie 1907	CNY	3,250 %	06/06/2026	4.735.294	0,25
	Bonos del Estado de China – Serie 1910	CNY	3,860 %	22/07/2049	9.054.623	0,48
0111101000	25.100 40. 20440 40 0.1114	-	0,000 70	22/01/2010	143.531.736	7,68
Colombia					. 10.00 00	7,00
	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	4,500 %	15/03/2029	179.678	0,01
	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	3,125 %	15/04/2031	1.233.206	0,01
	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	4,125 %	15/05/2051	298.327	0,01
	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	3,875 %	15/02/2061	401.215	0,02
					2.112.426	0,11
Croacia					2220	5,11
1.490.000	Bonos internacionales del Estado de Croacia	EUR	1,500 %	17/06/2031	1.500.430	0,08
Dinamarca						
	Danske Bank A/S <sup>(c)</sup>	EUR	(0,018 %)	10/11/2024	3.503.640	0,19
	Danske Bank A/S <sup>(c)</sup>	EUR	1,375 %	12/02/2030	1.568.150	0,08
4.450.000	Bonos del Estado de Dinamarca	DKK .	4,500 %	15/11/2039	1.090.185	0,06
					6.161.975	0,33
República Domi	inicana Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	4,500 %	30/01/2030	359.356	0,02
	Bonos internacionales de la República Dominicana	USD	5,875 %	30/01/2060	829.665	0,02
1.010.000	Bonos internacionales de la republica Bonnincana	-	3,073 70	30/01/2000	1.189.021	0,04
Ecuador					1.103.021	0,00
	Bonos internacionales del Estado de Ecuador	USD	6,932 %	31/07/2030	45.531	0,00
Egipto			<u> </u>			<u> </u>
• .	Bonos internacionales del Estado de Egipto	USD	8,875 %	29/05/2050	1.379.948	0,07
Finlandia						
3.200.000	Citycon OYJ <sup>(c)</sup>	EUR	3,625 %	Perp.	3.081.440	0,17
Francia						
	Agence Française de Developpement EPIC	EUR	0,125 %	29/09/2031	4.485.420	0,24
	BNP Paribas S.A.	EUR	1,125 %	22/11/2023	4.096.280	0,22
	BNP Paribas S.A. (c)	EUR	0,875 %	31/08/2033	2.710.820	0,14
	BPCE S.A. – Serie NC5 <sup>(c)</sup>	EUR	1,500 %	13/01/2042	794.160	0,04
	Caisse Centrale du Credit Immobilier de France S.A.	EUR	(0,472 %)	17/01/2024	2.223.364	0,12
	Crédit Agricole S.A.(c)	GBP	1,874 %	09/12/2031	1.152.919	0,06
	Électricité de France S.A. (c)	EUR	2,875 %	Perp.	3.280.000	0,18
	EssilorLuxottica S.A. Faurecia S.E.	USD EUR	2,500 %	30/06/2022 15/06/2029	2.844.071 847.688	0,15 0,05
	Bonos del Estado de Francia OAT	EUR	2,375 % 0,750 %	25/11/2028	4.384.735	0,05
	Bonos del Estado de Francia OAT	EUR	0,750 %	25/05/2029	45.020.958	2,41
	Bonos del Estado de Francia OAT	EUR	4,500 %	25/04/2041	3.852.038	0,21
	Bonos del Estado de Francia OAT	EUR	3,250 %	25/05/2045	981.490	0,05
	Bonos del Estado de Francia OAT 144A <sup>(d)</sup>	EUR	2,000 %	25/05/2048	822.268	0,04
	Bonos del Estado de Francia OAT 144A <sup>(d)</sup>	EUR	1,750 %	25/05/2066	2.264.019	0,12
	La Mondiale SAM	EUR	0,750 %	20/04/2026	901.980	0,05
	Loxam SAS	EUR	3,250 %	14/01/2025	1.552.604	0,08
	Loxam SAS	EUR	3,750 %	15/07/2026	505.535	0,03
1.100.000	Sanofi	EUR	(0,354 %)	21/03/2022	1.101.177	0,06
1.800.000	Société Générale S.A.(c)	EUR	1,125 %	30/06/2031	1.791.270	0,10
1.400.000	Valeo S.A.	EUR	1,000 %	03/08/2028	1.352.099	0,07

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en EUR	% del patrimonio
Bonos – (conti Alemania	inuación)					
	Allianz S.E. (c)	EUR	2,625 %	Perp.	2.129.336	0,11
	Allianz S.E. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,200 %	Perp.	1.658.806	0,09
	Bayerische Landesbank <sup>(c)</sup>	EUR	1,184 %	23/09/2031	1.191.696	0,06
	Commerzbank AG <sup>(c)</sup>	EUR	4,000 %	05/12/2030	1.194.875	0,07
	Commerzbank AG <sup>(c)</sup>	EUR	1,375 %	29/12/2031	2.256.875	0,12
	Commerzbank AG <sup>(c)</sup>	EUR	6,125 %	Perp.	2.378.750	0,13
	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	USD	2,222 %	18/09/2024	1.430.135	0,08
700.000	Deutsche Bank AG	EUR	4,500 %	19/05/2026	797.926	0,04
700.000	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	USD	2,129 %	24/11/2026	617.028	0,03
2.700.000	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	EUR	1,750 %	19/11/2030	2.816.721	0,15
2.650.000	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	USD	3,729 %	14/01/2032	2.393.181	0,13
1.800.000	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	EUR	4,625 %	Perp.	1.803.204	0,10
2.200.000	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	USD	6,000 %	Perp.	1.981.807	0,11
3.025.000	Deutsche Bank AG – Serie E	USD	0,962 %	08/11/2023	2.658.681	0,14
13.540.000	KFW	EUR	(0,540 %)	04/07/2024	13.738.632	0,74
2.940.000	KFW	GBP	0,875 %	15/09/2026	3.460.897	0,19
1.600.000	Mahle GmbH	EUR	2,375 %	14/05/2028	1.545.144	0,08
400.000	Volkswagen Bank GmbH	EUR	1,875 %	31/01/2024	414.668	0,02
1.200.000	Vonovia S.E.	EUR	0,625 %	14/12/2029	1.187.460	0,06
1.300.000	ZF Finance GmbH	EUR	3,000 %	21/09/2025	1.357.031	0,07
1.000.000	ZF Finance GmbH	EUR	2,000 %	06/05/2027	997.445	0,05
200.000	ZF Finance GmbH	EUR	2,750 %	25/05/2027	204.611	0,01
		-	,		48.214.909	2,58
Guernsey						
	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	EUR	1,250 %	14/04/2022	1.207.140	0,06
Hong Kong	CNAC III/ Finbridge Co. 14d	LICD	E 40E 0/	14/02/2020	201.040	0.04
	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	USD USD	5,125 %	14/03/2028	201.049	0,01
	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	USD	3,875 %	19/06/2029	188.711	0,01
200.000	Lenovo Group Ltd.	090	3,421 %	02/11/2030	181.267 571.027	0,01
Indonesia					07.132.	
1.610.000	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	5,875 %	15/01/2024	1.560.115	0,08
530.000	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	EUR	2,150 %	18/07/2024	554.360	0,03
220.000	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	EUR	0,900 %	14/02/2027	219.701	0,01
1.930.000	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	3,850 %	18/07/2027	1.865.799	0,10
240.000	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	2,850 %	14/02/2030	217.779	0,01
440.000	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	3,850 %	15/10/2030	430.288	0,02
360.000	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	3,500 %	14/02/2050	320.000	0,02
400.000	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	3,050 %	12/03/2051	339.236	0,02
24.999.000.000	Bonos del Tesoro de Indonesia – Serie FR73	IDR	8,750 %	15/05/2031	1.779.412	0,10
290.000	Pertamina Persero PT	USD	2,300 %	09/02/2031	241.167	0,01
200.000	Pertamina Persero PT	USD	4,150 %	25/02/2060	173.576	0,01
200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III	USD	2,550 %	09/06/2031	176.759	0,01
					7.878.192	0,42
Irlanda						
	Abbott Ireland Financing DAC	EUR	0,875 %	27/09/2023	2.449.680	0,13
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	3,500 %	26/05/2022	412.611	0,02
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	4,625 %	01/07/2022	2.697.032	0,14
1.675.000	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	6,500 %	15/07/2025	1.684.730	0,09
1.175.000	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	3,000 %	29/10/2028	1.041.953	0,06
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	3,300 %	30/01/2032	841.996	0,05
	AIB Group Plc.(c)	EUR	0,500 %	17/11/2027	2.484.975	0,13
	AIB Group Plc.(c)	EUR	1,875 %	19/11/2029	1.168.688	0,06
	AlB Group Plc. (c)	EUR	2,875 %	30/05/2031	1.834.840	0,10
	AIB Group Plc.(c)	EUR	6,250 %	Perp.	2.390.278	0,13
	Bank of Ireland Group Plc.(c)	EUR	0,375 %	10/05/2027	1.878.378	0,10
	Bank of Ireland Group Plc.(c)	EUR	1,375 %	11/08/2031	2.434.002	0,13
	Dell Bank International DAC	EUR	0,625 %	17/10/2022	2.115.645	0,11
	Dell Bank International DAC	EUR	1,625 %	24/06/2024	3.684.758	0,20
	Bonos del Estado de Irlanda	EUR	2,400 %	15/05/2030	654.782	0,04
	Bonos del Estado de Irlanda	EUR	0,200 %	18/10/2030	1.579.992	0,08
	Bonos del Estado de Irlanda	EUR	0,106 %	18/10/2031	1.058.829	0,06
1.725.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. (c)	USD .	3,000 %	19/04/2051	1.458.862	0,08
					31.872.031	1,71

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en EUR	% de patrimonio
Bonos – (cont Isla de Man	inuación)					
	Bonos internacionales del Estado de la Isla de Man	GBP	1,625 %	14/09/2051	610.702	0,0
	Sasol Financing International Ltd.	USD	4,500 %	14/11/2022	535.220	0,03
	•	-			1.145.922	0,06
Israel						
	Bonos internacionales del Estado de Israel	USD	3,800 %	13/05/2060	2.039.709	0,11
Italia	A (117)	EUD	4.005.0/	20/20/2020	4 0 4 0 5 7 0	0.0
	Aeroporti di Roma SpA	EUR	1,625 %	02/02/2029	1.318.573	0,07
	Aeroporti di Roma SpA Enel SpA – Serie 6,5 a <sup>(c)</sup>	EUR	1,750 %	30/07/2031	2.974.385	0,16
	Intesa Sanpaolo SpA	EUR EUR	1,375 % 0,625 %	Perp. 24/02/2026	3.483.909 2.608.121	0,19 0,14
	Intesa Sanpaolo SpA	EUR	1,350 %	24/02/2020	1.623.122	0,12
	Buoni poliennali del Tesoro Italia	EUR	0,050 %	15/01/2023	40.757.234	2,18
	Buoni poliennali del Tesoro Italia	EUR	0,144 %	01/04/2026	3.840.584	0,21
	Buoni poliennali del Tesoro Italia	EUR	0,950 %	01/08/2030	3.282.326	0,18
	Buoni poliennali del Tesoro Italia	EUR	6,000 %	01/05/2031	18.526.169	0,10
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup>	EUR	0,950 %	01/12/2031	1.742.888	0,09
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup>	EUR	2,950 %	01/09/2038	9.140.480	0,49
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A <sup>(d)</sup>	EUR	2,800 %	01/03/2067	940.086	0,05
	Nexi SpA	EUR	2,125 %	30/04/2029	902.222	0,05
	Telecom Italia SpA	EUR	4,000 %	11/04/2024	846.065	0,03
	UniCredit SpA <sup>(c)</sup>	EUR	2,200 %	22/07/2027	1.026.197	0,04
	UniCredit SpA(c)	EUR	2,731 %	15/01/2032	1.162.938	0,06
1.150.000	Unicredit SpA-9	EUR -	2,731 70	15/01/2032	94.175.299	5,04
Costa de Marfil					94.175.299	5,04
	Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	EUR	4,875 %	30/01/2032	431.523	0,02
	Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	USD	6,125 %	15/06/2033	442.002	0,02
	Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	EUR	6,625 %	22/03/2048	478.727	0,02
000.000	25.150 monadonalos do 25.000 do 5000 do marin		0,020 70	22/00/2010	1.352.252	0,07
Japón						
•	Bono del Estado de Japón – Serie 14	JPY	0,700 %	20/03/2061	21.528.443	1,15
	Bono del Estado de Japón – Serie 141	JPY	0,100 %	20/09/2024	18.307.050	0,98
	Bono del Estado de Japón – Serie 162	JPY	0,600 %	20/09/2037	6.754.995	0,36
	Bono del Estado de Japón – Serie 178	JPY	0,500 %	20/09/2041	20.030.474	1,07
	Bono del Estado de Japón – Serie 28	JPY	2,500 %	20/03/2038	1.553.428	0,08
1.833.600.000	Bono del Estado de Japón – Serie 354	JPY	0,100 %	20/03/2029	14.503.421	0,78
	Bono del Estado de Japón – Serie 41	JPY	1,700 %	20/12/2043	4.799.587	0,26
	Bono del Estado de Japón – Serie 430	JPY	0,005 %	01/11/2023	69.969.378	3,74
243.150.000	Bono del Estado de Japón – Serie 45	JPY	1,500 %	20/12/2044	2.302.070	0,12
22.800.000	Bono del Estado de Japón – Serie 69	JPY	0,700 %	20/12/2050	179.929	0,01
	Bono del Estado de Japón – Serie 72	JPY	0,700 %	20/09/2051	11.275.035	0,60
3.576.350.000	Depósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1025	JPY	(0,153 %)	25/03/2022	27.927.033	1,50
6.668.300.000	Depósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028	JPY	(0,147 %)	11/04/2022	52.074.081	2,79
1.550.000	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	EUR	0,339 %	19/07/2024	1.563.981	0,08
1.500.000	Nomura Holdings, Inc.	USD	2,608 %	14/07/2031	1.303.168	0,07
4.000.000	Norinchukin Bank 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,284 %	22/09/2026	3.496.206	0,19
200.000	SoftBank Group Corp.	USD	5,125 %	19/09/2027	175.111	0,01
					257.743.390	13,79
Jersey	Calaxy Pineline Assets Ridge Ltd	Hen	2,625 %	24/02/2026	100 400	0.04
	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD		31/03/2036	180.406	0,01
	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,940 %	30/09/2040	3.057.772	0,16
	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	3,250 %	30/09/2040	334.798	0,02
6/5.000	Gatwick Funding Ltd.	GBP .	2,500 %	15/04/2030	792.216	0,04
Luvamb					4.365.192	0,23
Luxemburgo 2 200 000	ADLER Group S.A.	EUR	3,250 %	05/08/2025	1.947.220	0,10
	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR	2,000 %	15/02/2024	1.190.227	0,10
	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR	1,250 %	26/04/2027	295.546	0,00
	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR		04/05/2028	1.565.120	
	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	GBP	1,000 % 2,625 %	20/10/2028		0,08
					1.823.680	0,10
	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR	1,750 %	12/03/2029	1.172.074	0,06
	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL Fondo Europeo de Estabilidad Financiera	EUR EUR	1,625 % 0,875 %	20/04/2030	2.359.259	0,13
	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.	USD		10/04/2035	1.242.201	0,07
1.490.000	Gazpioni Fuod via Gaz Gapilai S.A.	บอบ	5,150 %	11/02/2026	1.424.067	0,08

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en EUR	% del patrimonio
Bonos – (conti	•					
Luxemburgo – (						
	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.	USD	7,288 %	16/08/2037	642.275	0,03
	Helvetia Europe S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	2,750 %	30/09/2041	1.245.231	0,07
	Highland Holdings SARL	EUR	(0,081 %)	12/11/2023	1.552.991	0,08
	Lincoln Financing SARL	EUR	3,625 %	01/04/2024	1.807.200	0,10
	Logicor Financing SARL	EUR	0,750 %	15/07/2024	1.620.928	0,09
	Logicor Financing SARL	EUR	1,625 %	15/07/2027	1.771.315	0,09
	Medtronic Global Holdings S.C.A. Medtronic Global Holdings S.C.A.	EUR EUR	0,375 % 0,250 %	07/03/2023 02/07/2025	3.628.620 856.673	0,19 0,05
030.000	Wedtforme Global Holdings S.C.A.	LON	0,230 /6	02/07/2023	26.144.627	1,40
México					20.144.027	1,40
	Banco Mercantil del Norte S.A.(c)	USD	5,875 %	Perp.	941.058	0,05
	Cemex SAB de CV	USD	7,375 %	05/06/2027	192.327	0,01
	Cemex SAB de CV	USD	5,200 %	17/09/2030	250.062	0,01
	Mexico City Airport Trust	USD	4,250 %	31/10/2026	370.443	0,02
	Mexico City Airport Trust	USD	3,875 %	30/04/2028	542.134	0,03
	Mexico City Airport Trust	USD	5,500 %	31/07/2047	524.663	0,03
	Mexico City Airport Trust 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,250 %	31/10/2026	194.483	0,01
	Mexico City Airport Trust 144A(d)	USD	3.875 %	30/04/2028	795.130	0,04
	Mexico City Airport Trust 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,500 %	31/10/2046	212.616	0,04
	Mexico City Airport Trust 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,500 %	31/07/2047	297.139	0,01
	Bonos internacionales del Estado de México	USD	3,250 %	16/04/2030	196.907	0,02
	Bonos internacionales del Estado de México	USD	3,771 %	24/05/2061	531.316	0,01
	Bonos internacionales del Estado de México	USD	3,750 %	19/04/2071	1.031.061	0,03
	Trust Fibra Uno	USD	5,250 %	15/12/2024	372.906	0,00
000.000	Track libra one		0,200 70	10/12/2024	6.452.245	0,35
Países Bajos						
-	ABN AMRO Bank NV <sup>(c)</sup>	EUR	4,375 %	Perp.	1.579.365	0,08
	Airbus S.E.	EUR	2,375 %	09/06/2040	3.509.045	0,19
	Akelius Residential Property Financing BV	EUR	0,750 %	22/02/2030	1.505.747	0,08
	BNG Bank NV	GBP	0,375 %	15/12/2025	2.267.665	0,12
	Cooperatieve Rabobank UA	EUR	3,875 %	25/07/2023	1.602.870	0,09
	Heimstaden Bostad Treasury BV	EUR	1,625 %	13/10/2031	2.442.702	0,13
	ING Groep NV	EUR	1,000 %	20/09/2023	1.122.803	0,06
	ING Groep NV <sup>(c)</sup>	EUR	2,125 %	26/05/2031	733.313	0,04
	ING Groep NV <sup>(c)</sup>	EUR	1,099 %	16/11/2032	1.585.632	0,08
	JAB Holdings BV	EUR	1,000 %	20/12/2027	2.242.526	0,12
	Koninklijke Philips NV	EUR	1,375 %	30/03/2025	729.666	0,04
	Lukoil Securities BV	USD	3,875 %	06/05/2030	1.748.872	0,09
1.420.000	Prosus NV	USD	3,680 %	21/01/2030	1.273.504	0,07
	Prosus NV	USD	4,027 %	03/08/2050	230.083	0,01
270.000	Prosus NV	USD	3,832 %	08/02/2051	214.339	0,01
	Technip Energies NV	EUR	1,125 %	28/05/2028	3.086.783	0,16
	Telefonica Europe BV <sup>(c)</sup>	EUR	2,376 %	Perp.	2.655.464	0,14
	Thermo Fisher Scientific Finance I BV	EUR	0,070 %	18/11/2025	1.996.140	0,11
	Volkswagen International Finance NV <sup>(c)</sup>	EUR	3,500 %	Perp.	2.557.608	0,14
	Volkswagen International Finance NV <sup>(c)</sup>	EUR	4,625 %	Perp.	1.472.211	0,08
	Wintershall Dea Finance BV	EUR	0,840 %	25/09/2025	712.026	0,04
	WPC Eurobond BV	EUR	1,350 %	15/04/2028	2.347.334	0,13
	WPC Eurobond BV	EUR	0,950 %	01/06/2030	928.502	0,05
					38.544.200	2,06
Nigeria						
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	6,500 %	28/11/2027	171.596	0,01
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	6,125 %	28/09/2028	1.407.192	0,07
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	7,875 %	16/02/2032	588.280	0,03
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	7,375 %	28/09/2033	1.116.238	0,06
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	7,696 %	23/02/2038	1.253.240	0,07
430.000	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	7,625 %	28/11/2047	323.582	0,02
					4.860.128	0,26
Noruega 500.000	Adevinta ASA	EUR	3,000 %	15/11/2027	514.460	0,03
Perú		2510	0,000 70	10/11/2021	017.700	0,00
	Bonos internacionales del Estado de Perú	USD	2,780 %	01/12/2060	14.856	0,00
	Bonos internacionales del Estado de Perú	USD	3,230 %	28/07/2121	137.585	0,01
		-				

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en EUR	% del patrimonio
Bonos – (cont Portugal	inuación)					
-	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 144A(d)	EUR	4,950 %	25/10/2023	5.853.705	0,31
2.890.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 144A <sup>(d)</sup>	EUR	1,950 %	15/06/2029	3.312.663	0,18
		•			9.166.368	0,49
Catar	Octor	HOD	0.050.0/	40/07/0004	400.004	0.00
	Qatar Energy Qatar Energy	USD	2,250 % 3.125 %	12/07/2031 12/07/2041	486.004 1.650.845	0,03 0,09
	Qatar Energy	USD	3,300 %	12/07/2051	1.579.321	0,08
	Bonos internacionales del Estado de Catar	USD	4,000 %	14/03/2029	365.659	0,02
					4.081.829	0,22
Rumanía 260 000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,875 %	11/03/2029	275.275	0,01
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	3,624 %	26/05/2030	2.158.653	0,11
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	USD	3,000 %	14/02/2031	329.788	0,02
	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,000 %	28/01/2032	120.738	0,01
810.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	3,375 %	28/01/2050	759.881	0,04
1.220.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	USD	4,000 %	14/02/2051	1.046.062	0,06
					4.690.397	0,25
Arabia Saudí	Bonos internacionales del Estado saudí	USD	3,250 %	22/10/2030	458.359	0,03
	Bonos internacionales del Estado saudí	USD	3,250 %	17/11/2051	2.064.019	0,03
	Bonos internacionales del Estado saudí	USD	4,500 %	22/04/2060	446.631	0,02
					2.969.009	0,16
Sudáfrica						
	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	4,300 %	12/10/2028	673.586	0,04
	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	4,850 % 5,750 %	30/09/2029 30/09/2049	665.243 375.352	0,03 0,02
400.000	Bollos internacionales del Estado de Sudainca	030	3,730 /6	30/09/2049	1.714.181	0,02
Corea del Sur						-,
3.710.730.000	Bonos del Tesoro de Corea indexados a la inflación – Serie 2606	KRW	1,000 %	10/06/2026	3.050.847	0,17
7.218.240.000	Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2906	KRW	1,875 %	10/06/2029	5.281.990	0,28
13.693.520.000	Bonos del Tesoro de Corea – Serie 2912	KRW	1,375 %	10/12/2029	9.591.067	0,51
					17.923.904	0,96
España	Abertis Infraestructuras S.A.	EUR	2,375 %	27/00/2027	652.956	0,04
	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	EUR	0,750 %	27/09/2027 11/09/2022	907.920	0,04
	Banco de Sabadell S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	5,000 %	Perp.	1.776.960	0,03
	Banco Santander S.A.	USD	2.706 %	27/06/2024	1.278.572	0,10
	Banco Santander S.A.	EUR	1,375 %	05/01/2026	832.544	0,04
1.900.000	Banco Santander S.A.	EUR	1,625 %	22/10/2030	1.912.654	0,10
1.800.000	Banco Santander S.A.	USD	2,749 %	03/12/2030	1.549.295	0,08
2.000.000	Banco Santander S.A.(c)	GBP	2,250 %	04/10/2032	2.314.831	0,12
2.600.000	Banco Santander S.A.(c)	EUR	4,375 %	Perp.	2.642.900	0,14
	CaixaBank S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	0,375 %	18/11/2026	2.684.232	0,14
	CaixaBank S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	5,875 %	Perp.	2.241.000	0,12
	Cellnex Finance Co., S.A.	EUR	0,750 %	15/11/2026	591.057	0,03
	Cellnex Finance Co., S.A.	EUR	1,250 %	15/01/2029	864.108	0,05
	Cellnex Finance Co., S.A.	EUR	2,000 %	15/02/2033	859.919	0,05
	FCC Aqualia S.A.	EUR	2,629 %	08/06/2027	1.573.029	0,08
	Iberdrola Finanzas S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	1,575 %	Perp. 31/01/2026	1.394.750	0,08
	Bonos del Estado de España  Ropos del Estado de España 144A <sup>(d)</sup>	EUR	(0,308 %)		12.660.364	0,68
	Bonos del Estado de España 144A <sup>(d)</sup> Bonos del Estado de España 144A <sup>(d)</sup>	EUR EUR	5,900 % 1,500 %	30/07/2026 30/04/2027	9.099.270 10.506.517	0,49 0,56
	Bonos del Estado de España 144A <sup>(d)</sup>	EUR	0,100 %	30/04/2021	13.687.780	0,30
	Bonos del Estado de España 144A <sup>(d)</sup>	EUR	0,500 %	31/10/2031	3.327.111	0,73
	Bonos del Estado de España 144A <sup>(d)</sup>	EUR	3,450 %	30/07/2066	3.976.829	0,18
					77.334.598	4,14
Supranacionale			0.004.01	17/05/0000	F07 T00	0.55
	African Export-Import Bank African Export-Import Bank	USD	2,634 % 3,798 %	17/05/2026 17/05/2031	537.739 794.840	0,03 0,04
	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC Via Ardagh Metal	EUR	3,000 %	01/09/2029		
	Packaging Finance Plc.	_0.,	2,300 /0	55.2525	537.031	0,03

					Valor de mercado en	% del
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	EUR	patrimonio
Bonos - (cont	· ·					
	es – (continuación)	EUD	0.075.0/	0.4.44.40007	0.47.004	0.05
	Canpack S.A. Via Canpack US LLC	EUR	2,375 %	01/11/2027	947.084	0,05
	Banco Europeo de Inversiones Banco Europeo de Inversiones	SEK EUR	1,750 % 0,875 %	12/11/2026 14/01/2028	917.700 6.480.799	0,05 0,35
	Banco Europeo de Inversiones	EUR	0,200 %	17/03/2036	4.656.644	0,33
	Banco Europeo de Inversiones	EUR	1,000 %	14/11/2042	2.215.022	0,12
	Unión Europea	EUR	(0,449 %)	06/07/2026	3.218.891	0,17
	Unión Europea	EUR	(0,263 %)	04/10/2028	682.958	0,04
5.960.000	Unión Europea	EUR	(0,074 %)	22/04/2031	6.005.713	0,32
1.170.000	Unión Europea	EUR	0,400 %	04/02/2037	1.208.271	0,06
					28.202.692	1,51
Suecia 800 000	Heimstaden Bostad AB	EUR	1,125 %	21/01/2026	816.192	0,04
	Heimstaden Bostad AB <sup>(c)</sup>	EUR	3,625 %	Perp.	6.091.882	0,32
	Heimstaden Bostad AB <sup>(c)</sup>	EUR	3,000 %	Perp.	2.778.165	0,15
	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB(c)	EUR	2,625 %	Perp.	1.991.063	0,11
	Verisure Holding AB	EUR	3,250 %	15/02/2027	771.671	0,04
2.900.000	Volvo Treasury AB	EUR	0,125 %	17/09/2024	2.915.892	0,16
		•			15.364.865	0,82
Suiza	One did Ordinan AO		0.050.01	20/21/222	0.407.0==	
	Credit Suisse AG	USD	2,950 %	09/04/2025	2.127.658	0,11
	Crédit Suisse Group AG <sup>(c)</sup>	EUR	3,250 %	02/04/2026	1.690.290	0,09
4.275.000		GBP	0,625 % 0,250 %	18/12/2023 03/11/2026	4.983.238 4.188.030	0,27
4.200.000	UBS Group AG <sup>(c)</sup>	EUR .	0,250 %	03/11/2020		0,22
Tailandia					12.989.216	0,69
	Bonos del Estado de Tailandia	THB	1,875 %	17/06/2022	4.789.256	0,26
	Bonos del Estado de Tailandia	THB	2,400 %	17/12/2023	4.337.898	0,20
	Bonos del Estado de Tailandia	THB	3,650 %	20/06/2031	1.226.259	0,23
	Bonos del Estado de Tailandia	THB	1,585 %	17/12/2035	765.680	0,04
					11.119.093	0,59
Turquía						
940.000	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	4,250 %	14/04/2026	754.308	0,04
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	5,250 %	13/03/2030	317.510	0,02
	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	5,875 %	26/06/2031	632.772	0,04
	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO	USD	5,250 %	05/02/2025	815.457	0,04
230.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO	USD	6,500 %	08/01/2026	196.577	0,01
Hammela.					2.716.624	0,15
Ucrania 240.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	9,750 %	01/11/2028	226.954	0,01
680.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	6,876 %	21/05/2029	557.279	0,03
1.880.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	EUR	4,375 %	27/01/2030	1.610.220	0,09
					2.394.453	0,13
Emiratos Árabe		1100	0.075.0/	40/04/0050	0.045.040	0.40
	Bonos internacionales del Estado de Abu Dabi DP World Plc. 144A <sup>(d)</sup>	USD USD	3,875 % 6,850 %	16/04/2050 02/07/2037	2.245.242	0,12
100.000	DP World Pic. 144A(4)	090	0,050 %	02/07/2037	115.679	0,01
Deles Helds					2.360.921	0,13
Reino Unido 250.000	Barclays Plc.	USD	3,684 %	10/01/2023	220.433	0,01
	Barclays Plc. <sup>(c)</sup>	EUR	3,375 %	02/04/2025	2.468.544	0,13
	Barclays Plc.(c)	USD	2,279 %	24/11/2027	2.778.925	0,15
	Barclays Plc. <sup>(c)</sup>	GBP	3,750 %	22/11/2030	4.029.739	0,22
	BAT International Finance Plc.	GBP	2,250 %	26/06/2028	1.277.264	0,07
	Bellis Acquisition Co., Plc.	GBP	3,250 %	16/02/2026	389.554	0,02
	BP Capital Markets Plc.	USD	3,814 %	10/02/2024	372.527	0,02
	BP Capital Markets Plc.(c)	EUR	3,250 %	Perp.	950.688	0,05
	BP Capital Markets Plc.(c)	EUR	3,625 %	Perp.	1.180.905	0,06
	Direct Line Insurance Group Plc.(c)	GBP	4,750 %	Perp.	1.515.061	0,08
	Gatwick Airport Finance Plc.	GBP	4,375 %	07/04/2026	1.567.631	0,08
	Gazprom PJSC Via Gaz Finance Plc. HSBC Holdings Plc. <sup>(c)</sup>	USD USD	3,250 % 3,803 %	25/02/2030 11/03/2025	816.305 4.452.606	0,04 0,24
	Legal & General Group Plc.(c)	GBP	3,803 % 3,750 %	26/11/2049	4.452.606 1.048.173	0,24
050.000	20gai a Donoral Group Flori	ODF	3,730 /0	20/11/2049	1.0-0.173	0,00

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en EUR	% del patrimonio
	<u> </u>					
Bonos – (conti Reino Unido – (	·					
	M&G Plc. <sup>(c)</sup>	GBP	6,340 %	19/12/2063	301.849	0,02
1.600.000	National Express Group Plc.(c)	GBP	4,250 %	Perp.	1.912.937	0,10
	Nationwide Building Society 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,622 %	26/04/2023	400.106	0,02
	NatWest Group Plc.(c)	USD	3,498 %	15/05/2023	1.423.596	0,08
	NatWest Group Plc.	USD	3,875 %	12/09/2023	368.632	0,02
	NatWest Group Pic. (c) NatWest Group Pic. (c)	USD GBP	1,642 % 2,105 %	14/06/2027 28/11/2031	1.691.547 3.001.954	0,09 0,16
	NatWest Group Pic. <sup>(c)</sup>	EUR	1,043 %	14/09/2032	1.421.834	0,10
	NatWest Group Pic. (c)	GBP	5,125 %	Perp.	3.267.602	0,00
	Pension Insurance Corp., Plc.	GBP	4,625 %	07/05/2031	1.107.683	0,06
	Pinewood Finance Co., Ltd.	GBP	3,250 %	30/09/2025	1.329.448	0,07
2.925.000	Santander UK Group Holdings Plc.(c)	USD	1,089 %	15/03/2025	2.552.668	0,14
	Santander UK Group Holdings Plc. (c)	USD	1,532 %	21/08/2026	2.349.854	0,13
	Standard Chartered Plc. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,214 %	23/03/2025	831.359	0,04
	Tesco Corporate Treasury Services Plc.	GBP	1,875 %	02/11/2028	2.647.457	0,14
	Thames Water Utilities Finance Plc.(c)	GBP	5,750 %	13/09/2030	2.365.643	0,13
	Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP GBP	4,500 %	07/09/2034 22/01/2045	2.765.302 1.189.077	0,15 0,06
	Bonos del Estado del Reino Unido (gilts) Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	3,500 % 4,250 %	07/12/2046	10.132.484	0,00
	Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	1,500 %	31/07/2053	3.597.299	0,19
	Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	1,750 %	22/07/2057	4.093.169	0,22
	Bonos del Estado del Reino Unido (gilts)	GBP	3,500 %	22/07/2068	5.929.324	0,32
200.000	Vedanta Resources Finance II Plc.	USD	8,950 %	11/03/2025	169.822	0,01
400.000	Vedanta Resources Ltd.	USD	6,125 %	09/08/2024	303.438	0,02
	Virgin Money UK Plc. (c)	EUR	0,375 %	27/05/2024	1.306.513	0,07
1.350.000	Virgin Money UK Plc. (c)	GBP	9,250 %	Perp.	1.758.628	0,09
		-			81.287.580	4,35
Fatadas Unidas						
Estados Unidos	AbbVie, Inc.	USD	3,750 %	14/11/2023	832.728	0,04
	AbbVie, Inc.	USD	2,600 %	21/11/2024	2.463.682	0,04
	Air Lease Corp.	USD	3,875 %	03/07/2023	3.436.974	0,18
	Air Lease Corp.	USD	2,875 %	15/01/2026	1.109.050	0,06
	Ameren Corp.	USD	2,500 %	15/09/2024	227.018	0,01
1.300.000	Anheuser-Busch Cos., LLC Via Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	USD	4,900 %	01/02/2046	1.449.119	0,08
75.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	USD	4,600 %	15/04/2048	80.906	0,00
	AT&T, Inc.	USD	3,000 %	30/06/2022	443.846	0,02
	AT&T, Inc.	USD	2,550 %	01/12/2033	2.401.013	0,13
	AT&T, Inc.	EUR	1,800 %	14/09/2039	1.220.688	0,07
	AT&T, Inc. AT&T, Inc.	USD	4,350 %	15/06/2045 01/03/2047	549.168	0,03 0,07
	AT&T, Inc.	USD	5,450 % 3,650 %	01/06/2051	1.398.996 1.671.377	0,07
	Bank of America Corp.	USD	3,500 %	19/04/2026	2.370.852	0,03
	Bank of America Corp.(c)	EUR	3,648 %	31/03/2029	2.012.052	0,11
	Becton Dickinson and Co.	USD	3,363 %	06/06/2024	1.485.763	0,08
1.650.000	Centene Corp.	USD	3,000 %	15/10/2030	1.448.725	0,08
2.100.000	Charter Communications Operating LLC Via Charter					
	Communications Operating Capital	USD	4,908 %	23/07/2025	2.041.752	0,11
1.300.000	Charter Communications Operating LLC Via Charter	USD	4 000 0/	04/02/2050	1 205 075	0.07
3 180 000	Communications Operating Capital Citigroup Global Markets Holdings, Inc. <sup>(c)</sup>	USD	4,800 % 3,872 %	01/03/2050 20/09/2023	1.295.075 2.802.009	0,07 0,15
	Citigroup, Inc.(c)	USD	0,776 %	30/10/2024	3.981.253	0,13
	Citigroup, Inc. (c)	USD	3,106 %	08/04/2026	3.647.287	0,20
	Comcast Corp.	USD	3,700 %	15/04/2024	2.521.059	0,13
2.100.000	Comcast Corp.	USD	3,950 %	15/10/2025	2.016.948	0,11
1.650.000	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	6,020 %	15/06/2026	1.698.172	0,09
	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	4,900 %	01/10/2026	398.513	0,02
	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	6,200 %	15/07/2030	279.593	0,01
	Devon Energy Corp.	USD	5,850 %	15/12/2025	252.883	0,01
	Dollar Tree, Inc.	USD	4,000 %	15/05/2025	1.422.986	0,08
	DuPont de Nemours, Inc.	USD USD	4,493 % 5.272 %	15/11/2025	1.558.321	0,08 0,03
	Elanco Animal Health, Inc. Energy Transfer LP	USD	5,272 % 5,500 %	28/08/2023 01/06/2027	653.950 655.672	0,03
	Energy Transfer LP	USD	5,300 %	01/04/2044	505.967	0,03
	Enterprise Products Operating LLC	USD	3,750 %	15/02/2025	470.620	0,03
	Expedia Group, Inc.	USD	3,250 %	15/02/2030	1.946.213	0,10
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	6,750 %	15/03/2031	508.787	0,03
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	6,625 %	15/11/2030	375.685	0,02
	Fidelity National Information Services, Inc.	EUR	0,750 %	21/05/2023	860.174	0,05
125.000	Ford Motor Credit Co., LLC	EUR	3,250 %	15/09/2025	133.696	0,01

					Valor de mercado en	% del
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	EUR	patrimonio
Bonos - (cont	inuación)					
	s – (continuación)					
	General Electric Co.	USD	6,750 %	15/03/2032	671.978	0,04
	General Motors Co. General Motors Financial Co., Inc.	USD USD	5,400 % 1,500 %	02/10/2023 10/06/2026	1.374.839 1.773.249	0,07 0,09
	Hewlett Packard Enterprise Co.	USD	4,450 %	02/10/2023	1.350.308	0,09
	Hewlett Packard Enterprise Co.	USD	6,350 %	15/10/2045	832.999	0,04
	IQVIA, Inc.	EUR	2,250 %	15/03/2029	1.288.703	0,07
3.400.000	JPMorgan Chase & Co.(c)	USD	3,797 %	23/07/2024	3.127.903	0,17
	Kinder Morgan Energy Partners LP	USD	4,300 %	01/05/2024	46.932	0,00
	Kraft Heinz Foods Co.	USD	4,875 %	01/10/2049	574.935	0,03
	Moody's Corp.	USD	3,100 %	29/11/2061	2.245.258	0,12
	Morgan Stanley	EUR	1,750 %	30/01/2025	525.780	0,03
	Morgan Stanley <sup>(c)</sup> MPLX LP	USD USD	2,484 %	16/09/2036	1.907.748	0,10
	MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.	GBP	4,500 % 3,692 %	15/04/2038 05/06/2028	885.588 1.428.716	0,05 0,08
	MPT Operating Partnership LP Via MPT Finance Corp.	GBP	3,375 %	24/04/2030	2.845.578	0,00
	Occidental Petroleum Corp.	USD	5,550 %	15/03/2026	622.665	0,03
	Occidental Petroleum Corp.	USD	6,450 %	15/09/2036	494.353	0,03
	ONE Gas, Inc.	USD	1,100 %	11/03/2024	2.554.261	0,14
867.000	OneMain Finance Corp.	USD	3,500 %	15/01/2027	741.009	0,04
2.175.000	PACCAR Financial Corp.	USD	0,900 %	08/11/2024	1.907.523	0,10
	Pacific Gas and Electric Co.	USD	2,500 %	01/02/2031	506.328	0,03
	Pacific Gas and Electric Co.	USD	3,500 %	01/08/2050	419.181	0,02
	Pioneer Natural Resources Co.	USD	1,125 %	15/01/2026	321.860	0,02
	Realty Income Corp.	USD	4,625 %	01/11/2025	1.470.338	0,08
	Sabine Pass Liquefaction LLC	USD	5,625 %	01/03/2025	2.010.867	0,11
	Sasol Financing USA LLC	USD	5,875 %	27/03/2024	346.069	0,02
	Teledyne Technologies, Inc.	USD	0,950 %	01/04/2024 15/04/2025	2.583.974	0,14
	T-Mobile USA, Inc. T-Mobile USA, Inc.	USD	3,500 % 3,750 %	15/04/2025	1.071.914 3.414.438	0,06 0,18
	T-Mobile USA, Inc.	USD	3,875 %	15/04/2027	1.937.421	0,10
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	2,375 %	15/11/2049	63.862.154	3,42
	Verizon Communications, Inc.	USD	4,125 %	16/03/2027	3.384.506	0,18
	Walgreens Boots Alliance, Inc.	USD	0,950 %	17/11/2023	3.666.007	0,20
		-	<u> </u>		166.823.954	8,92
Uruguay						
	Bonos internacionales del Estado de Uruguay	USD	4,375 %	23/01/2031	544.512	0,03
Venezuela						
	Petroleos de Venezuela S.A.	USD	6,000 %	28/10/2022	392.670	0,02
TOTAL DE BON (coste EUR 1.26					1.303.888.041	69,75
Tenencias	Pagarinaián dal valor				Valor de mercado en EUR	% del
	Descripción del valor				EUK	Patrillollio
	ersión – 2,79 %					
Irlanda 1.322	Goldman Sachs Euro Liquid Reserves Fund (Clase de acciones	de acumulación	X) <sup>(e)(f)</sup>		13.038.279	0,70
Luxemburgo						
1.846.251	Goldman Sachs Funds - Global High Yield Portfolio (Clase de ac	ciones de distrib	oución IO) <sup>(e)</sup>		39.169.025	2,09
TOTAL DE FON (coste EUR 49.0	DOS DE INVERSIÓN					
(COSIG EUR 49.0	712.510)				52.207.304	2,79
TOTAL DE VALO (coste EUR 1.31	ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BO (8.034.825)	LSA DE VALOF	RES OFICIAL		1.356.095.345	72,54
			(a)	(b)	Valor de mercado en	% del
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	EUR	patrimonio
Valores mobili Bonos – 3,60 %	arios negociados en otro mercado regulado %					
Australia	Macaularia Dank I Ad 444A(C)(d)	1100	0.050.01	00/00/0000	0.474.404	
	Macquarie Bank Ltd. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,052 %	03/03/2036	2.174.121	0,12
<b>Canadá</b> 960.000	1011778 BC ULC Via New Red Finance, Inc. 144A(d)	USD	3,500 %	15/02/2029	809.948	0,04
Islas Caimán						
950.000	Avolon Holdings Funding Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,950 %	01/07/2024	877.596	0,05

3.250.000 Bt 4.490.000 Bt 1.300.000 Cr 3.500.000 Sc  Irlanda 1.700.000 At  Países Bajos 2.000.000 Er 1.175.000 Sy 1.125.000 Sy  Supranacionales 3.700.000 N; 2.460.000 N;  Suiza 3.100.000 Cr  Estados Unidos	Audición)  INP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup> INP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup> INPCE S	USD USD USD USD USD USD USD USD USD USD	3,375 % 2,219 % 4,000 % 3,375 % 1,488 %  4,750 %  2,875 % 4,441 % 4,892 %	09/01/2025 09/06/2026 12/09/2023 10/01/2022 14/12/2026 12/10/2023 12/07/2041 24/04/2023 24/04/2025	301.721 2.906.561 4.155.769 1.146.298 3.014.794 11.525.143 1.593.041 1.707.430 1.072.726 1.073.339 3.853.495	0,02 0,16 0,22 0,06 0,16 0,62 0,08 0,09 0,06 0,06
3.250.000 Bt 4.490.000 Bt 1.300.000 Cr 3.500.000 Sc  Irlanda 1.700.000 Al  Países Bajos 2.000.000 Er 1.175.000 Sy 1.125.000 Sy  Supranacionales 3.700.000 N; 2.460.000 N;  Suiza 3.100.000 Cr  Estados Unidos	INP Paribas S.A. 144A <sup>(c)</sup> (d) IPCE S.A. 144A <sup>(d)</sup> IPCE S.A. 144A <sup>(</sup>	USD USD USD USD USD USD USD	2,219 % 4,000 % 3,375 % 1,488 % 4,750 % 2,875 % 4,441 % 4,892 %	09/06/2026 12/09/2023 10/01/2022 14/12/2026 12/10/2023 12/07/2041 24/04/2023 24/04/2025	2.906.561 4.155.769 1.146.298 3.014.794 11.525.143 1.593.041 1.707.430 1.072.726 1.073.339	0,16 0,22 0,06 0,16 0,62 0,08 0,09 0,06 0,06
4.490.000 Bf 1.300.000 Cf 3.500.000 Sc  Irlanda 1.700.000 Al  Países Bajos 2.000.000 Er 1.175.000 Sy 1.125.000 Sy  Supranacionales 3.700.000 N; 2.460.000 N;  Suiza 3.100.000 Cf  Estados Unidos	PCE S.A. 144A <sup>(d)</sup> Crédit Agricole S.A. 144A <sup>(d)</sup> Crédit Agricole S.A. 144A <sup>(c)</sup> Crédit Agricole S.A. 144A <sup>(c)</sup> Crédit Agricole S.A. 144A <sup>(d)</sup> Crédit Agricole S.A. 144A <sup>(d)</sup> Credit Agric	USD USD USD USD USD USD USD	4,000 % 3,375 % 1,488 % 4,750 % 2,875 % 4,441 % 4,892 %	12/09/2023 10/01/2022 14/12/2026 12/10/2023 12/07/2041 24/04/2023 24/04/2025	4.155.769 1.146.298 3.014.794 11.525.143 1.593.041 1.707.430 1.072.726 1.073.339	0,22 0,06 0,16 0,62 0,08 0,09 0,06 0,06
1.300.000 Cr 3.500.000 Sc Irlanda 1.700.000 Al Países Bajos 2.000.000 Er 1.175.000 Sy 1.125.000 Sy Supranacionales 3.700.000 NZ 2.460.000 NZ	crédit Agricole S.A. 144A <sup>(d)</sup> société Générale S.A. 144A <sup>(c)</sup> AlB Group Plc. 144A <sup>(d)</sup> Inel Finance International NV 144A <sup>(d)</sup> Syngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup> Syngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup> IXP BV Via NXP Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD USD USD	3,375 % 1,488 % 4,750 % 2,875 % 4,441 % 4,892 %	12/10/2023 12/10/2023 12/07/2041 24/04/2023 24/04/2025	1.146.298 3.014.794 11.525.143 1.593.041 1.707.430 1.072.726 1.073.339	0,06 0,16 0,62 0,08 0,09 0,06 0,06
3.500.000 Scillanda 1.700.000 Al Países Bajos 2.000.000 Er 1.175.000 Sy 1.125.000 Sy  Supranacionales 3.700.000 N; 2.460.000 N;  Suiza 3.100.000 Cr Estados Unidos	AlB Group Plc. 144A <sup>(d)</sup> Sinel Finance International NV 144A <sup>(d)</sup> Styngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup> Styngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup> Styngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD USD USD	1,488 % 4,750 % 2,875 % 4,441 % 4,892 %	12/10/2023 12/10/2023 12/07/2041 24/04/2023 24/04/2025	3.014.794 11.525.143 1.593.041 1.707.430 1.072.726 1.073.339	0,16 0,62 0,08 0,09 0,06 0,06
3.500.000 Solution    Irlanda	AlB Group Plc. 144A <sup>(d)</sup> Sinel Finance International NV 144A <sup>(d)</sup> Styngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup> Styngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup> Styngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD	1,488 % 4,750 % 2,875 % 4,441 % 4,892 %	12/10/2023 12/07/2041 24/04/2023 24/04/2025	3.014.794 11.525.143 1.593.041 1.707.430 1.072.726 1.073.339	0,16 0,62 0,08 0,09 0,06 0,06
Irlanda	IslB Group Plc. 144A <sup>(d)</sup> Sinel Finance International NV 144A <sup>(d)</sup> Styngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup> Styngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup> Styngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD USD	4,750 % 2,875 % 4,441 % 4,892 %	12/10/2023 12/07/2041 24/04/2023 24/04/2025	11.525.143 1.593.041 1.707.430 1.072.726 1.073.339	0,62 0,08 0,09 0,06 0,06
1.700.000 Al Países Bajos 2.000.000 Er 1.175.000 Sy 1.125.000 Sy  Supranacionales 3.700.000 Nz 2.460.000 Nz  Suiza 3.100.000 Cr Estados Unidos	inel Finance International NV 144A <sup>(d)</sup> syngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup> syngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup> IXP BV Via NXP Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD	2,875 % 4,441 % 4,892 %	12/07/2041 24/04/2023 24/04/2025	1.707.430 1.072.726 1.073.339	0,09 0,06 0,06
Países Bajos	inel Finance International NV 144A <sup>(d)</sup> syngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup> syngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup> IXP BV Via NXP Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD USD USD	2,875 % 4,441 % 4,892 %	12/07/2041 24/04/2023 24/04/2025	1.707.430 1.072.726 1.073.339	0,09 0,06 0,06
2.000.000 Er 1.175.000 Sy 1.125.000 Sy Supranacionales 3.700.000 N2 2.460.000 N2 Suiza 3.100.000 Cr Estados Unidos	Syngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup> Syngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup> IXP BV Via NXP Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD USD -	4,441 % 4,892 %	24/04/2023 24/04/2025	1.072.726 1.073.339	0,06 0,06
1.175.000 Sy 1.125.000 Sy  Supranacionales 3.700.000 NX 2.460.000 NX  Suiza 3.100.000 Cr  Estados Unidos	Syngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup> Syngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup> IXP BV Via NXP Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD USD -	4,441 % 4,892 %	24/04/2023 24/04/2025	1.072.726 1.073.339	0,06 0,06
1.125.000 Sy  Supranacionales	Tyngenta Finance NV 144A <sup>(d)</sup> IXP BV Via NXP Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,892 %	24/04/2025	1.073.339	0,06
Supranacionales   3.700.000   N2   2.460.000   N3	IXP BV Via NXP Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	·			
3.700.000 NX 2.460.000 NX Suiza 3.100.000 Cr Estados Unidos			3,875 %	0/155/555	0.000.100	
3.700.000 NX 2.460.000 NX Suiza 3.100.000 Cr Estados Unidos			3,875 %	A / 100 100 -		
2.460.000 NX  Suiza  3.100.000 Cr  Estados Unidos				01/09/2022	3.319.381	0,18
Suiza 3.100.000 Cr Estados Unidos			3,250 %	30/11/2051	2.182.294	0,11
3.100.000 Cr Estados Unidos			-,,-		5.501.675	0,29
Estados Unidos						
	Credit Suisse Group AG 144A(c)(d)	USD	2,997 %	14/12/2023	2.780.558	0,15
730.000 A	Albertsons Cos., Inc.Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via					
Al	libertsons LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,500 %	15/03/2029	643.599	0,03
	Illison Transmission, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3.750 %	30/01/2031	862.811	0,05
	shland LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,375 %	01/09/2031	1.831.743	0,10
	viation Capital Group LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,950 %	30/01/2026	802.685	0,04
	xalta Coating Systems LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,375 %	15/02/2029	1.199.136	0,04
	Broadcom, Inc. 144A(d)	USD	3,469 %	15/04/2034	1.430.116	0,08
	troadcom, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,137 %	15/11/2035	4.436.495	0,24
	Calpine Corp. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,750 %	01/03/2031	857.467	0,05
	CCO Holdings LLC Via CCO Holdings Capital Corp. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,250 %	01/02/2031	1.473.502	0,03
	Chemours Co. 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,750 %	15/11/2028	1.293.063	0,00
	Cheniere Energy Partners LP 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,250 %	31/01/2032	1.036.010	0,06
	ederal Home Loan Banks	USD	2,625 %	12/09/2025	652.082	0,03
	ederal Home Loan Banks	USD	5,625 %	14/03/2036	517.277	0,03
	Glencore Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,125 %	30/05/2023	2.665.955	0,14
	Slencore Funding LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,125 %	12/03/2024	1.466.285	0,14
	lyundai Capital America 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,650 %	17/09/2026	6.164.498	0,33
	Ronos del Tesoro de Indonesia—JPMorgan Chase Bank NA 144A <sup>(c)(d)</sup>	IDR	7,500 %	17/06/2035	3.995.603	0,21
	nternational Flavors & Fragrances, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,230 %	01/10/2025	1.082.666	0,06
	MasTec, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,500 %	15/08/2028	2.254.003	0,00
	Sirius XM Radio, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,875 %	01/09/2031	454.892	0,02
	State of California	USD	7,625 %	01/03/2040	442.623	0,02
	State of California	USD	6,725 %	01/04/2035	220.124	0,02
	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,711 %	29/01/2027	1.212.537	0,06
	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,691 %	15/09/2031	1.235.492	0,00
20.000	Name of the second of the seco	-	2,001 70	10/00/2001	38.230.664	2,04
TOTAL DE BONOS						
(coste EUR 64.412.		40.00			67.346.241	3,60
Obligaciones con Estados Unidos	n garantía de activos emitidos o garantizados por agencias	- 12,26	%			
	ederal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	3,458 %	25/08/2023	182.885	0,01
	ederal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	3,889 %	25/03/2029	430.971	0,02
	ederal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/12/2035	2.832	0,00
1.472 Fe	ederal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	01/02/2037	1.455	0,00
12.607 Fe	ederal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	01/02/2041	12.206	0,00
8.573 Fe	ederal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	01/02/2041	8.300	0,00
347.752 Fe	ederal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	5,911 %	15/05/2041	46.406	0,00
1.000.289 Fe	ederal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	6,461 %	15/06/2042	143.125	0,01
567.195 Fe	ederal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	5,911 %	15/09/2043	74.580	0,00
	ederal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	5,961 %	15/03/2044	38.711	0,00
	ederal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	5,511 %	15/05/2045	98.862	0,01
	ederal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	5,911 %	15/05/2046	298.656	0,02
	rederal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	5,958 %	25/10/2048	175.843	0,01
	ederal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	6,008 %	25/08/2049	221.568	0,01
	ederal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,500 %	25/06/2050	1.270.309	0,07

			(a)		Valor de mercado en	% del
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	EUR	patrimonio
-	on garantía de activos emitidos o garantizados por agene – (continuación)	cias – (conti	nuación)			
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	25/07/2050	94.898	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	5,000 %	25/07/2050	85.621	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	6,008 %	25/07/2050	598.594	0,03
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD USD	3,000 % 4,000 %	25/08/2050 25/08/2050	262.505 883.340	0,01 0,05
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	2,000 %	25/09/2050	406.061	0,03
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	4,000 %	25/09/2050	120.331	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	3,000 %	01/12/2050	9.047.130	0,48
2.959.366	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	2,500 %	01/09/2051	2.689.448	0,14
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD	2,500 %	01/09/2051	3.584.704	0,19
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,050 %	25/08/2033	2.825.549	0,15
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(C)(d)</sup>	USD USD	2,100 %	25/12/2033	1.695.598	0,09
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,450 % 7,550 %	25/10/2041 25/10/2041	1.067.766 575.403	0,06 0,03
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,698 %	25/11/2041	1.313.061	0,03
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,792 %	25/01/2050	1.957.907	0,11
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,939 %	25/02/2050	707.843	0,04
753.187	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,842 %	25/08/2050	667.805	0,04
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,242 %	25/09/2050	187.167	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	5,342 %	25/09/2050	1.601.165	0,09
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(C)(d)</sup>	USD USD	4,850 %	25/10/2050	3.225.548	0,17
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	2,650 % 4,050 %	25/11/2050 25/11/2050	739.267 1.584.552	0,04 0,09
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	2,049 %	25/12/2050	1.026.117	0,06
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	6,678 %	25/04/2037	78.772	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	6,211 %	25/03/2038	88.218	0,01
32.492	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/07/2039	31.631	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	5,858 %	25/12/2040	29.142	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/05/2041	235.212	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	6,458 %	25/12/2041	56.697	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(c)</sup> Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(c)</sup>	USD USD	5,858 % 6,578 %	25/02/2042 25/07/2042	99.483 73.028	0,01 0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	7,000 %	25/07/2042	48.826	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	7,000 %	25/10/2042	13.904	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/12/2042	10.022	0,00
15.579	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/12/2042	14.610	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/01/2043	19.211	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/01/2043	14.655	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA) Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD USD	3,000 % 3,000 %	01/01/2043 01/04/2043	38.715 22.464	0,00 0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/04/2043	9.790	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/04/2043	13.410	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/04/2043	48.031	0,00
43.532	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	3,000 %	01/04/2043	40.896	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	6,508 %	25/02/2044	75.761	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/05/2044	10.088	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/09/2044	16.393	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(c)</sup> Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD USD	5,482 % 4,500 %	25/05/2045 01/06/2045	220.771 579.496	0,01 0,03
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	01/03/2046	36.507	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	01/03/2046	37.230	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	01/06/2046	47.674	0,00
12.349	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	01/08/2046	11.708	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	01/10/2046	85.940	0,01
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	01/10/2046	16.096	0,00
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	6,008 %	25/05/2047	290.737	0,02
	Federal National Mortgage Association (FNMA) Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD USD	4,500 %	01/11/2047	2.677.944	0,14
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	6,058 % 4,000 %	25/11/2047 01/01/2048	29.984 7.491.839	0,00 0,40
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	2,500 %	25/03/2048	228.256	0,40
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/06/2048	815.072	0,04
3.455.846	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	25/06/2048	502.402	0,03
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/07/2048	503.386	0,03
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/09/2048	770.598	0,04
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	5,000 %	01/11/2048	5.543.433	0,30
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,500 %	01/01/2049	793.538	0,04
	Federal National Mortgage Association (FNMA) Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD USD	4,500 % 4,500 %	01/07/2049 01/01/2050	799.977 802.057	0,04 0,04
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(c)</sup>	USD	5,908 %	25/01/2050	107.166	0,04
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 %	25/07/2050	124.258	0,01

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en EUR	% del patrimonio
-	con garantía de activos emitidos o garantizados por agend	cias – (conti	nuación)			
	- (continuación)	HOD	0.000.0/	05/00/0050	105 111	0.00
	Federal National Mortgage Association (FNMA) Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD USD	2,000 %	25/09/2050	435.441 110.345	0,02
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4,000 % 2,500 %	25/09/2050 01/09/2051	5.390.401	0,01 0,29
	Federal National Mortgage Association (FNMA) 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,350 %	25/11/2041	2.865.613	0,29
	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(g)</sup>	USD	2,000 %	13/12/2051	19.385.455	1,04
	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(g)</sup>	USD	3,000 %	13/12/2051	11.878.036	0,64
	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(g)</sup>	USD	4,500 %	13/12/2051	1.889.596	0,10
	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(g)</sup>	USD	2,000 %	13/01/2052	8.794.405	0,47
4.000.000	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(g)</sup>	USD	4,500 %	14/01/2052	3.781.389	0,20
784.004	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,159 %	20/02/2040	120.137	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/02/2041	3.453	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/11/2041	5.407	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/01/2042	900	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/04/2042	2.882	0,00
1.901	, , ,	USD	4,000 %	20/10/2042	1.810	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)(C)	USD	6,059 %	20/04/2043	30.034	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup>	USD	6,014 % 6,059 %	16/07/2043 20/07/2043	74.503 17.268	0,00 0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/08/2043	28.269	0,00
690.839		USD	5,860 %	20/08/2043	120.325	0,00
1.446.609	, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,	USD	6,009 %	20/10/2043	130.939	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/03/2044	2.712	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/05/2044	3.308	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/06/2044	72.330	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup>	USD	5,509 %	20/08/2044	389.894	0,02
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/11/2044	228.805	0,01
1.157.976	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,509 %	20/11/2044	158.094	0,01
852.593	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/01/2045	810.663	0,04
30.925	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/05/2045	29.404	0,00
1.452.767	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/07/2045	1.380.124	0,07
730.781	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/08/2045	77.867	0,00
507.815	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,159 %	20/08/2045	78.376	0,00
249.475	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	16/09/2045	34.830	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,159 %	20/09/2045	35.355	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/10/2045	29.926	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/10/2045	180.666	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)(C)	USD	6,159 %	20/11/2045	39.040	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,109 %	20/01/2046	41.816	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/10/2046 20/07/2047	64.576 43.721	0,00 0,00
144.770	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,569 % 4,500 %	20/02/2048	136.256	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/03/2048	48.611	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/04/2048	161.550	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/05/2048	927.272	0,05
709.719		USD	6,109 %	20/05/2048	92.381	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/08/2048	333.776	0,02
889.924	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/08/2048	840.778	0,05
485.188	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,109 %	20/08/2048	61.920	0,00
4.329.432	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/09/2048	4.053.124	0,22
566.484	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/09/2048	535.045	0,03
3.515.999	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,109 %	20/09/2048	490.465	0,03
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/10/2048	1.198.832	0,06
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,059 %	20/10/2048	439.168	0,02
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/11/2048	3.548.131	0,19
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/12/2048	4.359.331	0,23
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/12/2048	1.565.789	0,08
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/01/2049	8.183.134	0,44
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/01/2049	2.344.695	0,13
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup> Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup>	USD USD	5,959 % 6,059 %	20/01/2049	88.472 101.706	0,01 0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	3,699 %	20/01/2049 20/02/2049	87.748	0,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/02/2049	474.333	0,03
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/02/2049	505.369	0,03
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/03/2049	1.570.692	0,03
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/03/2049	277.624	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/03/2049	936.575	0,05
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/05/2049	1.917.374	0,10
	Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup>	USD	3,179 %	20/06/2049	347.501	0,02
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,009 %	20/06/2049	52.493	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/08/2049	1.826.324	0,10
1.295.742	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,959 %	20/08/2049	157.807	0,01
1.162.477	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,009 %	20/08/2049	159.552	0,01

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en EUR	% del
Obligaciones o	on garantía de activos emitidos o garantizados por agencias -	- (continuación)				
	- (continuación)					
	1 Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,959 %	20/09/2049	821.895	0,04
	6 Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD USD	6,009 % 6,009 %	20/09/2049	85.049	0,01
	5 Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(c)</sup> 9 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/09/2049 20/10/2049	76.468 281.304	0,00 0,02
	B Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/12/2049	704.210	0,02
	4 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/12/2049	1.232.394	0,0
	6 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/12/2049	239.510	0,0
	3 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/01/2050	4.566.711	0,24
	4 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/01/2050	15.167	0,00
	9 Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5.959 %	20/02/2050	364.945	0,02
	3 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/04/2050	150.936	0,0
2.587.066	6 Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,959 %	20/04/2050	377.884	0,02
1.053.396	6 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/05/2050	103.114	0,0
4.718.43	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/06/2050	479.638	0,0
14.451.97	5 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	2,500 %	20/10/2050	1.241.802	0,07
	8 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	2,500 %	20/11/2050	79.966	0,0
7.000.003	3 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/02/2051	6.393.479	0,34
9.999.306	6 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/04/2051	9.130.840	0,49
	2 Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,000 %	20/05/2051	3.652.961	0,20
	O Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	2,500 %	20/11/2051	1.814.053	0,10
	O Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(g)</sup>	USD	2,500 %	20/12/2051	27.162.955	1,45
2.000.000	O Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(g)</sup>	USD	4,500 %	20/12/2051	1.863.399	0,10
9.000.000	O Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(g)</sup>	USD	3,000 %	20/01/2052	8.186.880	0,44
		-			229.176.620	12,26
TOTAL DE OBLI	GACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZA	DOS POR AGEN	CIAS			
coste EUR 225.	685.086)				229.176.620	12,26
-	con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agenc	ias – 11,99 %				
Islas Caimán	0 A O L O L O L O L O L O L O L O L O L O		4 000 0/	00/07/0004	0.704.000	
	0 AGL CLO 6 Ltd. 2020-6A "AR" 144A (C)(d)	USD	1,332 %	20/07/2034	8.794.300	0,47
	O Anchorage Capital CLO Ltd. 2014-4RA "A"144A(c)(d)	USD	1,186 %	28/01/2031	2.375.854	0,13
	D Bain Capital Credit CLO 2020-3 Ltd. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,000 %	23/10/2034	7.030.125	0,38
	D Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "A" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,182 %	18/04/2034	1.754.789	0,09
	D Bain Capital Credit CLO Ltd. 2021-1A "D" 144A(c)(d)	USD USD	3,032 %	18/04/2034	1.746.532	0,09
	0 Catamaran CLO Ltd. 2013-1A "AR" 144A(c)(d)		0,985 %	27/01/2028	1.170.579	0,06
	0 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "ARR" 144A <sup>(c)(d)</sup> 0 ICG US CLO Ltd. 2017-1A "DRR" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD USD	1,306 % 3,686 %	28/07/2034 28/07/2034	17.151.765 8.644.914	0,92 0,46
	0 Invesco CLO Ltd. 2021-2A "A" 144A(c)(d)	USD	1,244 %	15/07/2034	21.390.994	1,14
	0 Magnetite XVI Ltd. 2015-16A "AR" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	0,922 %	18/01/2028	10.934.383	0,59
	O Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,432 %	20/04/2033	5.453.698	0,3
	0 Marble Point CLO XXII Ltd. 2021-2A "A" 144A <sup>(c)</sup> (d)	USD	1,324 %	25/07/2034	21.652.075	1,16
	0 MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,189 %	16/07/2036	2.680.445	0,14
	0 MP CLO VIII Ltd. 2015-2A "ARR" 144A(c)(d)	USD	1,336 %	28/04/2034	18.491.401	0,12
	5 Newfleet CLO Ltd. 2016-1A "A1R" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,082 %	20/04/2028	2.436.498	0,33
	O Ocean Trails Clo XI "D" 144A(c)(d)	USD	3,852 %	20/07/2034	4.271.759	0,13
	2 OCP CLO Ltd. 2015-10 "A1R" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	0,945 %	26/10/2027	1.211.590	0,23
1.576.662	2 001 0E0 Ett. 2010-10 ATT 144A	-	0,343 70	20/10/2027		
lula male					137.191.701	7,34
Irlanda 4 198 86!	5 Haus European Loan Conduit No 39 DAC 39X "A1"(c)	EUR	0,650 %	28/07/2051	4.206.869	0,22
7.130.000				18/02/2025	3.546.689	0,22
3 733 35	7 Magnolia Finance XLDAC 2018-3MGN "A"(c)	FIID	2 750 %			
	7 Magnolia Finance XI DAC 2018-3MGN "A"(c)	EUR	2,750 %			
4.218.406	6 Octagon Finance No 1 DAC "A"(c)	EUR	1,809 %	17/01/2023	4.091.854	0,22
4.218.406 3.909.83	6 Octagon Finance No 1 DAC "A"(c) 5 Primrose Residential 2021-1 DAC "A"(c)	EUR EUR	1,809 % 0,190 %	17/01/2023 24/03/2061	4.091.854 3.907.431	0,22 0,21
4.218.406 3.909.83	6 Octagon Finance No 1 DAC "A"(c)	EUR	1,809 %	17/01/2023	4.091.854 3.907.431 3.317.540	0,22 0,21 0,18
4.218.406 3.909.835 2.800.000	6 Octagon Finance No 1 DAC "A"(c) 5 Primrose Residential 2021-1 DAC "A"(c)	EUR EUR	1,809 % 0,190 %	17/01/2023 24/03/2061	4.091.854 3.907.431	0,22 0,21 0,18 1,02
4.218.406 3.909.833 2.800.000	Octagon Finance No 1 DAC "A"(c)     Frimrose Residential 2021-1 DAC "A"(c)     Viridis European Loan Conduit No 38 DAC "A"(c)	EUR EUR GBP	1,809 % 0,190 % 1,251 %	17/01/2023 24/03/2061 22/07/2029	4.091.854 3.907.431 3.317.540 19.070.383	0,22 0,2 0,18 1,02
4.218.406 3.909.838 2.800.000 Reino Unido 5.216.044	6 Octagon Finance No 1 DAC "A"(c) 5 Primrose Residential 2021-1 DAC "A"(c) 0 Viridis European Loan Conduit No 38 DAC "A"(c) 4 Finsbury Square 2021-1GRX "AGRN"(c)	EUR EUR GBP -	1,809 % 0,190 % 1,251 % 0,700 %	17/01/2023 24/03/2061 22/07/2029 16/12/2067	4.091.854 3.907.431 3.317.540 19.070.383 6.102.424	0,22 0,21 0,18 1,02
4.218.400 3.909.833 2.800.000 Reino Unido 5.216.04 1.494.803	6 Octagon Finance No 1 DAC "A"(c) 5 Primrose Residential 2021-1 DAC "A"(c) 0 Viridis European Loan Conduit No 38 DAC "A"(c) 4 Finsbury Square 2021-1GRX "AGRN"(c) 9 Harben Finance 2017-1X Plc. "A"(c)	EUR EUR GBP - GBP GBP	1,809 % 0,190 % 1,251 % 0,700 % 0,914 %	17/01/2023 24/03/2061 22/07/2029 16/12/2067 20/08/2056	4.091.854 3.907.431 3.317.540 19.070.383 6.102.424 1.755.909	0,22 0,2° 0,18 1,02 0,33 0,08
4.218.400 3.909.833 2.800.000 Reino Unido 5.216.044 1.494.809 2.400.000	6 Octagon Finance No 1 DAC "A"(c) 5 Primrose Residential 2021-1 DAC "A"(c) 0 Viridis European Loan Conduit No 38 DAC "A"(c) 4 Finsbury Square 2021-1GRX "AGRN"(c) 9 Harben Finance 2017-1X Pic. "A"(c) 0 London Wall Mortgage Capital Pic. 2021-FL2 "A"(c)	EUR EUR GBP -	1,809 % 0,190 % 1,251 % 0,700 % 0,914 % 0,000 %	17/01/2023 24/03/2061 22/07/2029 16/12/2067	4.091.854 3.907.431 3.317.540 19.070.383 6.102.424	0,22 0,2' 0,18 1,02 0,33 0,09 0,18
4.218.400 3.909.833 2.800.000 Reino Unido 5.216.044 1.494.809 2.400.000	6 Octagon Finance No 1 DAC "A"(c) 5 Primrose Residential 2021-1 DAC "A"(c) 0 Viridis European Loan Conduit No 38 DAC "A"(c) 4 Finsbury Square 2021-1GRX "AGRN"(c) 9 Harben Finance 2017-1X Plc. "A"(c)	EUR EUR GBP -	1,809 % 0,190 % 1,251 % 0,700 % 0,914 %	17/01/2023 24/03/2061 22/07/2029 16/12/2067 20/08/2056 15/05/2052	4.091.854 3.907.431 3.317.540 19.070.383 6.102.424 1.755.909 2.818.806	0,22 0,2 0,18 1,02 0,33 0,09 0,18 0,28
4.218.406 3.909.834 2.800.000  Reino Unido 5.216.044 1.494.809 2.400.000 4.497.926	6 Octagon Finance No 1 DAC "A"(c) 5 Primrose Residential 2021-1 DAC "A"(c) 0 Viridis European Loan Conduit No 38 DAC "A"(c) 4 Finsbury Square 2021-1GRX "AGRN"(c) 9 Harben Finance 2017-1X Plc. "A"(c) 10 London Wall Mortgage Capital Plc. 2021-FL2 "A"(c) 16 Stratton Mortgage Funding 2019-1 Plc. "A"(c)	EUR EUR GBP - GBP GBP GBP GBP -	1,809 % 0,190 % 1,251 % 0,700 % 0,914 % 0,000 % 1,250 %	17/01/2023 24/03/2061 22/07/2029 16/12/2067 20/08/2056 15/05/2052 25/05/2051	4.091.854 3.907.431 3.317.540 19.070.383 6.102.424 1.755.909 2.818.806 5.299.063 15.976.202	0,22 0,2 0,18 1,02 0,33 0,09 0,15 0,28
4.218.406 3.909.834 2.800.000  Reino Unido 5.216.04 1.494.809 2.400.000 4.497.920  Estados Unidos 45.336	6 Octagon Finance No 1 DAC "A"(c) 5 Primrose Residential 2021-1 DAC "A"(c) 0 Viridis European Loan Conduit No 38 DAC "A"(c) 4 Finsbury Square 2021-1GRX "AGRN"(c) 9 Harben Finance 2017-1X Plc. "A"(c) 0 London Wall Mortgage Capital Plc. 2021-FL2 "A"(c) 6 Stratton Mortgage Funding 2019-1 Plc. "A"(c)	EUR EUR GBP GBP GBP GBP GBP GBP GBP USD	1,809 % 0,190 % 1,251 % 0,700 % 0,914 % 0,000 % 1,250 %	17/01/2023 24/03/2061 22/07/2029 16/12/2067 20/08/2056 15/05/2052 25/05/2051	4.091.854 3.907.431 3.317.540 19.070.383 6.102.424 1.755.909 2.818.806 5.299.063 15.976.202	0,22 0,2 0,18 1,02 0,33 0,08 0,11 0,28
4.218.406 3.909.834 2.800.006  Reino Unido 5.216.044 1.494.809 2.400.000 4.497.926  Estados Unidos 45.336 165.376	6 Octagon Finance No 1 DAC "A"(c) 5 Primrose Residential 2021-1 DAC "A"(c) 0 Viridis European Loan Conduit No 38 DAC "A"(c) 4 Finsbury Square 2021-1GRX "AGRN"(c) 9 Harben Finance 2017-1X Plc. "A"(c) 10 London Wall Mortgage Capital Plc. 2021-FL2 "A"(c) 6 Stratton Mortgage Funding 2019-1 Plc. "A"(c) 6 Alternative Loan Trust 2005-24 "1A1"(c) 6 Alternative Loan Trust 2006-OA1 "2A1"(c)	EUR EUR GBP - GBP GBP GBP GBP -	1,809 % 0,190 % 1,251 % 0,700 % 0,914 % 0,000 % 1,250 %	17/01/2023 24/03/2061 22/07/2029 16/12/2067 20/08/2056 15/05/2052 25/05/2051	4.091.854 3.907.431 3.317.540 19.070.383 6.102.424 1.755.909 2.818.806 5.299.063 15.976.202	0,22 0,2 0,18 1,02 0,33 0,08 0,11 0,28
4.218.406 3.909.834 2.800.006  Reino Unido 5.216.044 1.494.809 2.400.000 4.497.926  Estados Unidos 45.336 165.376	6 Octagon Finance No 1 DAC "A"(c) 5 Primrose Residential 2021-1 DAC "A"(c) 0 Viridis European Loan Conduit No 38 DAC "A"(c) 4 Finsbury Square 2021-1GRX "AGRN"(c) 9 Harben Finance 2017-1X Plc. "A"(c) 0 London Wall Mortgage Capital Plc. 2021-FL2 "A"(c) 6 Stratton Mortgage Funding 2019-1 Plc. "A"(c) 6 Alternative Loan Trust 2005-24 "1A1"(c) 6 Alternative Loan Trust 2006-0A1 "2A1"(c) 8 Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset Backed Pass-Through	GBP	1,809 % 0,190 % 1,251 %  0,700 % 0,914 % 0,000 % 1,250 %  1,397 % 0,511 %	17/01/2023 24/03/2061 22/07/2029 16/12/2067 20/08/2056 15/05/2052 25/05/2051	4.091.854 3.907.431 3.317.540 19.070.383 6.102.424 1.755.909 2.818.806 5.299.063 15.976.202	0,22 0,2* 0,18 1,02 0,33 0,08 0,18 0,28 0,00 0,00
4.218.406 3.909.834 2.800.000  Reino Unido 5.216.044 1.494.809 2.400.000 4.497.926  Estados Unidos 45.336 165.376 2.053.746	6 Octagon Finance No 1 DAC "A"(c) 5 Primrose Residential 2021-1 DAC "A"(c) 0 Viridis European Loan Conduit No 38 DAC "A"(c) 4 Finsbury Square 2021-1GRX "AGRN"(c) 9 Harben Finance 2017-1X Plc. "A"(c) 10 London Wall Mortgage Capital Plc. 2021-FL2 "A"(c) 6 Stratton Mortgage Funding 2019-1 Plc. "A"(c) 6 Alternative Loan Trust 2005-24 "1A1"(c) 6 Alternative Loan Trust 2006-OA1 "2A1"(c)	EUR EUR GBP GBP GBP GBP GBP GBP GBP USD	1,809 % 0,190 % 1,251 % 0,700 % 0,914 % 0,000 % 1,250 %	17/01/2023 24/03/2061 22/07/2029 16/12/2067 20/08/2056 15/05/2052 25/05/2051	4.091.854 3.907.431 3.317.540 19.070.383 6.102.424 1.755.909 2.818.806 5.299.063 15.976.202	0,22 0,21 0,18

			Tipo de		Valor de mercado	% del
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en EUR	patrimonio
-	on garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias	– (continua	ción)			
	- (continuación)	HOD	0.474.0/	00/40/0040	00.040	0.04
	Banc of America Funding 2006-I Trust "6A1"(c)	USD	0,471 %	20/12/2046	89.943	0,01
	Banc of America Funding 2007-D Trust "1A5" <sup>(c)</sup> Bank 2017-BNK4 "C" <sup>(c)</sup>	USD USD	0,646 % 4,372 %	20/06/2047 15/05/2050	248.138 2.248.829	0,01 0,12
	Bank 2017-BNK6 "A4"	USD	3,254 %	15/07/2060	2.420.255	0,12
	Bank 2017-BNK9 "D" 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,800 %	15/11/2054	739.674	0,13
	Bank 2018-BNK14 "D" 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,000 %	15/09/2060	791.566	0,04
	Bank 2018-BNK15 "D" 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,000 %	15/11/2061	1.061.078	0,06
	BBCMS Mortgage Trust 2018-C2 "D" 144A(d)	USD	3,000 %	15/12/2051	951.470	0,05
1.800.000	Benchmark Mortgage Trust 2018-B6 "D" 144A(c)(d)	USD	3,261 %	10/10/2051	1.508.859	0,08
450.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P7 "D" 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,250 %	14/04/2050	320.309	0,02
1.500.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(d)	USD	3,000 %	15/09/2050	1.199.762	0,06
	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-HE2 "M1"(c)	USD	0,382 %	25/08/2036	754.502	0,04
	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.(c)	USD	0,764 %	25/10/2035	394.439	0,02
	COMM Mortgage Trust 2017-COR2 "D" 144A(d)	USD	3,000 %	10/09/2050	554.009	0,03
	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R02 "1M2" 144A(c)(d)	USD	2,392 %	25/08/2031	111.668	0,01
	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R03 "1M2" 144A(c)(d)	USD	2,242 %	25/09/2031	52.041	0,00
	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01 "1M2" 144A(c)(d)	USD USD	2,142 %	25/01/2040	352.363	0,02 0,08
	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01 144A <sup>(c)(d)</sup> Countrywide Home Equity Loan Trust 2006-HW "2A1A" <sup>(c)</sup>	USD	6,050 % 0,240 %	25/10/2041 15/11/2036	1.485.869 20.728	0,08
	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 2005-8 "9A9"(c)	USD	0,240 %	25/09/2035	41.328	0,00
	GreenPoint Mortgage Funding Trust 2005-AR5 "1A1"(c)	USD	0,739 %	25/11/2045	81.672	0,00
	GSAA Home Equity Trust 2006-10 "AF3"(c)	USD	5,985 %	25/06/2036	610.956	0,03
	GSR Mortgage Loan Trust 2006-OA1 "2A2"(c)	USD	0,612 %	25/08/2046	582.960	0,03
	HarborView Mortgage Loan Trust 2006-6 "3A1A"(c)	USD	3,021 %	19/08/2036	149.147	0,01
	Higher Education Funding I 2014-1 "A" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,230 %	25/05/2034	1.879.140	0,10
	Home Equity Loan Trust 2007-FRE1 "2AV3"(c)	USD	0,322 %	25/04/2037	861.107	0,05
	Impac Secured Assets Trust 2007-1 "A2"(c)	USD	0,252 %	25/03/2037	89.821	0,01
	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-AR5 "2A1"(c)	USD	2,976 %	25/05/2037	1.093.488	0,06
	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2017-C7 "D" 144A(d)	USD	3,000 %	15/10/2050	1.207.714	0,07
300.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C9 "A4"	USD	3,102 %	15/05/2046	269.693	0,01
1.500.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-L1 "D" 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,000 %	15/10/2051	1.135.620	0,06
437.939	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2007-15AR "2A1"(c)	USD	2,792 %	25/11/2037	334.033	0,02
6.185.921	Navient Student Loan Trust 2017-2A "A" 144A(c)(d)	USD	1,142 %	27/12/2066	5.492.548	0,29
	PHEAA Student Loan Trust 2016-1A "A" 144A(c)(d)	USD	1,242 %	25/09/2065	2.293.235	0,12
	RALI Series 2006-QO10 Trust "A1"(c)	USD	0,409 %	25/01/2037	2.634.049	0,14
	RALI Series 2006-QS8 Trust "A4"(c)	USD	0,539 %	25/08/2036	98.558	0,01
	RALI Series 2007-QO1 Trust "A1"(c)	USD	0,392 %	25/02/2047	765.946	0,04
	Ready Capital Mortgage Financing LLC 2021-FL7 "A" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	1,280 %	25/11/2036	4.317.015	0,23
	SLM Student Loan Trust 2003-1 "A5A" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	0,226 %	15/12/2032	1.107.984	0,06
	SLM Student Loan Trust 2007-2 "A4" <sup>(C)</sup>	USD	0,184 %	25/07/2022	1.516.003	0,08
	SLM Student Loan Trust 2008-4 "A4" <sup>(c)</sup> SLM Student Loan Trust 2008-5 "A4" <sup>(c)</sup>	USD USD	1,774 % 1,824 %	25/07/2022 25/07/2023	458.220 578.737	0,03 0,03
	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2007-AR6 "A1"(c)	USD	1,587 %	25/08/2047	401.040	0,03
	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 2006-WF3 "M1"(c)	USD	0,339 %	25/09/2036	1.652.923	0,02
	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 2007-WG "2A4"(c)	USD	0,352 %	25/05/2047	419.177	0,03
	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR16 Trust "3A1"(c)	USD	3,115 %	25/12/2036	280.286	0,02
	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT		2,	25. 12.2000	200.200	0,02
	Series 2006-8 Trust "A5"(h)	USD	4,184 %	25/10/2036	1.009.265	0,05
750.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C37 "D" 144A(c)(d)	USD	3,342 %	15/12/2049	614.878	0,03
1.000.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RB1 "D" 144A(d)	USD	3,401 %	15/03/2050	819.263	0,04
					51.881.038	2,78
TOTAL DE OBL	LIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS NO EMITIDOS NI GAR	ANTIZADOS	S POR AGENO	PIAS		
(coste EUR 214		ANTIZADOC	ON AGENC	ino	224.119.324	11,99
	DRES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO	<u> </u>				
(coste EUR 504					520.642.185	27,85
	CCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS					
(coste EUR 1.82	2.973.628)				1.876.737.530	100,39
	rantía de activos hipotecarios a plazo cubiertos – (0,59 %)					
	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(g)(i)</sup>	USD	5,000 %	13/12/2051	(962.477)	(0,05)
	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(9)(j)</sup>	USD	3,000 %	20/12/2051	(6.377.426)	(0,34)
(4.000.000)	Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(g)(j)</sup>	USD	4,000 %	20/12/2051	(3.709.571)	(0,20)
				-	(11.049.474)	(0,59)
TOTAL DE VALO	RES HIPOTECARIOS A PLAZO CUBIERTOS					
(coste EUR (10.8					(11.049.474)	(0,59)

Número de contratos	•	Descripción del valor				Valor de mercado de la asignación EUR	Plusvalía latente en EUR	% del patrimonio
		AUD						
	232	Futuros sobre bonos del Tes	oro de Austral	ia a 10 años 15/12/2021	Larga	20.346.779	197.183	0,01
		CAD						
	120	Futuros sobre bonos del Esta	ado de Canad	á a 10 años 22/03/2022	Larga	11.698.729	220.884	0,01
		EUR						
	97 86	Futuros sobre OAT en euros		ral de Alemania a 30 años 08/12/2021	Larga	16.344.500 18.742.840	185.130 934.540	0,01 0,05
	00	i didios sobre bollos de la IX	epublica i eue	rai de Alemania a 30 anos 00/12/2021	Larga	35.087.340	1.119.670	0,06
		GBP				00.007.070		
	176	Futuros sobre bonos del Est	ado británico (	gilts) a largo plazo 29/03/2022	Larga	26.189.749	349.177	0,02
	40	JPY Futuros sobre bonos del Est	ado de Janón	a 10 aŭos 13/12/2021	Larga	47.457.900	99.905	0,00
		USD	ado do oupo					
	419	Futuros sobre bonos del Tes		• .	Larga	59.643.073	1.408.364	0,08
	2.256	Futuros sobre pagarés del Te			Larga	259.855.731	3.983.278 112.888	0,21
	200 202	Futuros sobre pagarés del Te Futuros sobre pagarés del Te			Larga Larga	38.497.750 21.604.289	226.071	0,01 0,01
	65			I. a muy largo plazo 22/03/2022	Larga	11.410.769	377.475	0,01
					-	391.011.612	6.108.076	0,33
PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS				,		8.094.895	0,43	
Número de	,					Valor de mercado de la asignación	Minusvalía latente en	% del
contratos		Descripción del valor				EUR		patrimonio
		EUR						
	59	Futuros sobre Euro BTP Bor			Larga	8.968.000	(13.850)	(0,00)
	(133) (158)			ral de Alemania a 10 años 08/12/2021 ral de Alemania a 2 años 08/12/2021	Corta Corta	(22.949.150) (17.766.310)	(78.470) (10.540)	(0,01) (0,00)
	(346)		•	ral de Alemania a 5 años 08/12/2021	Corta	(46.931.440)	(186.840)	(0,00)
						(78.678.900)	(289.700)	(0,02)
	(261)	USD Futuros sobre pagarés del Te	esoro de FF I	III. a muy larga plaza a 10 años 22/02/2022				(0,03)
					Conto	(33.715.254)	(650.507)	
MINUSVA	<u> </u>	ENTE SOBRE CONTRATOS D		JU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022	Corta	(33.715.254)	(650.507) (940.207)	(0,05)
	LÍA LATE			ou. a muy iaigu piazo a 10 anos 22/05/2022	Corta	(33.715.254)		
	LÍA LATE	ENTE SOBRE CONTRATOS D		JO. a muy langu piazu a 10 anus 22/03/2022	Corta		(940.207) Plusvalía	(0,05)
	LÍA LATE	ENTE SOBRE CONTRATOS D		Venta	Corta	(33.715.254)  Fecha de vencimiento	(940.207)	
Contratos  Divisa  BRL	LÍA LATE	isas a plazo – 0,49 %  Compra  15.005.085	Divisa USD	<b>Venta</b> 2.676.846	Corta	Fecha de vencimiento 02/12/2021	(940.207)  Plusvalía latente en EUR 2.147	% del patrimonio
Divisa BRL EUR	LÍA LATE	ENTE SOBRE CONTRATOS D isas a plazo – 0,49 %  Compra  15.005.085 4.472.765	Divisa USD PLN	Venta 2.676.846 20.622.386	Corta	Fecha de vencimiento 02/12/2021 06/12/2021	(940.207)  Plusvalía latente en EUR  2.147 59.865	% del patrimonio 0,00 0,00
Divisa BRL EUR USD	LÍA LATE	ENTE SOBRE CONTRATOS D isas a plazo – 0,49 %  Compra  15.005.085 4.472.765 26.824.549	Divisa USD PLN INR	Venta 2.676.846 20.622.386 2.005.183.541	Corta	Fecha de vencimiento 02/12/2021 06/12/2021 07/12/2021	(940.207)  Plusvalía latente en EUR  2.147 59.865 106.164	% del patrimonio 0,00 0,00 0,00 0,00
Divisa  BRL EUR USD USD	LÍA LATE	ENTE SOBRE CONTRATOS D isas a plazo – 0,49 %  Compra  15.005.085 4.472.765 26.824.549 1.084.562	Divisa USD PLN INR TRY	Venta 2.676.846 20.622.386	Corta	Fecha de vencimiento 02/12/2021 06/12/2021 07/12/2021 10/12/2021	(940.207)  Plusvalia latente en EUR  2.147 59.865 106.164 32.310	% del patrimonio 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00
Divisa BRL EUR USD	LÍA LATE	ENTE SOBRE CONTRATOS D isas a plazo – 0,49 %  Compra  15.005.085 4.472.765 26.824.549	Divisa USD PLN INR	Venta 2.676.846 20.622.386 2.005.183.541 13.773.832	Corta	Fecha de vencimiento 02/12/2021 06/12/2021 07/12/2021	(940.207)  Plusvalía latente en EUR  2.147 59.865 106.164	% del patrimonio 0,00 0,00
Divisa  BRL EUR USD USD USD	LÍA LATE	ENTE SOBRE CONTRATOS D isas a plazo – 0,49 %  Compra  15.005.085 4.472.765 26.824.549 1.084.562 21.198.133	Divisa USD PLN INR TRY KRW	Venta  2.676.846  20.622.386  2.005.183.541  13.773.832  25.006.378.033	Corta	Fecha de vencimiento 02/12/2021 06/12/2021 07/12/2021 10/12/2021 13/12/2021	(940.207)  Plusvalia latente en EUR 2.147 59.865 106.164 32.310 95.008	% del patrimonio 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00
Divisa  BRL EUR USD USD USD USD USD USD CAD	LÍA LATE	ENTE SOBRE CONTRATOS D isas a plazo – 0,49 %  Compra  15.005.085 4.472.765 26.824.549 1.084.562 21.198.133 1.086.600 5.234.000 19.860.450	Divisa  USD PLN INR TRY KRW ZAR TRY EUR	Venta  2.676.846 20.622.386 2.005.183.541 13.773.832 25.006.378.033 16.557.937 49.555.512 13.341.460	Corta	Fecha de vencimiento 02/12/2021 06/12/2021 07/12/2021 10/12/2021 13/12/2021 13/12/2021 15/12/2021	Plusvalia latente en EUR 2.147 59.865 106.164 32.310 95.008 43.824 1.292.767 322.676	% del patrimonio 0,000 0,000 0,000 0,000 0,001 0,000 0,017 0,000
Divisa  BRL EUR USD USD USD USD USD USD CAD CHF	LÍA LATE	ENTE SOBRE CONTRATOS D isas a plazo – 0,49 %  Compra  15.005.085 4.472.765 26.824.549 1.084.562 21.198.133 1.086.600 5.234.000 19.860.450 42.909.104	Divisa  USD PLN INR TRY KRW ZAR TRY EUR EUR	Venta  2.676.846  20.622.386  2.005.183.541  13.773.832  25.006.378.033  16.557.937  49.555.512  13.341.460  40.039.769	Corta	Fecha de vencimiento 02/12/2021 06/12/2021 07/12/2021 10/12/2021 13/12/2021 13/12/2021 14/12/2021 15/12/2021	Plusvalia latente en EUR 2.147 59.865 106.164 32.310 95.008 43.824 1.292.767 322.676 1.131.294	% del patrimonio 0,000 0,000 0,000 0,000 0,010 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000
Divisa  BRL EUR USD USD USD USD USD CAD CHF CHF	LÍA LATE	ENTE SOBRE CONTRATOS D isas a plazo – 0,49 %  Compra  15.005.085 4.472.765 26.824.549 1.084.562 21.198.133 1.086.600 5.234.000 19.860.450 42.909.104 33.440.544	Divisa  USD PLN INR TRY KRW ZAR TRY EUR EUR USD	Venta  2.676.846 20.622.386 2.005.183.541 13.773.832 25.006.378.033 16.557.937 49.555.512 13.341.460 40.039.769 36.495.403	Corta	Fecha de vencimiento 02/12/2021 06/12/2021 07/12/2021 10/12/2021 13/12/2021 14/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021	Plusvalia latente en EUR 2.147 59.865 106.164 32.310 95.008 43.824 1.292.767 322.676 1.131.294 26.328	% del patrimonio 0,000 0,000 0,000 0,001 0,000 0,001 0,000 0,007 0,002 0,006 0,006 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0
Divisa  BRL EUR USD USD USD USD USD CAD CHF CHF CNH	LÍA LATE	ENTE SOBRE CONTRATOS D isas a plazo – 0,49 %  Compra  15.005.085 4.472.765 26.824.549 1.084.562 21.198.133 1.086.600 5.234.000 19.860.450 42.909.104 33.440.544 378.181.188	Divisa  USD PLN INR TRY KRW ZAR TRY EUR EUR USD USD	Venta  2.676.846 20.622.386 2.005.183.541 13.773.832 25.006.378.033 16.557.937 49.555.512 13.341.460 40.039.769 36.495.403 58.492.980	Corta	Fecha de vencimiento 02/12/2021 06/12/2021 07/12/2021 10/12/2021 13/12/2021 13/12/2021 14/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021	Plusvalia latente en EUR 2.147 59.865 106.164 32.310 95.008 43.824 1.292.767 322.676 1.131.294 26.328 731.579	% del patrimonio 0,000 0,000 0,000 0,000 0,010 0,000 0,010 0,000 0,010 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000
Divisa  BRL EUR USD USD USD USD CAD CHF CHF CNH EUR	LÍA LATE	ENTE SOBRE CONTRATOS D isas a plazo – 0,49 %  Compra  15.005.085 4.472.765 26.824.549 1.084.562 21.198.133 1.086.600 5.234.000 19.860.450 42.909.104 33.440.544 378.181.188 2.408.140	Divisa  USD PLN INR TRY KRW ZAR TRY EUR EUR USD USD USD CAD	Venta  2.676.846 20.622.386 2.005.183.541 13.773.832 25.006.378.033 16.557.937 49.555.512 13.341.460 40.039.769 36.495.403 58.492.980 3.469.227	Corta	Fecha de vencimiento 02/12/2021 06/12/2021 07/12/2021 10/12/2021 13/12/2021 13/12/2021 14/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021	Plusvalia latente en EUR 2.147 59.865 106.164 32.310 95.008 43.824 1.292.767 322.676 1.131.294 26.328 731.579 21.286	% del patrimonio 0,000 0,000 0,000 0,001 0,007 0,007 0,002 0,006 0,000 0,044 0,000
Divisa  BRL EUR USD USD USD USD USD CAD CHF CHF CNH	LÍA LATE	ENTE SOBRE CONTRATOS D isas a plazo – 0,49 %  Compra  15.005.085 4.472.765 26.824.549 1.084.562 21.198.133 1.086.600 5.234.000 19.860.450 42.909.104 33.440.544 378.181.188	Divisa  USD PLN INR TRY KRW ZAR TRY EUR EUR USD USD	Venta  2.676.846 20.622.386 2.005.183.541 13.773.832 25.006.378.033 16.557.937 49.555.512 13.341.460 40.039.769 36.495.403 58.492.980	Corta	Fecha de vencimiento 02/12/2021 06/12/2021 07/12/2021 10/12/2021 13/12/2021 13/12/2021 14/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021	Plusvalia latente en EUR 2.147 59.865 106.164 32.310 95.008 43.824 1.292.767 322.676 1.131.294 26.328 731.579	(0,05)  % de patrimonio  0,00  0,00  0,00  0,01  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00
Divisa  BRL EUR USD USD USD USD USD CAD CHF CHF CHF EUR EUR	LÍA LATE	Compra  15.005.085 4.472.765 26.824.549 1.084.562 21.198.133 1.086.600 5.234.000 19.860.450 42.909.104 33.440.544 378.181.188 2.408.140 3.915.769	Divisa  USD PLN INR TRY KRW ZAR TRY EUR EUR USD USD USD USD CAD NZD	Venta  2.676.846 20.622.386 2.005.183.541 13.773.832 25.006.378.033 16.557.937 49.555.512 13.341.460 40.039.769 36.495.403 58.492.980 3.469.227 6.469.790	Corta	Fecha de vencimiento  02/12/2021 06/12/2021 10/12/2021 11/12/2021 13/12/2021 14/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021	Plusvalia latente en EUR 2.147 59.865 106.164 32.310 95.008 43.824 1.292.767 322.676 1.131.294 26.328 731.579 21.286 29.602	(0,05)  % de patrimonio  0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000
Divisa  BRL EUR USD USD USD USD CAD CHF CNH EUR	LÍA LATE	ENTE SOBRE CONTRATOS D isas a plazo – 0,49 %  Compra  15.005.085 4.472.765 26.824.549 1.084.562 21.198.133 1.086.600 5.234.000 19.860.450 42.909.104 33.440.544 378.181.188 2.408.140 3.915.769 6.933.780 6.795.713 11.428.935	Divisa  USD PLN INR TRY EUR EUR EUR USD USD CAD NZD PLN SEK EUR	Venta  2.676.846 20.622.386 2.005.183.541 13.773.832 25.006.378.033 16.557.937 49.555.512 13.341.460 40.039.769 36.495.403 58.492.980 3.469.227 6.469.790 31.881.869 68.568.578 13.386.427	Corta	Fecha de vencimiento  02/12/2021 06/12/2021 07/12/2021 10/12/2021 13/12/2021 13/12/2021 14/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021	Plusvalia latente en EUR 2.147 59.865 106.164 32.310 95.008 43.824 1.292.767 322.676 1.131.294 26.328 731.579 21.286 29.602 117.778 111.849 29.179	(0,05)  % de patrimonic  0,000 0,000 0,000 0,001 0,000 0,001 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000
Divisa  BRL EUR USD USD USD CAD CHF CNH EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR GBP ILS	LÍA LATE	Compra  15.005.085 4.472.765 26.824.549 1.084.562 21.198.133 1.086.600 5.234.000 19.860.450 42.909.104 33.440.544 378.181.188 2.408.140 3.915.769 6.933.780 6.795.713 11.428.935 8.443.463	Divisa  USD PLN INR TRY KRW ZAR TRY EUR EUR USD USD CAD NZD PLN SEK EUR EUR	Venta  2.676.846 20.622.386 2.005.183.541 13.773.832 25.006.378.033 16.557.937 49.555.512 13.341.460 40.039.769 36.495.403 58.492.980 3.469.227 6.469.790 31.881.869 68.568.578 13.386.427 2.326.103	Corta	Fecha de vencimiento  02/12/2021 06/12/2021 07/12/2021 10/12/2021 13/12/2021 13/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021	Plusvalia latente en EUR 2.147 59.865 106.164 32.310 95.008 43.824 1.292.767 322.676 1.131.294 26.328 731.579 21.286 29.602 117.778 111.849 29.179 33.022	(0,05)  % de patrimonic  0,000 0,000 0,000 0,001 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000
Divisa  BRL EUR USD USD USD USD CAD CHF CHF EUR	LÍA LATE	Compra  15.005.085 4.472.765 26.824.549 1.084.562 21.198.133 1.086.600 5.234.000 19.860.450 42.909.104 33.440.544 378.181.188 2.408.140 3.915.769 6.933.780 6.795.713 11.428.935 8.443.463 1.191.077.539	Divisa  USD PLN INR TRY KRW ZAR TRY EUR EUR USD CAD NZD PLN SEK EUR	Venta  2.676.846 20.622.386 2.005.183.541 13.773.832 25.006.378.033 16.557.937 49.555.512 13.341.460 40.039.769 36.495.403 58.492.980 3.469.227 6.469.790 31.881.869 68.568.578 13.386.427 2.326.103 9.253.763	Corta	Fecha de vencimiento  02/12/2021 06/12/2021 10/12/2021 10/12/2021 13/12/2021 13/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021	Plusvalia latente en EUR 2.147 59.865 106.164 32.310 95.008 43.824 1.292.767 322.676 1.131.294 26.328 731.579 21.286 29.602 117.778 111.849 29.179 33.022 40.510	(0,05)  % de patrimonio  0,000 0,000 0,001 0,000 0,007 0,002 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000
Divisa  BRL EUR USD USD USD USD CAD CHF CHF EUR	LÍA LATE	Compra  15.005.085 4.472.765 26.824.549 1.084.562 21.198.133 1.086.600 5.234.000 19.860.450 42.909.104 33.440.544 378.181.188 2.408.140 3.915.769 6.933.780 6.795.713 11.428.935 8.443.463 1.191.077.539 13.423.310	Divisa  USD PLN INR TRY KRW ZAR TRY EUR EUR USD USD CAD NZD PLN SEK EUR EUR EUR EUR AUD	Venta  2.676.846 20.622.386 2.005.183.541 13.773.832 25.006.378.033 16.557.937 49.555.512 13.341.460 40.039.769 36.495.403 58.492.980 3.469.227 6.469.790 31.881.869 68.568.578 13.386.427 2.326.103 9.253.763 18.071.907	Corta	Fecha de vencimiento  02/12/2021 06/12/2021 10/12/2021 11/12/2021 13/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021	(940.207)  Plusvalia latente en EUR  2.147 59.865 106.164 32.310 95.008 43.824 1.292.767 322.676 1.131.294 26.328 731.579 21.286 29.602 117.778 111.849 29.179 33.022 40.510 420.217	(0,05)  % de patrimonic  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00  0,00
Divisa  BRL EUR USD USD USD USD CAD CAHF CHF CNH EUR	LÍA LATE	Compra  15.005.085 4.472.765 26.824.549 1.084.562 21.198.133 1.086.600 5.234.000 19.860.450 42.909.104 33.440.544 378.181.188 2.408.140 3.915.769 6.933.780 6.795.713 11.428.935 8.443.463 1.191.077.539 13.423.310 69.687.201	Divisa  USD PLN INR TRY KRW ZAR TRY EUR EUR USD CAD NZD PLN SEK EUR EUR EUR EUR EUR AUD CAD	Venta  2.676.846 20.622.386 2.005.183.541 13.773.832 25.006.378.033 16.557.937 49.555.512 13.341.460 40.039.769 36.495.403 58.492.980 3.469.227 6.469.790 31.881.869 68.568.578 13.386.427 2.326.103 9.253.763 18.071.907 88.037.088	Corta	Fecha de vencimiento  02/12/2021 06/12/2021 10/12/2021 10/12/2021 13/12/2021 13/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021	Plusvalia latente en EUR 2.147 59.865 106.164 32.310 95.008 43.824 1.292.767 322.676 1.131.294 26.328 731.579 21.286 29.602 117.778 111.849 29.179 33.022 40.510 420.217 647.157	(0,05)  % de patrimonio  0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000
Divisa  BRL EUR USD USD USD USD USD CAP CHF CNH EUR	LÍA LATE	ENTE SOBRE CONTRATOS D isas a plazo - 0,49 %  Compra  15.005.085 4.472.765 26.824.549 1.084.562 21.198.133 1.086.600 5.234.000 19.860.450 42.909.104 33.440.544 378.181.188 2.408.140 3.915.769 6.933.780 6.795.713 11.428.935 8.443.463 1.191.077.539 13.423.310 69.687.201 5.447.463	Divisa  USD PLN INR TRY EUR EUR EUR USD USD CAD NZD PLN SEK EUR	Venta  2.676.846 20.622.386 2.005.183.541 13.773.832 25.006.378.033 16.557.937 49.555.512 13.341.460 40.039.769 36.495.403 58.492.980 3.469.227 6.469.790 31.881.869 68.568.578 13.386.427 2.326.103 9.253.763 18.071.907 88.037.088 119.992.622	Corta	Fecha de vencimiento  02/12/2021 06/12/2021 07/12/2021 10/12/2021 13/12/2021 13/12/2021 14/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021	Plusvalia latente en EUR 2.147 59.865 106.164 32.310 95.008 43.824 1.292.767 322.676 1.131.294 26.328 731.579 21.286 29.602 117.778 111.849 29.179 33.022 40.510 420.217 647.157 92.370	(0,05)  % de patrimonic  0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000
Divisa  BRL EUR USD USD USD USD CAD CAHF CHF CNH EUR	LÍA LATE	Compra  15.005.085 4.472.765 26.824.549 1.084.562 21.198.133 1.086.600 5.234.000 19.860.450 42.909.104 33.440.544 378.181.188 2.408.140 3.915.769 6.933.780 6.795.713 11.428.935 8.443.463 1.191.077.539 13.423.310 69.687.201	Divisa  USD PLN INR TRY KRW ZAR TRY EUR EUR USD CAD NZD PLN SEK EUR EUR EUR EUR EUR AUD CAD	Venta  2.676.846 20.622.386 2.005.183.541 13.773.832 25.006.378.033 16.557.937 49.555.512 13.341.460 40.039.769 36.495.403 58.492.980 3.469.227 6.469.790 31.881.869 68.568.578 13.386.427 2.326.103 9.253.763 18.071.907 88.037.088	Corta	Fecha de vencimiento  02/12/2021 06/12/2021 10/12/2021 10/12/2021 13/12/2021 13/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021 15/12/2021	Plusvalia latente en EUR 2.147 59.865 106.164 32.310 95.008 43.824 1.292.767 322.676 1.131.294 26.328 731.579 21.286 29.602 117.778 111.849 29.179 33.022 40.510 420.217 647.157	% del patrimonio 0,000 0,000 0,000 0,000 0,010 0,000 0,010 0,000 0,010 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000 0,000

Contratos de divisas a plazo - (continuación)

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en EUR	% del patrimonio
USD	119.697.340	JPY	13.358.410.169	15/12/2021	910.172	0,05
USD	13.399.706	MXN	274.996.665	15/12/2021	471.392	0,03
USD	31.562.503	NOK	270.831.072	15/12/2021	1.431.441	0,08
USD	60.036.506	NZD	86.259.938	15/12/2021	926.382	0,05
USD	80.566.270	SEK	696.761.457	15/12/2021	2.855.873	0,18
USD	5.512.411	SGD	7.498.257	15/12/2021	12.722	0,00
USD	20.947.378	THB	692.404.250	15/12/2021	351.112	0,02
USD	22.457.037	TRY	206.132.895	15/12/2021	5.985.990	0,32
USD	15.393.229	ZAR	228.825.038	15/12/2021	940.224	0,05
USD	1.801.354	TRY	21.575.844	20/12/2021	147.519	0,01
USD	708.361	ILS	2.170.419	21/12/2021	15.611	0,00
USD	3.338.476	ILS	10.474.806	22/12/2021	4.732	0,00
ILS	24.189.389	USD	7.635.600	24/12/2021	54.825	0,00
USD	662.238	ILS	2.043.996	24/12/2021	10.322	0,00
TWD	159.604.772	USD	5.747.174	19/01/2022	35.539	0,00
EUR	100.854.430	GBP	85.265.175	21/01/2022	841.786	0,04
EUR	57.043.269	CAD	82.270.255	31/01/2022	513.839	0,03
USD	3.450.169	CLP	2.843.318.997	07/02/2022	62.945	0,00
EUR	729.345.093	USD	821.501.648	10/02/2022	9.008.466	0,48
USD	12.203.795	KRW	14.457.740.807	10/02/2022	16.974	0,00
USD	8.181.310	RUB	614.358.282	10/02/2022	15.384	0,00
USD	10.467.000	TRY	101.001.317	14/06/2022	3.084.072	0,17
PLUSVALÍA LATEN	TE SOBRE CONTRATOS DE	DIVISAS	A PLAZO		38.818.810	2,08

				Fecha	latente en	% del
Divisa	Compra	Divisa	Venta	de vencimiento	EUR	patrimonio
USD	2.717.579	BRL	15.386.934	02/12/2021	(26.270)	(0,00)
PLN	4.285.168	EUR	931.700	06/12/2021	(14.735)	(0,00)
INR	1.928.181.368	USD	26.033.738	07/12/2021	(312.374)	(0,01)
USD	14.872.993	ZAR	237.553.310	09/12/2021	(8.127)	(0,00)
ZAR	278.694.494	USD	17.483.786	09/12/2021	(21.206)	(0,01)
ZAR	84.875.746	USD	5.536.936	13/12/2021	(195.684)	(0,01)
TRY	92.632.950	USD	10.467.000	14/12/2021	(3.016.740)	(0,16)
AUD	18.475.634	NZD	19.427.143	15/12/2021	(43.528)	(0,00)
AUD	80.709.858	USD	59.361.799	15/12/2021	(1.360.836)	(0,07)
CAD	69.319.737	USD	55.180.696	15/12/2021	(781.467)	(0,04)
CZK	181.106.081	EUR	7.134.845	15/12/2021	(51.652)	(0,00)
CZK	267.507.172	USD	12.378.935	15/12/2021	(411.980)	(0,02)
EUR	6.658.477	AUD	10.737.139	15/12/2021	(97.784)	(0,00)
EUR	4.469.642	CHF	4.836.331	15/12/2021	(170.793)	(0,01)
EUR	4.563.616	CZK	117.166.275	15/12/2021	(18.844)	(0,00)
EUR	2.395.185	GBP	2.055.596	15/12/2021	(17.731)	(0,00)
EUR	11.828.604	HUF	4.333.759.731	15/12/2021	(8.482)	(0,00)
EUR	9.498.507	JPY	1.247.574.635	15/12/2021	(236.627)	(0,01)
EUR	283.700.653	USD	328.350.408	15/12/2021	(4.741.601)	(0,27)
GBP	47.546.105	USD	64.712.870	15/12/2021	(1.036.626)	(0,04)
HUF	3.267.169.357	EUR	9.134.177	15/12/2021	(210.340)	(0,01)
HUF	568.644.976	USD	1.915.494	15/12/2021	(129.504)	(0,01)
JPY	10.755.791.036	USD	96.210.730	15/12/2021	(587.041)	(0,05)
MXN	168.885.789	USD	8.151.809	15/12/2021	(221.458)	(0,01)
NOK	135.722.947	EUR	13.252.865	15/12/2021	(75.563)	(0,00)
NOK	122.000.953	USD	14.116.669	15/12/2021	(555.871)	(0,03)
NZD	112.081.903	USD	79.573.278	15/12/2021	(2.578.313)	(0,14)
PLN	42.730.490	EUR	9.291.053	15/12/2021	(155.729)	(0,00)
PLN	30.866.689	USD	8.078.604	15/12/2021	(497.750)	(0,03)
SEK	47.678.463	EUR	4.757.995	15/12/2021	(110.438)	(0,01)
SEK	594.530.474	USD	67.503.116	15/12/2021	(1.345.614)	(0,08)
SGD	7.291.454	USD	5.407.666	15/12/2021	(53.912)	(0,00)
THB	247.807.309	USD	7.403.364	15/12/2021	(43.458)	(0,00)
TRY	116.010.800	USD	11.933.025	15/12/2021	(2.748.956)	(0,14)
USD	48.924.398	CHF	45.031.809	15/12/2021	(229.726)	(0,01)
USD	42.071.215	CNH	271.964.626	15/12/2021	(520.252)	(0,02)
USD	2.524.850	ILS	8.088.480	15/12/2021	(41.966)	(0,00)
ZAR	305.908.560	USD	20.431.008	15/12/2021	(1.127.217)	(0,07)
USD	9.306.992	IDR	133.495.968.997	17/12/2021	(1.431)	(0,00)
ILS	18.252.245	USD	5.836.372	22/12/2021	(25.029)	(0,00)
INR	264.590.603	USD	3.520.725	27/12/2021	(2.198)	(0,00)
USD	33.004.611	TWD	913.819.430	19/01/2022	(116.558)	(0,00)
EUR	1.206.575	DKK	8.975.000	25/01/2022	(76)	(0,00)

Minusvalía

Contratos de divisas a p	olazo – (continuació	n)
--------------------------	----------------------	----

					Minusvalia	
Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	latente en EUR	% del patrimonio
EUR	145.103.436	CNH	1.077.218.851	28/01/2022	(2.608.712)	(0,14)
CLP	4.408.751.517	USD	5.462.809	07/02/2022	(196.776)	(0,02)
IDR	79.905.212.378	USD	5.550.515	10/02/2022	(7.333)	(0,00)
RUB	563.798.390	USD	7.801.527	10/02/2022	(271.486)	(0,02)
EUR	171.240.495	JPY	22.041.939.517	16/02/2022	(581.280)	(0,03)
EUR	27.595.880	JPY	3.577.811.368	25/03/2022	(282.370)	(0,02)
EUR	51.479.505	JPY	6.675.040.556	11/04/2022	(522.841)	(0,03)
TRY	54.868.022	USD	5.234.000	14/06/2022	(1.280.079)	(0,07)
MINUSVALÍA LAT	ENTE SOBRE CONTRATOS D	E DIVISAS A PLA	70		(29.702.364)	(1.59)

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones - (0,36 %)

MINUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en EUR	% del patrimonio
EUR	1.832.758	SEK	18.508.971	20/01/2022	28.650	0,00
EUR	139.544	GBP	118.540	21/01/2022	501	0,00
PLUSVALÍA LATEN	TE SOBRE CONTRATOS DE	DIVISAS A	PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA		29.151	0,00
Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente en EUR	% del patrimonio
<b>Divisa</b> SEK	Compra 1.167.370.410	<b>Divisa</b> EUR	<b>Venta</b> 116.978.026		latente en	
	·			de vencimiento	latente en EUR	patrimonio
SEK	1.167.370.410	EUR	116.978.026	de vencimiento 20/01/2022	latente en EUR (3.192.001)	patrimonio (0,17)

Opciones - (0,34 %)

enencias	Descripción del valor			Plusvalía/ (minusvalía) latente EUR	Valor de mercado en EUR	% de patrimonio
	Opciones adquiridas EUR					
9.317.000	Put EUR / Call PLN	Vence 02/12/2021	Precio de ejercicio 4,56	(20.991)	9	0,00
9.317.000	Put EUR / Call PLN	Vence 02/12/2021	Precio de ejercicio 4,56	(24.373)	9	0,0
76.926.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,12	(118.774)	97.542	0,0
84.335.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,12	(231.500)	76.323	0,0
76.724.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	(38.140)	244.366	0,0
76.802.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,14	124.189	382.321	0,0
				(309.589)	800.570	0,0
	GBP					
79.780.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,28	(105.964)	22.565	0,0
104.260.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,30	(139.806)	31.313	0,0
96.560.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,42	(133.427)	44.895	0,0
88.210.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,46	(118.305)	46.398	0,0
112.580.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 11/10/2022	Precio de ejercicio 0,92	(29.043)	236.365	0,0
88.780.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 13/10/2022	Precio de ejercicio 0,93	(25.247)	191.222	0,0
99.460.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 15/11/2022	Precio de ejercicio 0,52	(131.052)	66.644	0,0
90.530.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,54	(114.844)	66.283	0,0
				(797.688)	705.685	0,0
	JPY					
1.743.410.000	Put Swaption del LIBOR a 6 meses	Vence 26/05/2022	Precio de ejercicio 0,43	(145.864)	102.757	0,0
	USD					
82.760.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 0,63	(177.520)	15.790	0,0
85.370.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 07/01/2022	Precio de ejercicio 0,61	(186.302)	23.266	0,0
87.720.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/02/2022	Precio de ejercicio 0,47	(80.631)	15.018	0,0
82.760.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/03/2022	Precio de ejercicio 0,86	(165.757)	155.344	0,0
51.020.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 21/06/2022	Precio de ejercicio 1,05	(162.699)	219.491	0,0
54.000.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 14/11/2022	Precio de ejercicio 0,70	(352.701)	109.799	0,0
21.807.000	Call USD / Put ILS	Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 3,11	324.262	394.801	0,0
21.747.000	Call USD / Put ILS	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 3,13	196.796	272.351	0,0
21.816.000	Call USD / Put ILS	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 3,14	184.030	261.366	0,0
43.193.000	Call USD / Put INR	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 75,26	77.530	183.537	0,0

(0,36)

(6.819.049)

				Plusvalía/	Valor de	
enencias	Descripción del valor			(minusvalía) latente EUR		% de patrimoni
	Opciones adquiridas – (continuación)					
16.623.000	USD – (continuación) Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 15,90	42.432	165.229	0,0
32.724.000	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 16,15	(69.183)	139.829	0,0
			•	(369.743)	1.955.821	0,1
	NES ADQUIRIDAS			<u> </u>	3.564.833	0,1
oste EUR 5.187.	Opciones suscritas				3.304.033	0, 1
	EUR					
(16.000.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 0,20	(51.690)	(157.129)	(0,01
(16.000.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 0,19	(59.288)	(160.168)	(0,0
(16.000.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 0,23	(114.941)	(222.141)	(0,01
(16.000.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 06/01/2022	Precio de ejercicio 0,18	(45.352)	(166.352)	(0,01
(12.330.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(35.103)	(198.270)	(0,01
(12.340.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(50.186)	(198.431)	(0,01
(15.260.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(34.693)	(245.385)	(0,01
(11.460.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(16.200)	(184.280)	(0,01
(11.460.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	226	(184.280)	(0,01
(11.450.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(16.186)	(184.119)	(0,0
(11.450.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(16.186)	(184.119)	(0,01
(12.340.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	(65.135)	(241.515)	(0,01
(10.180.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	(52.173)	(199.240)	(0,01
(16.000.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 0,20	71.526	(33.914)	(0,00
(16.000.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 0,19	37.563	(63.317)	(0,00
(16.000.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 0,23	48.819	(58.381)	(0,00
(16.000.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 06/01/2022	Precio de ejercicio 0,18	21.680	(99.320)	(0,0
(30.710.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 26/05/2022	Precio de ejercicio 0,11	(10.245)	(266.980)	(0,01
(12.330.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	34.141	(105.435)	(0,01
(12.340.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	42.395	(105.520)	(0,01
(15.260.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	28.640	(130.490)	(0,01
(11.460.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(5.552)	(97.996)	(0,01
(11.460.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(5.170)	(97.996)	(0,01
(11.450.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(6.310)	(97.910)	(0,00
(11.450.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(6.310)	(97.910)	(0,00
(12.340.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	77.752	(90.402)	(0,00
(10.180.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	72.489	(74.578)	(0,00
(38.463.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	88.619	(122.505)	(0,01
(38.553.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	201.440	(122.791)	(0,01
(38.362.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,14	7.406	(190.966)	(0,01
	GBP			141.976	(4.381.840)	(0,23
(8.240.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,36	30.829	(97.805)	(0,01
(10.750.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,40	30.710	(140.266)	(0,01
(9.960.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,38	42.249	(136.195)	(0,01
(9.020.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,42	27.546	(137.086)	(0,01
(11.840.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 11/10/2022	Precio de ejercicio 1,04	(319.033)	(584.490)	(0,03
(9.330.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 13/10/2022	Precio de ejercicio 0,99	(208.656)	(424.969)	(0,02
(10.280.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 15/11/2022	Precio de ejercicio 0,55	(27.545)	(225.331)	(0,01
(9.350.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,60	(44.276)	(225.343)	(0,01
	USD			(468.176)	(1.971.485)	(0,11
(17.990.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 06/12/2021	Precio de ejercicio 1,58	(27.853)	(145.711)	(0,01
(17.990.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,64	(100.376)	(236.217)	(0,01
(17.990.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 1,67	(158.473)	(295.130)	(0,02
(26.880.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 1,30	146.154	(47.164)	(0,02
(17.990.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 1,60	(71.887)	(220.452)	(0,00
(27.700.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 07/01/2022	Precio de ejercicio 1,12	184.847	(24.505)	(0,00
(27.700.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/02/2022	Precio de ejercicio 1,12 Precio de ejercicio 0,85	76.434	(19.215)	(0,00
(26.880.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/03/2022	Precio de ejercicio 1,41	55.148	(265.967)	(0,02
(26.880.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 21/06/2022	Precio de ejercicio 1,41  Precio de ejercicio 1,38	54.425	(327.736)	(0,02
(10.500.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 14/11/2022	Precio de ejercicio 1,06	246.437	(215.076)	(0,02
			•			
(10.903.000)	Call USD / Put ILS	Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 3,06	(236.956)	(316.257)	(0,0)
(10.874.000)	Call USD / Put ILS	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 3,08	(173.444)	(259.166)	(0,0
(10.908.000)	Call USD / Put ILS	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 3,09	(166.326)	(256.746)	(0,0
(21.597.000)	Call USD / Put INR	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 74,72	(67.607)	(167.294)	(0,0
/m						(0,0
(5.423.000) (16.362.000)	Call USD / Put TRY Call USD / Put ZAR	Vence 17/12/2021 Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 12,30 Precio de ejercicio 15,90	(340.475) 20.582	(394.230) (162.635)	(0,02

Opciones – (cont	tinuación)					
				Plusvalía/	Valor de	0/ 1.1
Tenencias	Descripción del valor			(minusvalía) latente EUR		% del patrimonio
	Opciones suscritas – (continuación)					_
(17 000 000)	USD – (continuación)	Vence 06/12/2021	Precio de ejercicio 1 59	93.151	(24 707)	(0.00)
(17.990.000) (17.990.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,58 Precio de ejercicio 1,64	101.303	(24.707) (34.538)	(0,00)
(17.990.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 1,67	85.724	(50.934)	(0,00)
(17.990.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 1,60	53.083	(95.483)	(0,01)
				(226.109)	(3.559.163)	(0,19)
TOTAL DE OPCION (coste EUR (9.360.					(9.912.488)	(0,53)
TOTAL DE OPCION (coste EUR (4.172.4					(6.347.655)	(0,34)
Contratos de per	mutas financieras – (0,51 %)					
					Plusvalía	0/ 1.1
Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	latente en EUR	% del patrimonio
	Permutas de tipos de interés					
46.900.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 2,000 %	AUD	17/03/2032	196.269	0,01
57.750.000	Fijo 5,800 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2023	390.329	0,02
22.120.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,400 %	BRL	02/01/2023	28.919	0,00
48.460.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,300 %	BRL	02/01/2024	74.708	0,00
46.376.860	Fijo 6,320 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2025		0,04
38.400.000 40.970.000	Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Fijo 1,000 %	Fijo 11,230 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	BRL CAD	04/01/2027 15/12/2023	49.160 227.245	0,00 0,01
47.750.000	Fijo 1,680 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)		22/08/2028	569.976	0,03
39.780.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,500 %	CAD	14/10/2031	267.585	0,01
53.400.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,250 %	CAD	15/12/2051	863.546	0,05
5.050.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,180 %	CAD	22/08/2052	2.658	0,00
13.560.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,000 %	CHF	16/03/2027	51.802	0,00
59.410.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,000 %	CHF	16/03/2032	549.146	0,03
14.950.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,500 %	CHF	17/03/2032	95.429	0,01
55.300.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,500 %	CNY	15/09/2023		0,00
23.290.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,500 %	CNY	15/12/2026	25.108	0,00
284.150.000	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	03/11/2023	317.634	0,02
8.750.000	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2023	2.099	0,00
23.370.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)		15/12/2024	95.743	0,01 0,00
18.377.287 42.090.000	Fijo 0,000 % Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,200 %	EUR EUR	15/12/2026 03/11/2027	38.618 70.483	0,00
23.740.000	Fijo 0,000 %	Variable (EURIBOR a 6 meses	Lor	00/11/2027	70.400	0,00
	, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,	en EUR)	EUR	15/12/2028	194.581	0,01
3.570.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2030	48.459	0,00
11.950.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,500 %	EUR	26/11/2031	85.269	0,01
27.720.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2031	92.522	0,01
27.720.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,500 %	EUR	17/03/2032		0,01
5.080.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,720 %	EUR	02/12/2036		0,00
5.530.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,257 %	EUR	02/12/2046		0,00
7.690.000 1.020.000	Fijo 0,750 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2028	172.518 27.956	0,01
	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	Fijo 0,750 % Variable (LIBOR a 3 meses en KRW)	GBP KRW	15/12/2051		0,00 0,01
41.119.640.000 20.770.000	Fijo 1,500 % Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,565 %	MYR	16/03/2024 14/03/2024	99.381 105.477	0,01
5.400.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 3,250 %	MYR	15/12/2031	13.934	0,00
25.200.000	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 3,000 %	NZD	16/09/2031	29.769	0,00
1.525.000	Fijo 1,700 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)		15/12/2026		0,00
41.590.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,000 %	SEK	15/12/2023	8.409	0,00
727.840.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,500 %	SEK	16/03/2024	137.879	0,01
412.450.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,750 %	SEK	15/12/2031	189.042	0,01
99.320.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 1,000 %	SEK	17/03/2032	6.700	0,00
118.900.000	Fijo 0,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)		15/12/2023	236.644	0,01
131.660.000	Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)		25/07/2024	3.821	0,00
40.310.000	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	Fijo 1,530 %	USD	22/09/2031	58.284	0,00
70.920.000	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	Fijo 1,750 %	USD	15/12/2031	324.889	0,02
50.425.000	Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	Fijo 7,400 %	ZAR	15/12/2031	51.359	0,00
PLUSVALIA LATE	ENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE	,			6.696.456	0,36
2.020.000	Permutas de incumplimiento crediticio (C Variable (Bonos internacionales	CDS) Fijo 1,000 %	USD	20/06/2024	28.857	0,00
	del Estado de Indonesia)	•				
1.470.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Catar)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2024	10.385	0,00

Contratos de	permutas financieras – (	(continuación)	

Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en EUR	% del patrimonio
1.920.000	Permutas de incumplimiento crediticio Variable (Bonos internacionales del Estado saudí)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2024	25.935	0,00
2.340.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Indonesia)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	9.235	0,00
240.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Catar)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	1.861	0,00
1.000.000	Variable (Bonos internacionales del Estado saudí)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	10.578	0,00
24.150.000	Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 34 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2025	200.758	0,01
4.800.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 11 Index)	Fijo 3,000 %	USD	18/11/2054	639.685	0,04
4.500.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 11 Index)	Fijo 3,000 %	USD	18/11/2054	349.704	0,02
2.500.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/10/2057	254.732	0,01
450.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/10/2057	15.351	0,00
1.250.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/10/2057	10.711	0,00
2.700.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/10/2057	13.114	0,00
2.400.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 10 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/11/2059	245.066	0,01
3.600.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 10 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/11/2059	159.961	0,01
PLUSVALÍA LATE	NTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMIEN	ITO CREDITICIO (CDS)			1.975.933	0,10
	Permutas de inflación					
8.900.000	Fijo 2,250 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/10/2023	4.159	0,00
12.140.000	Fijo 3,250 %	Variable (LIBOR a 12 meses en USD)	USD	07/10/2022	123.701	0,01
PLUSVALÍA LATE	NTE SOBRE PERMUTAS DE INFLACIÓN				127.860	0,01
TOTAL DE PLUSV	ALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE PE	RMUTAS FINANCIERAS			8.800.249	0,47
					Minusvalía	
Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	latente en EUR	% del patrimonio
	Permutas de tipos de interés					
407.810.000	Variable (BBSW a 3 meses en AUD)	Fijo 0,190 %	AUD AUD	22/02/2023	(595.153)	(0,03)
46.390.000 387.970.000	Variable (BBSW a 3 meses en AUD) Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 0,250 % Fijo 1,250 %	AUD	15/12/2023 15/12/2026	(142.916) (4.488.151)	(0,01) (0,24)
58.430.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 2,000 %	AUD	15/12/2020	(649.430)	(0,04)
24.890.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 10,565 %	BRL	02/01/2023	(32.022)	(0,00)
64.920.000	Variable (LIBOR a 1 mes en BRL)	Fijo 7,200 %	BRL	02/01/2023	(386.219)	(0,02)
4.850.000	Fijo 11,814 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(3.195)	(0,00)
4.925.000	Fijo 11,905 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(3.646)	(0,00)
6.575.000	Fijo 12,185 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(9.592)	(0,00)
24.795.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 4,930 %	BRL	02/01/2024	(347.159)	(0,02)
47.521.831	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 9,200 %	BRL	02/01/2024	(97.815)	(0,01)
67.290.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 1,560 %	CAD	22/08/2025	(512.485)	(0,03)
79.320.000	Fijo 1,750 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2026	(137.093)	(0,01)
60.470.000						(0,04)
14.898.265	Fijo 2,000 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2031	(642.997)	(0,04)
55.850.000	Fijo 2,000 % Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	Variable (CDOR a 3 meses en CAD) Fijo 0,000 %		15/12/2031 15/12/2023	(642.997) (2.624)	
00.000.000		,	CAD		, ,	
66.250.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	CAD EUR	15/12/2023	(2.624)	(0,00) (0,02)
	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 %	Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	CAD EUR EUR	15/12/2023 15/12/2026	(2.624) (280.138)	(0,00) (0,02) (0,02)
66.250.000 6.090.000 10.600.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,750 % Fijo 0,531 %	Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	CAD EUR EUR EUR EUR EUR	15/12/2023 15/12/2026 03/11/2027 26/11/2041 02/12/2041	(2.624) (280.138) (370.174) (84.201) (40.923)	(0,00) (0,02) (0,02) (0,01) (0,00)
66.250.000 6.090.000 10.600.000 1.480.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,750 %	Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	CAD EUR EUR EUR EUR EUR EUR	15/12/2023 15/12/2026 03/11/2027 26/11/2041	(2.624) (280.138) (370.174) (84.201)	(0,00) (0,02) (0,02) (0,01) (0,00) (0,00)
66.250.000 6.090.000 10.600.000 1.480.000 11.040.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,750 % Fijo 0,531 % Fijo 0,500 % Fijo 0,500 %	Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	CAD EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR	15/12/2023 15/12/2026 03/11/2027 26/11/2041 02/12/2041 15/12/2041	(2.624) (280.138) (370.174) (84.201) (40.923) (4.992) (196.829)	(0,00) (0,02) (0,02) (0,01) (0,00) (0,00) (0,01)
66.250.000 6.090.000 10.600.000 1.480.000 11.040.000 147.030.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,750 % Fijo 0,531 % Fijo 0,500 % Fijo 0,250 % Fijo 0,250 %	Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	CAD EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR GBP	15/12/2023 15/12/2026 03/11/2027 26/11/2041 02/12/2041 15/12/2041 15/12/2051 15/12/2026	(2.624) (280.138) (370.174) (84.201) (40.923) (4.992) (196.829) (655.839)	(0,00) (0,02) (0,02) (0,01) (0,00) (0,00) (0,01) (0,04)
66.250.000 6.090.000 10.600.000 1.480.000 11.040.000 147.030.000 4.870.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,750 % Fijo 0,531 % Fijo 0,500 % Fijo 0,250 % Fijo 0,250 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)	Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 %	CAD EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR GBP GBP	15/12/2023 15/12/2026 03/11/2027 26/11/2041 02/12/2041 15/12/2041 15/12/2051 15/12/2026	(2.624) (280.138) (370.174) (84.201) (40.923) (4.992) (196.829) (655.839) (436.141)	(0,00) (0,02) (0,02) (0,01) (0,00) (0,00) (0,01) (0,04) (0,02)
66.250.000 6.090.000 10.600.000 1.480.000 11.040.000 147.030.000 4.870.000 68.250.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,750 % Fijo 0,531 % Fijo 0,500 % Fijo 0,250 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 %	Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	CAD EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR GBP GBP	15/12/2023 15/12/2026 03/11/2027 26/11/2041 02/12/2041 15/12/2051 15/12/2026 15/12/2028 15/12/2031	(2.624) (280.138) (370.174) (84.201) (40.923) (4.992) (196.829) (655.839) (436.141) (330.749)	(0,00) (0,02) (0,02) (0,01) (0,00) (0,00) (0,01) (0,04) (0,02) (0,02)
66.250.000 6.090.000 10.600.000 1.480.000 11.040.000 147.030.000 4.870.000 68.250.000 65.490.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 % Fijo 0,750 % Fijo 0,531 % Fijo 0,500 % Fijo 0,250 % Fijo 0,500 % Fijo 1,000 %	Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	CAD EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR GBP GBP GBP GBP	15/12/2023 15/12/2026 03/11/2027 26/11/2041 02/12/2041 15/12/2051 15/12/205 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032	(2.624) (280.138) (370.174) (84.201) (40.923) (4.992) (196.829) (655.839) (436.141) (330.749) (505.713)	(0,00) (0,02) (0,02) (0,01) (0,00) (0,00) (0,01) (0,04) (0,02) (0,02) (0,03)
66.250.000 6.090.000 10.600.000 11.480.000 11.040.000 147.030.000 4.870.000 68.250.000 4.300.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 % Fijo 0,750 % Fijo 0,531 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,000 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 1,000 %	CAD EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR GBP GBP GBP GBP	15/12/2023 15/12/2026 03/11/2027 26/11/2041 02/12/2041 15/12/2041 15/12/2051 15/12/2026 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032	(2.624) (280.138) (370.174) (84.201) (40.923) (4.992) (196.829) (655.839) (436.141) (330.749) (505.713) (4.382)	(0,00) (0,02) (0,02) (0,01) (0,00) (0,00) (0,01) (0,04) (0,02) (0,02) (0,03) (0,00)
66.250.000 6.090.000 10.600.000 1.480.000 147.030.000 4.870.000 68.250.000 65.490.000 4.300.000 1.520.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 % Fijo 0,050 % Fijo 0,750 % Fijo 0,531 % Fijo 0,500 % Fijo 0,250 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,000 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 1,000 %	Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 1,000 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	CAD EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR GBP GBP GBP GBP GBP GBP	15/12/2023 15/12/2026 03/11/2027 26/11/2041 02/12/2041 15/12/2041 15/12/2026 15/12/2026 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2036	(2.624) (280.138) (370.174) (84.201) (40.923) (4.992) (196.829) (655.839) (436.141) (330.749) (505.713) (4.382) (17.588)	(0,00) (0,02) (0,02) (0,01) (0,00) (0,00) (0,01) (0,04) (0,02) (0,02) (0,03) (0,00) (0,00)
66.250.000 6.090.000 10.600.000 1.480.000 11.040.000 147.030.000 4.870.000 68.250.000 65.490.000 4.300.000 1.520.000 20.714.970.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,750 % Fijo 0,531 % Fijo 0,550 % Fijo 0,250 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,000 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 0,000 %	Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 1,000 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	CAD EUR EUR EUR EUR EUR EUR GBP GBP GBP GBP GBP GBP GBP GBP	15/12/2023 15/12/2026 03/11/2027 26/11/2041 15/12/2041 15/12/2051 15/12/2026 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2036 15/12/2036	(2.624) (280.138) (370.174) (84.201) (40.923) (4.992) (196.829) (655.839) (436.141) (330.749) (505.713) (4.382) (17.588) (15.484)	(0,00) (0,02) (0,02) (0,01) (0,00) (0,00) (0,01) (0,02) (0,02) (0,03) (0,00) (0,00) (0,00)
66.250.000 6.090.000 10.600.000 1.480.000 11.040.000 4.870.000 68.250.000 65.490.000 4.300.000 1.520.000 20.714.970.000 6.119.400.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,750 % Fijo 0,531 % Fijo 0,500 % Fijo 0,250 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,000 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,000 %	Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 1,000 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (LIBOR a 12 meses en JPY) Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)	CAD EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR GBP GBP GBP GBP GBP GBP JPY JPY	15/12/2023 15/12/2026 03/11/2027 26/11/2041 15/12/2041 15/12/2051 15/12/2026 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2036 15/12/2041 15/12/2041	(2.624) (280.138) (370.174) (84.201) (40.923) (4.992) (655.839) (436.141) (330.749) (505.713) (4.382) (17.588) (15.484) (71.940)	(0,00) (0,02) (0,02) (0,01) (0,00) (0,00) (0,01) (0,02) (0,02) (0,03) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
66.250.000 6.090.000 10.600.000 1.480.000 11.040.000 4.870.000 68.250.000 65.490.000 4.300.000 1.520.000 20.714.970.000 6.119.400.000 4.278.000.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 % Fijo 0,750 % Fijo 0,531 % Fijo 0,550 % Fijo 0,500 % Fijo 0,500 % Fijo 0,500 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 1,000 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,000 % Fijo 1,750 %	Fijo 0,000 %  Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)  Variable (EURIBOR a 12 meses en EUR)  Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)  Variable (EURIBOR a 1 mes en GBP)  Fijo 4,060 %  Variable (SONIA a 1 mes en GBP)  Variable (SONIA a 1 mes en GBP)  Fijo 1,000 %  Variable (SONIA a 1 mes en GBP)  Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)  Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)  Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)  Variable (KWCDC a 3 meses en KRW)	CAD EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR GBP GBP GBP GBP GBP GBP GBP GBP KRW	15/12/2023 15/12/2026 03/11/2027 26/11/2041 02/12/2041 15/12/2041 15/12/2051 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2036 15/12/2041 15/12/2041 15/12/2041	(2.624) (280.138) (370.174) (84.201) (40.923) (4.992) (196.829) (655.839) (436.141) (330.749) (505.713) (4.382) (17.588) (15.484) (71.940) (79.449)	(0,00) (0,02) (0,02) (0,01) (0,00) (0,00) (0,01) (0,02) (0,02) (0,03) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)
66.250.000 6.090.000 10.600.000 1.480.000 11.040.000 4.870.000 68.250.000 65.490.000 4.300.000 1.520.000 20.714.970.000 6.119.400.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR) Fijo 0,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,750 % Fijo 0,531 % Fijo 0,500 % Fijo 0,250 % Fijo 0,500 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP) Fijo 0,750 % Fijo 1,000 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 0,000 % Fijo 0,000 %	Fijo 0,000 % Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 4,060 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Fijo 1,000 % Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (LIBOR a 12 meses en JPY) Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)	CAD EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR EUR GBP GBP GBP GBP GBP GBP JPY JPY	15/12/2023 15/12/2026 03/11/2027 26/11/2041 15/12/2041 15/12/2051 15/12/2026 15/12/2028 15/12/2031 17/03/2032 15/12/2036 15/12/2041 15/12/2041	(2.624) (280.138) (370.174) (84.201) (40.923) (4.992) (655.839) (436.141) (330.749) (505.713) (4.382) (17.588) (15.484) (71.940)	(0,00) (0,02) (0,02) (0,01) (0,00) (0,01) (0,04) (0,02) (0,03) (0,00) (0,00) (0,00) (0,00)

#### Contratos de permutas financieras – (continuación)

Importe local neto teórico	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente en EUR	% del patrimonio
	Permutas de tipos de interés – (continuación)				,.	
20.670.000	Variable (KLIBOR a 3 meses en MYR)	Fijo 2,000 %	MYR	16/06/2026	(130.597)	(0,01)
366.490.000	Fijo 2,000 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	16/03/2027	(397.637)	(0,02)
293.850.000	Fijo 2,130 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	11/05/2031	(317.766)	(0,02)
78.370.000	Fijo 2,000 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	16/03/2032	(141.972)	(0,01)
878.490.000	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 0,500 %	NZD	15/09/2022	(1.565.827)	(80,0)
43.720.000	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 1,250 %	NZD	15/12/2022	(49.038)	(0,00)
99.290.000	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 1,750 %	NZD	15/12/2026	(1.088.918)	(0,06)
31.940.000	Fijo 2,000 %	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	NZD	15/12/2031	(70.228)	(0,00)
106.350.000	Fijo 0,250 %	Variable (WIBOR a 3 meses en PLN)	PLN	16/12/2021	(42.901)	(0,00)
1.739.259	Fijo 1,750 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2023	(1.094)	(0,00)
18.600.000	Fijo 2,000 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2031	(15.269)	(0,00)
530.100.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,250 %	SEK	15/12/2026	(57.498)	(0,00)
12.750.000	Variable (LIBOR a 6 meses en THB)	Fijo 1,000 %	THB	16/03/2027	(1.172)	(0,00)
51.160.000	Fijo 0,250 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2024	(159.723)	(0,01)
77.510.000	Fijo 1,000 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2027	(246.492)	(0,01)
22.020.000	Fijo 2,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD	17/09/2031	(81.691)	(0,00)
48.520.000	Fijo 1,630 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	22/09/2036	(79.086)	(0,00)
25.380.000	Fijo 1,750 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2052	(396.334)	(0,02)
445.877.914	Fijo 5,500 %	Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	ZAR	15/12/2023	(73.167)	(0,00)
	ENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE INTE				(16.123.502)	(0,86)
-	Permutas de incumplimiento crediticio					
	(CDS)					
2.050.000	Variable (Unibail-Rodamco-Westfield S.E.)	Fijo 1,000 %	EUR	20/06/2024	(10.318)	(0,00)
340.000	Fijo 1,000 %	Variable (Bonos internacionales del Estado de China)	USD	20/12/2021	(28)	(0,00)
71.675.000	Variable (The Markit CDX North America	,			` ,	, ,
1.330.000	Investment Grade 28 Version 1 Index) Variable (Bonos internacionales del Estado	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2022	(29.835)	(0,00)
	de Chile)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	(7.483)	(0,00)
330.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Perú)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2024	(630)	(0,00)
5.320.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Indonesia)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(28.860)	(0,00)
50.000	Variable (Bonos internacionales del Estado					
	de México)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(487)	(0,00)
3.340.000	Variable (Bonos extranjeros rusos –					
41.820.000	Eurobono)  Variable (The Markit CDX Emerging Markets	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(41.669)	(0,01)
41.020.000	36 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(701.891)	(0,04)
MINUSVALÍA LATE	ENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIMIEN	NTO CREDITICIO (CDS)			(821.201)	(0,05)
	Permutas de inflación					
10.710.000	Fijo 1,920 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/11/2031	(72.606)	(0,00)
18.320.000	Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)	Fijo 4,170 %	GBP	15/11/2028	(1.236.418)	(0,07)
MINUSVALÍA LATE	ENTE SOBRE PERMUTAS DE INFLACIÓN				(1.309.024)	(0,07)
TOTAL DE MINUS\ PERMUTAS FINAN	VALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE ICIERAS				(18.253.727)	(0,98)
VALOR DE MERCA (coste EUR 1.807.9	ADO DE LAS INVERSIONES 990.332)			1	.859.368.159	99,46
OTROS ACTIVOS	Y PASIVOS				10.204.407	0,54
PATRIMONIO				1	.869.572.566	100,00

TOTAL DE INVERSIONES	Valor de mercado en EUR	% del patrimonio
Total inversiones excluyendo derivados (coste EUR 1.822.973.628)	1.876.737.530	100,39
Valor de mercado de títulos con garantía hipotecaria a plazo cubiertos (coste EUR (10.810.833))	(11.049.474)	(0,59)
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	8.094.895	0,43
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(940.207)	(0,05)
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	38.818.810	2,08
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	(29.702.364)	(1,59)
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	29.151	0,00
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	(6.819.049)	(0,36)
Valor de mercado de opciones compradas (coste EUR 5.187.717)	3.564.833	0,19
Valor de mercado de opciones suscritas (coste EUR (9.360.180))	(9.912.488)	(0,53)
Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	8.800.249	0,47
Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	(18.253.727)	(0,98)
Otros activos y pasivos	10.204.407	0,54
Patrimonio	1.869.572.566	100,00

#### El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Credit Suisse International, Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Natwest Markets Plc., Standard Chartered Bank, State Street Bank & Trust, UBS AG y Westpac Banking Corp.

Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc. y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Barclays Bank Plc., Barclays Capital, Inc., Citibank N.A., Credit Suisse, JP Morgan Chase Bank N.A. y Morgan Stanley & Co. International Plc

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 1.20 %

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (d) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (e) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- $^{(f)}\;$  EI rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del (0,627) %.
- (9) Los valores TBA (por confirmar) se compran sobre una vez suscrito un compromiso a plazo con un importe de principal aproximado (por lo general +/-2,5 %) y sin fecha definitiva de vencimiento. El importe real del principal y la fecha de vencimiento se determinarán tras la liquidación cuando se asignen los "pools" de hipotecas específicos.
- (h) Este título tiene un cupón escalonado que pasará al segundo tipo en una fecha determinada del futuro.
- (i) Estos valores representan ventas por confirmar (TBA) cubiertas con posiciones FNMA largas. Estos importes se declaran por separado en el Balance de situación como Valores hipotecarios a plazo cubiertos.
- (i) Estos valores representan ventas por confirmar (TBA) cubiertas con posiciones GNMA largas. Estos importes se declaran por separado en el Balance de situación como Valores hipotecarios a plazo cubiertos.

_					Valor de mercado	% del
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en USD	patrimonio
Valores mob Bonos – 70,1 Israel	iliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial 3 %					
	Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 412	ILS	(0,140 %)	06/04/2022	3.997.975	1,09
13.825.000	Letras del Banco de Israel - Makam – Serie 622	ILS	(0,120 %)	08/06/2022	4.395.387	1,20
					8.393.362	2,29
Japón						
	Depósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1025 Depósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028	JPY JPY	(0,153 %) (0,147 %)		14.847.265 56.852.496	4,06 15,55
0.396.200.000	Deposito con descuento del Tesoro de Japon – Sene Tozo	JFT	(0,147 %)	11/04/2022		-
					71.699.761	19,61
Turquía 1.640.000	Bonos del Estado de Turquía	TRY	12,200 %	18/01/2023	115.885	0,03
Estados Unid	<u> </u>		,			-,,,,
	Letras de gestión de Tesorería de Estados Unidos	USD	0,060 %	22/03/2022	9.997.842	2,73
21.200.000	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,039 %	03/02/2022	21.198.539	5,80
5.000.000	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,490 %	03/03/2022	4.999.393	1,37
	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,048 %	17/03/2022	4.999.227	1,37
	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,055 %		19.996.233	5,47
	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,062 %		17.496.646	4,79
	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,064 %	07/04/2022	9.997.883	2,73
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	1,250 %		29.136.702	7,97
53.020.000	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	2,875 %		58.388.275	15,97
					176.210.740	48,20
TOTAL DE BO					256.419.748	70,13
					Valor de	
Tononcias	Descripción del valor				mercado	
Tenencias	Descripción del valor				mercado en USD	
Fondos de ir	Descripción del valor nversión – 9,19 %					
Fondos de ir Irlanda	nversión – 9,19 %		n.		en USD	patrimonio
Fondos de ir Irlanda 1.554	nversión – 9,19 %  Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de	•				patrimonio
Fondos de ir Irlanda 1.554	nversión – 9,19 %	•			en USD	patrimonic
Fondos de ir Irlanda 1.554	nversión – 9,19 %  Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de	•		-	en USD 16.397.218	4,49 4,70
Fondos de ir Irlanda 1.554 17.190.678	nversión – 9,19 %  Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de accion	•		-	en USD 16.397.218 17.190.678	% del patrimonio 4,49 4,70 9,19 9,19
Fondos de ir Irlanda 1.554 17.190.678 TOTAL DE FO (coste USD 33	NDOS DE INVERSIÓN  B. GOIdman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones NDOS DE INVERSIÓN 8.590.133)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE COTIZACIÓN EN UNA	es de distribución X)	(c)(e)	-	en USD 16.397.218 17.190.678 33.587.896	4,49 4,70 9,19
Fondos de ir Irlanda 1.554 17.190.678 TOTAL DE FO (coste USD 33	NDOS DE INVERSIÓN  B. GOIdman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones NDOS DE INVERSIÓN 8.590.133)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE COTIZACIÓN EN UNA	es de distribución X)	(c)(e)	_	en USD  16.397.218 17.190.678 33.587.896 33.587.896 290.007.644 Valor de	9,19 79,32
Fondos de ir Irlanda 1.554 17.190.678 TOTAL DE FO (coste USD 33	NDOS DE INVERSIÓN  B. GOIdman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones NDOS DE INVERSIÓN 8.590.133)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE COTIZACIÓN EN UNA	es de distribución X)	(c)(e)	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en USD  16.397.218 17.190.678 33.587.896 33.587.896 290.007.644	9,15 9,15 9,32
Fondos de ir Irlanda 1.554 17.190.678 TOTAL DE FO (coste USD 33 TOTAL DE VA (coste USD 28	NOOS DE INVERSIÓN  B. GOIdman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de accion NDOS DE INVERSIÓN  B. 590.133)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE G. 986.120)	es de distribución X)  DE VALORES OFICI	AL		en USD  16.397.218 17.190.678 33.587.896  33.587.896  290.007.644  Valor de mercado en	9,15 9,15 9,32
Fondos de ir Irlanda 1.554 17.190.678 TOTAL DE FO (coste USD 33 TOTAL DE VA (coste USD 28 Tenencias	NOOS DE INVERSIÓN 3.590.133)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA E 36.986.120)	es de distribución X)  DE VALORES OFICI  Divisa	AL		en USD  16.397.218 17.190.678 33.587.896  33.587.896  290.007.644  Valor de mercado en	9,15 9,15 9,32
Fondos de ir Irlanda 1.554 17.190.678 TOTAL DE FO (coste USD 33 TOTAL DE VA (coste USD 28 Tenencias Valores mob Obligaciones Estados Unid	NORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA E 18.986.120)  Descripción del valor illiarios negociados en otro mercado regulado so on garantía de activos emitidos o garantizados por agencias os	es de distribución X)  DE VALORES OFICI  Divisa	AL		en USD  16.397.218 17.190.678 33.587.896  33.587.896  290.007.644  Valor de mercado en	9,15 9,15 9,32
Fondos de ir Irlanda 1.554 17.190.678 TOTAL DE FO (coste USD 33 TOTAL DE VA (coste USD 28 Tenencias Valores mob Obligaciones Estados Unid	Roldman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones NDOS DE INVERSIÓN 3.590.133)  LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA E 36.986.120)  Descripción del valor illiarios negociados en otro mercado regulado s con garantía de activos emitidos o garantizados por agencias	es de distribución X)  DE VALORES OFICI  Divisa	AL		en USD  16.397.218 17.190.678 33.587.896  33.587.896  290.007.644  Valor de mercado en	9,18 9,19 79,32 % de patrimonio
Fondos de ir Irlanda 1.554 17.190.678 TOTAL DE FO (coste USD 33 TOTAL DE VA (coste USD 28 Tenencias Valores mob Obligaciones Estados Unid 1.356.231	NORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA E 18.986.120)  Descripción del valor illiarios negociados en otro mercado regulado so on garantía de activos emitidos o garantizados por agencias os	DE VALORES OFICI Divisa	AL  Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en USD  16.397.218 17.190.678 33.587.896  33.587.896  290.007.644  Valor de mercado en USD	4,49 4,70 9,19
Fondos de ir Irlanda 1.554 17.190.676 TOTAL DE FO (coste USD 33 TOTAL DE VA (coste USD 28 Tenencias Valores mob Obligaciones Estados Unid 1.356.231 4.160.393	RODOS DE INVERSIÓN  DESCRIPCIÓN DE SOCIAL DE S	DE VALORES OFICE  Divisa 5 - 17,40 %  USD	AL  Tipo de interés <sup>(a)</sup> 5,911 %	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	en USD  16.397.218 17.190.678 33.587.896  33.587.896  290.007.644  Valor de mercado en USD	9,15 9,15 79,32 % de patrimonio
Fondos de ir Irlanda 1.554 17.190.678 TOTAL DE FO (coste USD 33 TOTAL DE VA (coste USD 28 Tenencias Valores mob Obligaciones Estados Unid 1.356.231 4.160.393 8.006.518 6.279.098	Roldman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Ac	DE VALORES OFICI  Divisa  5 - 17,40 %  USD USD USD USD	(c)(e)  AL  Tipo de interés <sup>(a)</sup> 5,911 % 5,861 % 6,361 % 5,831 %	15/05/2041 15/10/2041 15/10/2041 15/03/2042 15/04/2042	en USD  16.397.218 17.190.678 33.587.896  33.587.896  290.007.644  Valor de mercado en USD  205.933 564.668 1.327.181 953.649	9,15  9,15  79,32  % de patrimonio  0,06 0,15 0,33 0,26
Fondos de ir Irlanda 1.554 17.190.678 TOTAL DE FO (coste USD 33 TOTAL DE VA (coste USD 26 Tenencias Valores mob Obligaciones Estados Unid 1.356.231 4.160.393 8.006.515 6.279.099 3.940.130	Roldman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Roldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Roldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Roldman Sachs US\$ ACOTIZACIÓN EN UNA BOLSA E 18.986.120)  Descripción del valor  Illiarios negociados en otro mercado regulado se con garantía de activos emitidos o garantizados por agencias de Roldman Sachs US\$ Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(f) 6 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(f) 7 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(f) 8 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(f) 9 Federal Home Loa	DE VALORES OFICE  Divisa  5 - 17,40 %  USD USD USD USD USD USD	(c)(e)  AL  Tipo de interés <sup>(a)</sup> 5,911 % 5,861 % 6,361 %	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup> 15/05/2041 15/10/2041 15/03/2042	16.397.218 17.190.678 33.587.896 33.587.896 290.007.644 Valor de mercado en USD 205.933 564.668 1.327.181	9,15 9,15 79,32 % de patrimonic 0,06 0,15 0,36 0,26 0,18
Fondos de ir Irlanda 1.554 17.190.676 TOTAL DE FO (coste USD 33 TOTAL DE VA (coste USD 26 Tenencias Valores mob Obligaciones Estados Unid 1.356.231 4.160.393 8.006.515 6.279.099 3.940.130 286.795	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ ACOTIZACIÓN EN UNA BOLSA E GOLDMAN G	DE VALORES OFICE  Divisa  S - 17,40 %  USD USD USD USD USD USD USD	(c)(e)  AL  Tipo de interés <sup>(a)</sup> 5,911 % 5,861 % 6,361 % 5,831 % 6,461 % 5,911 %	15/05/2041 15/10/2041 15/10/2041 15/03/2042 15/04/2042 15/06/2042	16.397.218 17.190.678 33.587.896 290.007.644 Valor de mercado en USD 205.933 564.668 1.327.181 953.649 641.486 49.159	9,15 9,15 9,15 79,32 % de patrimonio
TOTAL DE FO (coste USD 33 TOTAL DE VA (coste USD 28 TOTAL DE VA (coste USD 28 Tenencias Valores mob Obligaciones Estados Unid 1.356.231 4.160.393 8.006.515 6.279.099 3.940.130 286.795 5.268.447	ROBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA E BOSCO GRACIA COM	Divisa  Divisa  S - 17,40 %  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	(c)(e)  AL  Tipo de interés <sup>(a)</sup> 5,911 % 5,861 % 6,361 % 5,831 % 6,461 % 5,911 % 6,011 %	15/05/2041 15/10/2041 15/10/2041 15/03/2042 15/04/2042 15/06/2044 15/12/2044	en USD  16.397.218 17.190.678 33.587.896  290.007.644  Valor de mercado en USD  205.933 564.668 1.327.181 953.649 641.486 49.159 921.555	9,15 9,15 79,32 % de patrimonio 0,06 0,16 0,36 0,26 0,11 0,07 0,12
TOTAL DE FO (coste USD 28  TOTAL DE SO (coste USD 28  TOTAL DE SO (coste USD 28  TOTAL DE VA (coste USD 28  Tenencias  Valores mob Obligaciones Estados Unid 1.356.231 4.160.393 8.006.518 6.279.098 3.940.130 286.795 5.268.447 495.778	Roldman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de acciones de acciones de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de accion	Divisa  Divisa  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	(c)(e)  AL  Tipo de interés <sup>(a)</sup> 5,911 % 5,861 % 6,361 % 5,831 % 6,461 % 5,911 % 6,011 % 6,011 %	15/05/2041 15/10/2041 15/10/2041 15/03/2042 15/04/2042 15/06/2044 15/12/2044 15/15/2044	en USD  16.397.218 17.190.678 33.587.896  33.587.896  290.007.644  Valor de mercado en USD  205.933 564.668 1.327.181 953.649 641.486 49.159 921.555 90.464	9,15  9,15  79,32  % de patrimonio  0,06 0,15 0,36 0,26 0,15 0,00 0,25 0,00 0,25 0,00 0,25 0,00
Fondos de ir Irlanda 1.554 17.190.678 TOTAL DE FO (coste USD 33 TOTAL DE VA (coste USD 28 Tenencias Valores mob Obligaciones Estados Unid 1.356.231 4.160.393 8.006.518 6.279.099 3.940.130 286.795 5.268.447 495.775 4.050.962	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de acciones de acciones de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de accion	Divisa  Divisa  S - 17,40 %  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	(c)(e)  AL  Tipo de interés <sup>(a)</sup> 5,911 % 5,861 % 6,361 % 6,361 % 5,911 % 6,011 % 6,011 % 4,500 %	15/05/2041 15/10/2041 15/10/2042 15/04/2042 15/06/2042 15/05/2044 15/12/2044 15/05/2045 25/06/2050	en USD  16.397.218 17.190.678 33.587.896  33.587.896  290.007.644  Valor de mercado en USD  205.933 564.668 1.327.181 953.649 641.486 49.159 921.555 90.464 588.847	9,15  9,15  79,32  % de patrimonio  0,06 0,15 0,36 0,26 0,16 0,00 0,00 0,10 0,00 0,10 0,00 0,10 0,00 0,10 0,00 0,10 0,00 0,10 0,00 0,10 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00
Fondos de ir Irlanda 1.554 17.190.678 TOTAL DE FO (coste USD 33 TOTAL DE VA (coste USD 26 Tenencias Valores mob Obligaciones Estados Unid 1.356.231 4.160.393 8.006.515 6.279.095 3.940.130 286.795 5.288.447 495.775 4.050.962 1.879.914	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ ACOTIZACIÓN EN UNA BOLSA E 18.986.120)  Descripción del valor  Descripción del valor  Illiarios negociados en otro mercado regulado so con garantía de activos emitidos o garantizados por agencias de Goldman Sachs US\$ Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(f) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	DE VALORES OFICE  Divisa  S - 17,40 %  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	5,911 % 5,861 % 6,361 % 5,911 % 6,461 % 6,011 % 4,500 % 4,000 %	15/05/2041 15/10/2041 15/10/2041 15/03/2042 15/06/2042 15/06/2044 15/12/2044 15/15/2045 25/06/2050 25/07/2050	16.397.218 17.190.678 33.587.896 33.587.896 290.007.644 Valor de mercado en USD  205.933 564.668 1.327.181 953.649 641.486 49.159 921.555 90.464 588.847 291.272	9,15 9,15 79,32 % de patrimonio 0,06 0,15 0,36 0,26 0,16 0,07 0,21 0,03 0,26 0,16 0,07 0,27 0,03
TOTAL DE FO (coste USD 3: TOTAL DE VA (coste USD 2: Total DE VA (coste	ROBINITION OF SECRETAL HOME LOAN Mortgage Corp. (FHLMC)(f) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	DE VALORES OFICE  Divisa  S - 17,40 %  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	(c)(e)  AL  Tipo de interés <sup>(a)</sup> 5,911 % 5,861 % 6,361 % 5,831 % 6,461 % 5,911 % 6,011 % 4,500 % 4,000 % 2,000 %	15/05/2041 15/10/2041 15/10/2042 15/03/2042 15/04/2042 15/06/2044 15/12/2044 15/05/2045 25/06/2050 25/07/2050 25/09/2050	16.397.218 17.190.678 33.587.896 290.007.644 Valor de mercado en USD  205.933 564.668 1.327.181 953.649 641.486 49.159 921.555 90.464 588.847 291.272 712.700	9,15 9,15 79,32 % de patrimonio 0,06 0,16 0,36 0,26 0,118 0,00 0,20 0,10 0,20 0,10 0,20 0,10 0,20 0,10 0,20 0,10 0,20 0,10 0,20 0,2
TOTAL DE FO (coste USD 3:  TOTAL DE VA (coste USD 2:  TOTAL DE VA (coste USD 2:  TOTAL DE VA (coste USD 2:  Tenencias  Valores mob Obligaciones Estados Unid 1.356.231 4.160.393 8.006.515 6.279.095 3.940.130 2.86.795 5.288.447 4.95.775 4.050.962 1.879.914 7.352.716 1.617.487	ROBINITION OF SECOND HOME CONTRACTOR OF SECOND OF SECOND HOME CONTRACTOR OF SECOND OF SE	Divisa Di	5,911 % 5,861 % 6,361 % 5,831 % 6,461 % 5,911 % 6,011 % 4,500 % 4,000 % 2,000 % 4,000 %	15/05/2041 15/10/2041 15/10/2041 15/03/2042 15/04/2042 15/05/2044 15/12/2044 15/05/2045 25/06/2050 25/07/2050 25/09/2050	en USD  16.397.218 17.190.678 33.587.896  290.007.644  Valor de mercado en USD  205.933 564.668 1.327.181 953.649 641.486 49.159 921.555 90.464 588.847 291.272 712.700 248.443	9,15 9,15 79,32 % de patrimonio 0,06 0,16 0,02 0,03 0,02 0,03 0,02 0,03 0,02 0,03 0,02 0,03 0,02 0,03 0,02 0,03 0,02 0,03 0,02 0,03 0,02 0,03
Total DE FO (coste USD 28  Total DE FO (coste USD 28  Total DE VA (coste USD 28  Total DE VA (coste USD 28  Tenencias  Valores mob Obligaciones Estados Unid 1.356.231 4.160.393 8.006.518 6.279.098 3.940.130 286.798 5.268.447 495.779 4.050.962 1.879.914 7.352.710 1.617.487 24.558	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones Descripción del valores de Goldman Sachs US\$ A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA E GOLDMAN	DE VALORES OFICI  Divisa  S - 17,40 %  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	5,911 % 5,861 % 6,361 % 6,461 % 5,911 % 6,011 % 4,500 % 4,000 % 2,000 % 4,000 % 5,000 %	15/05/2041 15/10/2041 15/10/2041 15/03/2042 15/04/2042 15/05/2044 15/12/2044 15/05/2045 25/06/2050 25/07/2050 25/09/2050 01/07/2023	en USD  16.397.218 17.190.678 33.587.896  290.007.644  Valor de mercado en USD  205.933 564.668 1.327.181 953.649 641.486 49.159 921.555 90.464 588.847 291.272 712.700 248.443 26.851	9,15  9,15  9,15  79,32  % de patrimonio  0,06 0,15 0,03 0,05 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,0
Total DE VA (coste USD 28 Tenencias  Valores mob Obligaciones Estados Unid 1.356.231 4.160.393 8.006.518 6.279.096 3.940.130 286.795 4.050.962 1.879.914 7.352.710 1.617.487 24.556 30.382	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de acciones de acciones de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de accion	Divisa  Divisa  S - 17,40 %  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	5,911 % 5,861 % 6,361 % 6,461 % 6,011 % 6,011 % 4,500 % 4,000 % 2,000 % 4,000 % 5,000 % 5,000 %	15/05/2041 15/10/2041 15/10/2041 15/10/2042 15/04/2042 15/06/2042 15/05/2044 15/12/2044 15/15/2045 25/06/2050 25/09/2050 25/09/2050 01/07/2023 01/04/2027	16.397.218 17.190.678 33.587.896 290.007.644  Valor de mercado en USD  205.933 564.668 1.327.181 953.649 921.555 90.464 588.847 291.272 712.700 248.443 26.851 33.262	0,06 0,15 0,06 0,15 0,06 0,16 0,06 0,16 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07
Total DE FO (coste USD 26  Total DE Va (coste USD 26  Tenencias  Valores mob Obligaciones Estados Unid 1.356.231 4.160.393 8.006.518 6.279.095 3.940.130 286.796 5.268.447 495.773 4.050.966 1.879.914 7.352.710 1.617.487 24.555 30.382 2.118.798	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ ACCITEACIÓN EN UNA BOLSA E 16.986.120)  Descripción del valor  Illiarios negociados en otro mercado regulado se con garantía de activos emitidos o garantizados por agencias de Goldman Sachs US\$ Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(f) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal National Mortgage Association (FNMA)	DE VALORES OFICE  Divisa  S - 17,40 %  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	5,911 % 5,861 % 6,361 % 5,911 % 6,011 % 6,011 % 4,500 % 4,000 % 2,000 % 4,000 % 5,000 % 5,000 % 6,678 %	15/05/2041 15/10/2041 15/10/2041 15/03/2042 15/06/2042 15/06/2042 15/05/2044 15/112/2044 15/105/2045 25/06/2050 25/07/2050 25/09/2050 01/07/2023 01/04/2027 25/04/2037	en USD  16.397.218 17.190.678 33.587.896  290.007.644  Valor de mercado en USD  205.933 564.668 1.327.181 953.649 641.486 49.159 921.555 90.464 588.847 291.272 712.700 248.443 26.851 33.262 424.624	9,15 9,15 79,32 % de patrimonio 0,06 0,15 0,36 0,26 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,0
TOTAL DE FO (coste USD 3:  TOTAL DE VA (coste USD 2:  TOTAL DE VA (coste USD 2:  TOTAL DE VA (coste USD 2:  Tenencias  Valores mob Obligaciones  Estados Unid 1.356.231 4.160.393 8.006.515 6.279.095 3.940.130 286.795 5.288.447 495.775 4.050.962 1.879.914 7.352.716 1.617.487 24.556 30.382 2.118.795 4.343.600	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Corp. (FHLMC) (FILMC) (FIL	Divisa  Divisa	5,911 % 5,861 % 6,361 % 5,831 % 6,461 % 5,911 % 6,011 % 4,500 % 4,000 % 2,000 % 5,000 % 5,000 % 6,678 % 4,958 %	15/05/2041 15/10/2041 15/10/2041 15/03/2042 15/04/2042 15/06/2044 15/05/2044 15/05/2045 25/06/2050 25/07/2050 25/09/2050 01/07/2023 01/04/2027 25/04/2037 25/04/2037	en USD  16.397.218 17.190.678 33.587.896  290.007.644  Valor de mercado en USD  205.933 564.668 1.327.181 953.649 641.486 49.159 921.555 90.464 588.847 291.272 712.700 248.443 26.851 33.262 424.624 546.947	9,15 9,15 79,32 % de patrimonio 0,06 0,16 0,36 0,26 0,16 0,06 0,16 0,06 0,17 0,07 0,07 0,07 0,07 0,01 0,01
Toral DE FO (coste USD 28  Toral DE FO (coste USD 28  Toral DE VA (coste USD 28  Toral DE VA (coste USD 28  Tenencias  Valores mob Obligaciones  Estados Unid  1.356.231 4.160.393 8.006.518 6.279.098 3.940.130 286.798 5.268.447 495.779 4.050.962 1.879.914 7.352.711 1.617.487 24.555 30.382 2.118.798 4.343.600 1.316.734	Receive the second seco	DE VALORES OFICI  Divisa  5 - 17,40 %  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	5,911 % 5,861 % 6,361 % 6,461 % 6,011 % 4,500 % 4,000 % 2,000 % 4,000 % 5,000 % 5,000 % 6,678 % 4,958 %	15/05/2041 15/10/2041 15/10/2041 15/03/2042 15/04/2042 15/05/2044 15/05/2044 15/05/2045 25/06/2050 25/07/2050 25/09/2050 01/07/2023 01/04/2027 25/04/2037 25/10/2040 25/10/2040	en USD  16.397.218 17.190.678 33.587.896  290.007.644  Valor de mercado en USD  205.933 564.668 1.327.181 953.649 641.486 49.159 921.555 90.464 588.847 291.272 712.700 248.443 26.851 33.262 424.624 546.947 208.090	9,15 9,15 79,32 % de patrimonio  0,06 0,16 0,06 0,16 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,0
Tondos de ir Irlanda 1.554 17.190.678 TOTAL DE FO (coste USD 33 TOTAL DE VA (coste USD 28 Tenencias Valores mob Obligaciones Estados Unid 1.356.231 4.160.393 8.006.518 6.279.099 3.940.130 286.795 5.268.447 495.775 4.050.962 1.879.914 7.352.710 1.617.487 24.559 30.382 2.118.798 4.343.600 1.316.734 610.593	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Plus Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones Descripción del valores de Goldman Sachs US\$ A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA E GOLDMAN	Divisa  Divisa	5,911 % 5,861 % 5,861 % 6,361 % 6,461 % 5,911 % 6,011 % 6,011 % 4,500 % 4,000 % 2,000 % 4,000 % 5,000 % 5,000 % 6,678 % 4,958 % 6,358 %	15/05/2041 15/10/2041 15/10/2041 15/10/2042 15/06/2042 15/06/2044 15/10/2044 15/10/2044 25/06/2050 25/09/2050 25/09/2050 01/07/2023 01/04/2027 25/04/2037 25/10/2040 25/10/2041	en USD  16.397.218 17.190.678 33.587.896  290.007.644  Valor de mercado en USD  205.933 564.668 1.327.181 953.649 641.486 49.159 921.555 90.464 588.847 291.272 712.700 248.443 26.851 33.262 424.624 546.947 208.090 103.636	9,15 9,15 9,15 79,32 % de patrimonio  0,06 0,15 0,36 0,26 0,01 0,02 0,07 0,01 0,12 0,15 0,06 0,07 0,01 0,12 0,06 0,07 0,01 0,12 0,06 0,07 0,01 0,12 0,15 0,06 0,07 0,01 0,01 0,01 0,01 0,01 0,01 0,01
Total DE FO (coste USD 26  Total DE Va (coste USD 26  Total DE Va (coste USD 26  Tenencias  Valores mob Obligaciones  Estados Unid  1.356.231 4.160.393 8.006.515 6.279.096 3.940.130 286.796 5.288.447 495.775 4.050.962 1.879.914 7.352.710 1.617.487 24.555 30.382 2.118.796 4.343.600 1.316.7346 610.593 961.600	Receive the second seco	DE VALORES OFICI  Divisa  5 - 17,40 %  USD USD USD USD USD USD USD USD USD US	5,911 % 5,861 % 6,361 % 6,461 % 6,011 % 4,500 % 4,000 % 2,000 % 4,000 % 5,000 % 5,000 % 6,678 % 4,958 %	15/05/2041 15/10/2041 15/10/2041 15/03/2042 15/04/2042 15/05/2044 15/05/2044 15/05/2045 25/06/2050 25/07/2050 25/09/2050 01/07/2023 01/04/2027 25/04/2037 25/10/2040 25/10/2040	en USD  16.397.218 17.190.678 33.587.896  290.007.644  Valor de mercado en USD  205.933 564.668 1.327.181 953.649 641.486 49.159 921.555 90.464 588.847 291.272 712.700 248.443 26.851 33.262 424.624 546.947 208.090	9,15 9,15 79,32 % de patrimonio  0,06 0,16 0,06 0,16 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,07 0,0

Description del valor   Diblgaciones							Valor de	
	Tenencias	Descripción del valor		Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	mercado en USD	% del patrimonio
2.94.3.35   Federin National Mortgage Association (FINMA)**   4.891.048   Federin National Mortgage Association (FINMA)**   9.999.800   Federin National Mortgage Association (FINMA)**   1.900   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.000   5.	Obligaciones	con garantía de activos emitidos o gar	antizados por agencias – (conti	nuación)				
4.901.048   Federian Macroal Mortgage Association (FMMAP)	Estados Unid	os – (continuación)						
9.998.80   Foderal National Mortgage Association (FMMA)***  USD   6.098 %   251/02/02/14   308, 147   1.498.908   Foderal National Mortgage Association (FMMA)**  USD   2.500 %   25503/2014   308, 147   1.492.062   Foderal National Mortgage Association (FMMA)**  USD   4.000 %   2.500 %   1.492.062   Foderal National Mortgage Association (FMMA)**  USD   4.000 %   2.500 %   1.492.062   Foderal National Mortgage Association (FMMA)**  USD   4.000 %   2.500 %   1.492.062   Foderal National Mortgage Association (FMMA)**  USD   4.000 %   2.000 %   1.492.062   Foderal National Mortgage Association (FMMA)**  USD   4.000 %   2.000 %   1.492.062   Foderal National Mortgage Association (FMMA)**  USD   4.000 %   2.000 %   1.492.062   Foderal National Mortgage Association (FMMA)**  USD   4.000 %   2.000 %   1.492.062   Foderal National Mortgage Association (FMMA)**  USD   4.000 %   2.000 %   1.001.066   Foderal National Mortgage Association (FMMA)**  USD   4.000 %   2.000 %   1.001.066   Foderal National Mortgage Association (FMMA)**  USD   4.000 %   2.000 %   1.001.066   Foderal National Mortgage Association (FMMA)**  USD   6.100 %   2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.000 & 2.					.,			0,09
2.980.444   Federal National Mortgage Association (FMMA)**  USD   2.500 %   2.500/22048   80.946   1.489.086   Federal National Mortgage Association (FMMA)**  USD   4.000 %   2.507/22050   216.240   1.502.146   Federal National Mortgage Association (FMMA)**  USD   4.000 %   2.507/22050   216.240   1.502.146   Federal National Mortgage Association (FMMA)**  USD   6.096 %   2.007/20143   83.387   1.428.249   Covernment National Mortgage Association (CMMA)**  USD   6.096 %   2.007/20143   83.387   1.428.249   Covernment National Mortgage Association (CMMA)**  USD   5.500 %   2.008/2014   2.022.577   1.008.250   2.008/2014   2.022.577   1.008.250   2.008/2014   2.022.577   1.008.250   2.008/2014   2.022.577   1.008.250   2.008/2014   2.022.577   1.008.250   2.008/2014   2.022.577   1.008.250   2.008/2014   2.022.577   1.008.250   2.008/2014   2.022.577   2.022.590   2.008/2014   2.022.590   2.008/2014   2.022.590   2.008/2014   2.022.590   2.008/2014   2.022.590   2.008/2014   2.022.590   2.008/2014   2.022.590   2.008/2014   2.022.590   2.008/2014   2.022.590   2.008/2014   2.022.590   2.008/2014   2.022.590   2.008/2014   2.022.590   2.008/2014   2.022.590   2.008/2014   2.022.590   2.008/2014   2.022.590   2.008/2014   2.022.590   2.008/2014   2.022.590   2.008/2014   2.022.590   2.008/2014   2.022.590   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.008/2014   2.00								0,20
1.498.988   Federal Mational Mortgage Association (FMMA)   USD   4.000 %   2.5007/2505   216.240   1.502.168   Federal Mational Mortgage Association (FMMA)   USD   4.000 %   2.5007/2505   227.826   475.040   5.000   4.000 %   2.5007/2505   227.826   475.040   5.000   4.000 %   2.5007/2505   227.826   475.040   5.000   4.000 %   2.5007/2505   227.826   475.040   4.000 %   2.000/27043   282.827   4.200.240   4.000 %   2.000/27043   282.827   4.200.240   4.000 %   2.000/27043   282.627   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.240   4.200.			*					0,52
1432 082   Federal Mational Mortgage Association (FMMA)   USD   4,000 %   2507/2505   216.246   1502/1616   Federal Mational Mortgage Association (FMMA)   USD   6,009 %   2007/2504   83.387   140.246   Covernment Mational Mortgage Association (FMMA)   USD   4,000 %   2008/2543   83.387   140.026   Covernment Mational Mortgage Association (FMMA)   USD   4,000 %   2008/2544   22.886   140.026   Covernment Mational Mortgage Association (FMMA)   USD   4,000 %   2008/2544   80.027   140.026   Covernment Mational Mortgage Association (FMMA)   USD   5,009 %   2008/2544   80.021   140.026   Covernment Mational Mortgage Association (FMMA)   USD   5,009 %   2008/2544   80.021   140.026   Covernment Mational Mortgage Association (FMMA)   USD   5,000 %   2008/2545   63.027   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026   140.026			*					0,10 0,02
1502.186   Federal National Mortgage Association (FNMA)   USD   6,099 % 2000/22045   33.387   478.249   Coverment National Mortgage Association (FNMA)   USD   5,860 % 2000/22045   282.657   190.026   Coverment National Mortgage Association (FNMA)   USD   5,509 % 2000/22045   282.657   190.026   Coverment National Mortgage Association (FNMA)   USD   5,509 % 2000/22045   282.657   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045   2000/22045			•					0,02
475.405   Governmenn National Micrigage Association (GNNA)**    14.28.249   Governmenn National Micrigage Association (GNNA)*    14.09.683   Governmenn National Micrigage Association (GNNA)*    15.59.183*  Governmenn National Micrigage Association (GNNA)*    15.59.183*  Governmenn National Micrigage Association (GNNA)*    15.59.183*  Governmenn National Micrigage Association (GNNA)*    15.29.213   Governmenn National Micrigage Association (GNNA)*    16.20.214   Governmenn National Micrigage Association (GNNA)*    16.20.215   Governmenn Nationa			•					0,06
1426.249   Coverment National Micrigage Association (GNMA)   USD								0,02
4 90.6 833   Overmenn National Mortgage Association (GNMA)   1 001 0069   Overmenn National Mortgage Association (GNMA)   2 002 505   Overmenn National Mortgage Association (GNMA)   3 000 0vermenn National Mortgage Association (GNMA)   5 0.6 109 % 200082045   363.4346   5 0.6 1898   Overmenn National Mortgage Association (GNMA)   5 0.6 1.9 9 % 200082045   363.4366   5 0.6 1898   Overmenn National Mortgage Association (GNMA)   6 1.5 1898   Overmenn National Mortgage Association (GNMA)   8 1.6 1892   Overmenn National Mortgage Association (GNMA)   8 1.6 1893   Overmenn National Mortgage Association (GNMA)   8 1.7 1894   Overmenn National Mortgage Association (GNMA)   8 1.7 1895   Overmenn Natio				USD		20/08/2043	282.657	0,08
1.010.088   Coverment National Mortgage Association (GMMA)**   USD   5.009 %   2008/2045   53.43 14	190.026	Government National Mortgage Association	(GNMA)	USD	4,000 %	20/08/2044	22.989	0,01
2.992.559	4.906.583	Government National Mortgage Association	(GNMA) <sup>(f)</sup>	USD	5,509 %	20/08/2044	806.621	0,22
Total   Coverment National Mortgage Association (GMMA)   USD   6,109 %   2008/2045   686,070								0,03
S. Sell. 887   Government National Mortgage Association (GNMA)/P USD 6,19% 2008;2045 683078 1,926.313   Government National Mortgage Association (GNMA)/P USD 5,609% 2009;2045 28.837 205.413   Government National Mortgage Association (GNMA)/P USD 5,609% 2009;2045 28.837 205.413   Government National Mortgage Association (GNMA)/P USD 6,109% 2009;2045 31.149 28.8161   Government National Mortgage Association (GNMA)/P USD 6,109% 2009;2045 31.149 28.8161   Government National Mortgage Association (GNMA)/P USD 6,109% 2009;2045 53.1419 28.8161   Government National Mortgage Association (GNMA)/P USD 6,109% 2009;2045 55.145 23.4069   Government National Mortgage Association (GNMA)/P USD 6,109% 2009;2045 55.147.218 24.069   Government National Mortgage Association (GNMA)/P USD 6,109% 2001;2045 55.147.218 24.069   Government National Mortgage Association (GNMA)/P USD 6,109% 2001;2045 55.147.218 24.069   Government National Mortgage Association (GNMA)/P USD 5,509% 2001;2046 721.610 24.405.514   Government National Mortgage Association (GNMA)/P USD 5,509% 2001;2046 721.610 24.405.514   Government National Mortgage Association (GNMA)/P USD 6,109% 2001;2046 721.610 24.405.514   Government National Mortgage Association (GNMA)/P USD 6,109% 2001;2046 721.610 24.405.514   Government National Mortgage Association (GNMA)/P USD 6,109% 2001;2046 721.610 24.249.595   Government National Mortgage Association (GNMA)/P USD 6,109% 2001;2046 221.610 24.249.510   Government National Mortgage Association (GNMA)/P USD 6,109% 2001;2046 221.610 24.249.610   Government National Mortgage Association (GNMA)/P USD 6,109% 2000;2048 428.898 1.768.084   Government National Mortgage Association (GNMA)/P USD 6,009% 2000;2049 55.224   42.405   Government National Mortgage Association (GNMA)/P USD 6,009% 2000;2049 56.224   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405   42.405								0,10
3.723.973   Government National Mortgage Association (GNMA/) USD   6,199 % 1609/2045 3173/2018   1962.313   Government National Mortgage Association (GNMA/) USD   5,609 % 2009/2045 31.83.73   265.413   Government National Mortgage Association (GNMA/) USD   5,609 % 2009/2045 31.83.73   265.413   Government National Mortgage Association (GNMA/) USD   6,109 % 2009/2045 50.433   3814.655   Government National Mortgage Association (GNMA/) USD   6,109 % 2009/2045 50.433   3814.655   Government National Mortgage Association (GNMA/) USD   6,109 % 2009/2045 70.433   240.905   Government National Mortgage Association (GNMA/) USD   6,000 % 2001/2045 15.417.28   324.089   Government National Mortgage Association (GNMA/) USD   6,109 % 2001/2045 15.417.28   324.089   Government National Mortgage Association (GNMA/) USD   6,109 % 2001/2045 18.201   5,173.456   Government National Mortgage Association (GNMA/) USD   6,109 % 2001/2046 17.40.108   4,44.514   Government National Mortgage Association (GNMA/) USD   6,109 % 2001/2046 17.40.108   4,44.514   Government National Mortgage Association (GNMA/) USD   6,109 % 2001/2046 17.40.108   1,617.295   6,009 % 2001/2046 17.40.108   1,617.295   6,009 % 2001/2046 17.40.108   1,617.295   6,009 % 2001/2046 17.40.108   1,617.295   6,009 % 2001/2046 17.40.108   1,617.295   6,009 % 2001/2046 17.40.108   1,617.295   6,009 % 2001/2046 17.40.108   1,617.295   6,009 % 2001/2046 17.40.108   1,617.295   6,009 % 2001/2046 17.40.108   1,617.295   6,009 % 2001/2046 17.40.108   1,617.295   6,009 % 2001/2046 17.40.108   1,617.295   6,009 % 2001/2046 17.40.108   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,617.295   1,6								0,03
1962.313   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   5,69 % 2009;2045   28,837   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413   205,413								0,26
1.68   524   Covernment National Mortgage Association (GNMAy)** USD 5,699 % 2009;2045 31.149   208 616   Government National Mortgage Association (GNMAy)** USD 6,169 % 2009;2045 50.433								0,18
286.616 Government National Mortgage Association (CNIMA)***								0,09
288.616   Government National Mortgage Association (GNIMA)     USD   6,169 % 20092045   50.433   3.314.655   Government National Mortgage Association (GNIMA)    USD   4,000 % 20102045   1.541.728   3.341.635   Government National Mortgage Association (GNIMA)    USD   6,609 % 20102045   55.145   5.173.406   Government National Mortgage Association (GNIMA)    USD   6,609 % 20102045   88.201   5.173.406   Government National Mortgage Association (GNIMA)    USD   5,559 % 2011202045   88.201   4.404.514   Government National Mortgage Association (GNIMA)    USD   5,559 % 2011202046   721.803   2.249.999   Government National Mortgage Association (GNIMA)    USD   6,109 % 20012046   721.803   2.249.999   Government National Mortgage Association (GNIMA)    USD   6,109 % 20012046   721.803   2.249.999   Government National Mortgage Association (GNIMA)    USD   6,109 % 20012046   721.803   2.249.999   Government National Mortgage Association (GNIMA)    USD   6,109 % 20012046   721.803   2.249.999   Government National Mortgage Association (GNIMA)    USD   6,109 % 200082048   234.853   3.002.200   Government National Mortgage Association (GNIMA)    USD   6,109 % 200082048   234.853   3.002.200   Government National Mortgage Association (GNIMA)    USD   6,109 % 200082048   234.853   3.002.200   Government National Mortgage Association (GNIMA)    USD   6,059 % 20102049   267.692   3.639.087   Government National Mortgage Association (GNIMA)   USD   6,059 % 201022048   267.692   3.645.845.869   Government National Mortgage Association (GNIMA)   USD   4,500 % 201022049   361.5224   3.645.869   Government National Mortgage Association (GNIMA)   USD   4,500 % 201022049   361.5224   3.645.869   Government National Mortgage Association (GNIMA)   USD   3,500 % 201022049   361.5224   3.645.869   Government National Mortgage Association (GNIMA)   USD   3,500 % 201022049   361.5224   3.645.869   Government National Mortgage Association (GNIMA)   USD   3,500 % 201022050   361.5224   3.645.869   Government National Mortgage Associatio								0,01
3.341.655   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   6.159 %   2010/20-45   1541.728   1341.9348   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   6.009 %   2011/20-45   551.452   151.734.96   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   6.009 %   2011/20-45   551.473   151.734.96   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   5.599 %   2011/20-45   740.108   4.404.514   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   5.559 %   2011/20-45   740.108   4.404.514   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   5.559 %   2011/20-46   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.603   721.6								0,01
13.19.384   Government National Mortgage Association (CNIMA)   USD   4.009 %   20.10/12/045   55.14					·			0,01 0,20
324.069   Covermment National Mortgage Association (CNIMA)**								0,20
S17.190   Government National Mortgage Association (GNMA)     USD   5.559 % 2011\(\frac{120}{20}\) 12012\(\frac{12}{20}\) 12012\(								0,42
173.456   Government National Mortgage Association (GNMA)     USD   5.559 %   20011/2046   740.108								0,02
4.40 £14   Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(f)</sup>   USD   5.559 %   2.001-/2.046   727.290     2.249.950   Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(f)</sup>   USD   6.109 %   2.001-/2.046   218.187     1.671.295   Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(f)</sup>   USD   6.109 %   2.009-/2.046   224.838     3.002.200   Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(f)</sup>   USD   6.109 %   2.009-/2.048   224.898     1.768.084   Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(f)</sup>   USD   6.059 %   2.001-/2.048   247.893     1.768.084   Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(f)</sup>   USD   6.059 %   2.001-/2.048   267.692     1.5417.806   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   6.059 %   2.001-/2.048   267.692     1.5417.806   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   4.500 %   2.001-/2.048   267.692     2.29.988   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   4.500 %   2.001-/2.049   2.006-/2.049   2.006-/2.049     4.545.869   Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(f)</sup>   USD   3.179 %   2.006-/2.049   2.75.799     4.29.262   Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(f)</sup>   USD   3.500 %   2.001-/2.049   8.77.490     4.29.262   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   4.000 %   2.006-/2.049   5.52.24     9.40.179   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   4.000 %   2.006-/2.050   7.02.09     6.105.223   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   4.000 %   2.006-/2.050   7.16.699     2.287.218   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   4.000 %   2.006-/2.050   7.16.699     2.287.218   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   4.000 %   2.006-/2.050   7.16.699     2.287.218   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2.500 %   2.006-/2.050   7.16.699     2.287.218   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2.500 %   2.006-/2.050   7.16.699     2.287.218   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2.500 %   2.006-/2.05			10					0,20
1.289.881   Government National Mortgage Association (GNMA)								0,20
1.617.295   Covermment National Mortgage Association (CNMA)/IIII   USD   6,109 %   2008/2048   482.898   3.002.200   Government National Mortgage Association (CNMA)/IIII   USD   6,059 %   2010/202048   267.892   1.768.084   Government National Mortgage Association (CNMA)/IIII   USD   6,059 %   2010/202048   16.612.804   1.768.084   Government National Mortgage Association (CNMA)/IIII   USD   5,000 %   2010/202049   16.612.804   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.804.085   1.8	2.249.959	Government National Mortgage Association	(GNMA) <sup>(f)</sup>	USD	6,109 %	20/01/2046	377.290	0,10
3.002_200   Government National Mortgage Association (GNMA)    USD   6,109 %   2010    2014   267.692   15.417.806   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   6,059 %   2011   2014   16.12.804   3.639.087   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   5,000 %   2011   2014   16.12.804   3.639.087   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   5,959 %   20011   2014   3.871.566   292.988   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   5,959 %   2010   2014   2010   2014   2010   2010   2014   2010   2010   2014   2010   2014   2010   2010   2014   2010   2010   2014   2010   2010   2010   2010   2014   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   2010   20	1.298.981	Government National Mortgage Association	(GNMA) <sup>(f)</sup>	USD	6,109 %	20/01/2046	218.187	0,06
1.788.084   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   5,000 %   20/10/2048   16,612.804   15,417.806   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   5,000 %   20/10/2049   31,71.566   292.988   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   5,959 %   20/01/2049   31,71.566   292.988   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   5,959 %   20/01/2049   40,406   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450   40,450	1.617.295	Government National Mortgage Association	(GNMA) <sup>(f)</sup>	USD	6,109 %	20/08/2048	234.853	0,06
15.417.806   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   5.000 %   20/12/2048   16.612.804   3.639.087   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   5.959 %   20/01/2049   40.406   4.545.869   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   5.959 %   20/01/2049   40.406   4.545.869   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   3.179 %   20/06/2049   275.799   42.956   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   6.000 %   20/06/2049   55.224   9.420.179   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   3.500 %   20/10/2049   857.460   227.729   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   3.500 %   20/10/2050   276.799   4.200.775   50.0000   4.000 %   20/06/2050   270.209   6.105.223   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   3.500 %   20/06/2050   270.209   6.105.223   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   3.500 %   20/06/2050   2716.689   2.837.218   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   4.000 %   2.0006/2050   2716.689   2.837.218   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2.500 %   2.0006/2050   242.930   1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2.500 %   2.0012/2050   142.930   1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2.500 %   2.012/2050   142.930   1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2.500 %   2.012/2050   142.930   1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2.500 %   2.012/2050   142.930   1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2.500 %   2.012/2050   142.930   1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2.500 %   2.012/2050   142.930   1.304.651.6577   1.304.050   1.304.050   1.304.050   1.304.050   1.304.050   1.304.050   1.304.050   1.304.050   1.304.050   1.304.050   1.304.050   1.304.050   1.304.050   1.304.050   1.304.050   1.304.050   1.304.050   1.304.050   1.304.050   1.304.050   1.304.050   1.	3.002.200	Government National Mortgage Association	(GNMA) <sup>(f)</sup>	USD	6,109 %	20/09/2048	482.898	0,14
3.639.087   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   5.959 %   20/01/2049   3.871.566   292.988   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   3.179 %   20/06/2049   275.799   422.962   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   3.179 %   20/06/2049   275.799   422.962   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   6.009 %   20/06/2049   55.224   3.2017   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   3.500 %   20/01/2059   287.460   227.729   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   4.000 %   20/01/2050   276.789   227.729   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   4.000 %   20/01/2050   270.209   2.107.515   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   3.500 %   20/01/2050   270.209   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515   2.107.515	1.768.084	Government National Mortgage Association	(GNMA) <sup>(f)</sup>		6,059 %	20/10/2048	267.692	0,07
292.988   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   5.959 %   20/01/2049   275.799   42.5686   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   6.009 %   20/06/2049   275.799   422.962   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   6.009 %   20/06/2049   857.240   9.420.179   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   3.500 %   20/01/2049   857.460   227.729   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   3.500 %   20/01/2050   24.873   21.67.515   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   3.500 %   20/01/2050   24.873   21.67.515   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   3.500 %   20/01/2050   270.209   6.105.223   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   4.000 %   20/06/2050   716.689   2.837.218   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   4.000 %   2.006/2050   742.123   23.37.218   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2.500 %   2.010/2050   142.930   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2.500 %   2.010/2050   142.930   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2.500 %   2.010/2050   142.930   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2.500 %   2.010/2050   142.930   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.00	15.417.806	Government National Mortgage Association	(GNMA)	USD	5,000 %	20/12/2048	16.612.804	4,54
4.545.869   Government National Mortgage Association (GMMA)  <sup>(1)</sup>   USD   3,179 %   20/06/2049   55.224   422.962   Government National Mortgage Association (GMMA)   USD   3,500 %   20/10/2049   857.460   9.420.179   Government National Mortgage Association (GMMA)   USD   3,500 %   20/10/2049   857.460   227.729   Government National Mortgage Association (GMMA)   USD   4,000 %   20/01/2050   24.873   2.167.515   Government National Mortgage Association (GMMA)   USD   4,000 %   20/01/2050   270.209   6.105.223   Government National Mortgage Association (GMMA)   USD   4,000 %   20/06/2050   716.689   2.837.218   Government National Mortgage Association (GMMA)   USD   4,000 %   20/06/2050   424.123   1.304.531   Government National Mortgage Association (GMMA)   USD   2,500 %   20/10/2050   424.123   1.304.531   Government National Mortgage Association (GMMA)   USD   2,500 %   20/10/2050   424.123   1.304.531   Government National Mortgage Association (GMMA)   USD   2,500 %   20/10/2050   424.123   1.304.531   Government National Mortgage Association (GMMA)   USD   2,500 %   20/10/2050   424.123   1.304.531   Government National Mortgage Association (GMMA)   USD   2,500 %   20/10/2050   424.123   1.304.531   Government National Mortgage Association (GMMA)   USD   2,500 %   20/10/2050   424.123   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531   1.304.531								1,06
422.962   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   3,500 %   20/10/2049   857.460     9.420.178   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   3,500 %   20/10/2050   24.873     2.167.515   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   3,500 %   20/04/2050   270.209     6.105.223   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   3,500 %   20/04/2050   270.209     6.105.223   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   4,000 %   20/06/2050   716.689     8.2.837.218   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   6,059 %   20/06/2050   424.123     1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2050   142.930     1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2050   142.930     1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2050   142.930     1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2050   142.930     1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2050   142.930     1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2050   142.930     1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2050   142.930     1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2050   142.930     1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2050   142.930     1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2050     1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2050     1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2050     1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2050     1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2050     1.304.531   Government National Mor								0,01
9.420.179   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   3,500 %   20/10/2049   857.480   2277.729   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   4,000 %   20/10/2050   270.209   6.105.223   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   3,500 %   20/10/2050   270.209   6.105.223   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   4,000 %   20/10/2050   716.689   2.837.218   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   6,059 %   20/10/2050   142.930   1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2050   142.930   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2050   142.930   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2051   18.544.431   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2051   18.544.431   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2051   18.544.431   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2051   18.544.431   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2051   18.544.431   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2051   18.544.431   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2051   18.544.431   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2051   18.544.431   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2051   18.544.431   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2051   18.544.431   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2051   18.544.431   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2051   18.544.431   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000   18.000.000								0,08
227.729   Government National Mortgage Association (GNMA)								0,02
2.167.515   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   3,500 %   20/04/2050   270.209   6.105.223   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   4,000 %   20/06/2050   716.689   2.837.218   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   6,059 %   20/06/2050   742.930   1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2050   142.930   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2050   142.930   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA)   TBA(9)   USD   2,500 %   20/12/2051   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544								0,23
6.105.223   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   4,000 %   20/06/2050   716.889   2.837.218   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   6,059 %   20/06/2050   2424.123   1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2050   142.930   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA) TBA(9)   USD   2,500 %   20/10/2050   142.930   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA) TBA(9)   USD   2,500 %   20/10/2050   142.930   18.000.000   2.500 %   20/10/2050   2.500 %   20/10/2050   18.544.431   2.500   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.500 %   2.								0,01 0,07
2.837.218         Government National Mortgage Association (GNMA) <sup>(f)</sup> USD         6,059 %         20/06/2050         424.123           1.304.531         Government National Mortgage Association (GNMA)         USD         2,500 %         20/10/2051         142.930           18.000.000         Government National Mortgage Association (GNMA) TBA <sup>(g)</sup> USD         2,500 %         20/12/2051         18.544.431           TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste USD 63.669.583)         63.616.577           TOTAL DE VALORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO (coste USD 63.669.583)         63.616.577           VALOR DE MERCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD 350.655.703)         353.624.221           Contratos de futuros – (0,28 %)           Valor de mercado de la asignación del valor         Plus valía latente en USD           LEUR           1 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/2021         Larga         247.983         6.850           USD           G3 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022         Larga         10.204.031         259.472           1.239         Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022         Larga         10.204.031 <t< td=""><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td>0,07</td></t<>								0,07
1.304.531   Government National Mortgage Association (GNMA)   USD   2,500 %   20/10/2051   142.930   18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA) TBA(9)   USD   2,500 %   20/12/2051   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   63.616.577   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431   18.544.431			10					0,19
18.000.000   Government National Mortgage Association (GNMA) TBA(9)   USD   2,500 %   20/12/2051   18.544.431   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.577   63.616.5								0,12
Coste USD 63.669.583   63.616.577		0 0						5,07
TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR AGENCIAS (coste USD 63.669.583)   63.616.577     TOTAL DE VALORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO (coste USD 63.669.583)   63.616.577     VALOR DE MERCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD 350.655.703)   353.624.221     Contratos de futuros - (0,28 %)     Número de contratos   Descripción del valor   Plusvalía latente en USD   Plusvalía laten	10.000.000	Covernment Hatterial Mertgage / Icecolation	(3.1111)	_	2,000 /0	20/12/2001		17,40
Coste USD 63.669.583    63.616.577							03.010.377	17,40
(coste USD 63.669.583)         63.616.577           VALOR DE MERCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD 350.655.703)         353.624.221           Contratos de futuros - (0,28 %)           Número de contratos         Valor de mercado de la asignación el uslo         Plusvalía latente en USD         I latente en USD			S EMITIDOS O GARANTIZADOS PO	OR AGENC	AS		63.616.577	17,40
(coste USD 350.655.703)         353.624.221           Contratos de futuros – (0,28 %)           Número de contratos         Valor de mercado de la asignación el latente en USD         Plusvalía latente en USD           EUR         1 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/2021         Larga         247.983         6.850           USD         3 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022         Larga         10.204.031         259.472           1.239         Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022         Larga         162.386.438         2.231.918			TRO MERCADO REGULADO				63.616.577	17,40
Contratos de futuros - (0,28 %)   Número de contratos   Descripción del valor   Descripción del valo			NDO DERIVADOS				252 524 224	96,72
Número de contratos Descripción del valor el un USD Descripción del valor de la Asignación del valor en USD de la Asignación del valor en USD de la Centrato en USD de la Centrato en USD de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/2021 Larga 247.983 6.850 DESCRIPCIÓN DESCRIPCIÓN DESCRIPCIÓN DESCRIPCIÓN DESCRIPCIÓN DE LA CENTRA DEL CENTRA DE LA CEN	·	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					333.024.221	30,72
contratos         Descripción del valor         en USD         en USD         I           USD         63         Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022         Larga         247.983         6.850           1         Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022         Larga         10.204.031         259.472           1.239         Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022         Larga         162.386.438         2.231.918	Contratos de	tuturos – (0,28 %)				Valor de mercado F	Plusvalía	
EUR 1 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/2021 Larga 247.983 6.850  USD 63 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Larga 10.204.031 259.472 1.239 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Larga 162.386.438 2.231.918		December 16 del celes				-		% del
1 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/2021     Larga     247.983     6.850       USD       63 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022     Larga     10.204.031     259.472       1.239 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022     Larga     162.386.438     2.231.918	contratos	· ·				en USD	en USD	patrimonio
63 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Larga 10.204.031 259.472  1.239 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Larga 162.386.438 2.231.918	1		al de Alemania a 30 años 08/12/2021	L	arga	247.983	6.850	0,00
1.239 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Larga 162.386.438 2.231.918	22		a large plane 22/02/2002			10 204 004	250 472	0.07
· ·					-			0,07
2.1 Futurios sobre bonos del resoro de EE. UU. a muy largo piazo 22/03/2022 Larga 4.194.750 112.983		. •			-			0,61
470 705 040 0 004 070	21	ruluros sobre donos del Tesoro de EE. UU.	a muy iargo piazo 22/03/2022	L	arya -			0,03
176.785.219 2.604.373	DITICALÍALA	TENTE SORDE CONTRATOS DE CUTURO	·e					0,71
PLUSVALIA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS 2.611.223	FLUSVALIA LA	MIENTE SUBRE CONTRATUS DE FUTURO	ان -			2.	017.223	0,71

#### Contratos de futuros – (continuación)

Número de contratos	Descripción del valor		Valor de mercado de la asignación en USD	Minusvalía latente en USD	% del patrimonio
	EUR				
(5)	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años 08/12/2021	Corta	(981.680)	(9.422)	(0,00)
(15)	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/12/2021	Corta	(2.315.071)	(8.534)	(0,00)
			(3.296.751)	(17.956)	(0,00)
	USD				
(338)	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022	Corta	(74.029.922)	(221.489)	(0,06)
(1.187)	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022	Corta	(144.452.337)	(1.396.082)	(0,38)
(688)	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años 22/03/2022	Corta	(101.125.250)	(1.998.976)	(0,55)
			(319.607.509)	(3.616.547)	(0,99)
MINUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS			(3.634.503)	(0,99)

#### Contratos de divisas a plazo - 0,10 %

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
BRL	6.285.989	USD	1.121.395	02/12/2021	1.023	0,00
EUR	1.852.570	PLN	8.541.568	06/12/2021	28.216	0,00
USD	11.261.092	INR	841.674.575	07/12/2021	52.214	0,00
USD	428.185	TRY	5.437.908	10/12/2021	14.702	0,00
USD	453.300	ZAR	6.907.521	13/12/2021	20.809	0,01
USD	2.300.000	TRY	21.776.400	14/12/2021	647.262	0,18
AUD	4.980.816	NZD	5.215.881	15/12/2021	1.348	0,00
CAD	8.697.025	EUR	5.842.221	15/12/2021	160.967	0,05
CHF	17.771.670	EUR	16.582.157	15/12/2021	534.651	0,14
CNH	163.149.214	USD	25.227.451	15/12/2021	365.680	0,09
EUR	964.655	CAD	1.389.707	15/12/2021	9.706	0,00
EUR	2.912.616	PLN	13.392.900	15/12/2021	56.183	0,01
EUR	2.909.771	SEK	29.364.273	15/12/2021	53.990	0,02
GBP	4.931.828	EUR	5.776.364	15/12/2021	14.438	0,00
ILS	3.498.472	EUR	963.800	15/12/2021	15.575	0,00
JPY	498.971.951	EUR	3.878.465	15/12/2021	17.178	0,00
USD	2.211.036	AUD	3.010.383	15/12/2021	54.717	0,02
USD	24.585.360	CAD	31.125.372	15/12/2021	208.002	0,07
USD	2.253.882	CZK	49.646.810	15/12/2021	43.506	0,02
USD	74.260.024	EUR	64.095.212	15/12/2021	1.296.784	0,37
USD	21.536.835	GBP	15.800.477	15/12/2021	423.930	0,12
USD	1.074.460	HUF	336.015.898	15/12/2021	29.695	0,01
USD	36.425.532	JPY	4.075.269.253	15/12/2021	225.828	0,06
USD	5.570.500	MXN	114.265.888	15/12/2021	225.654	0,07
USD	9.428.926	NOK	81.076.349	15/12/2021	468.139	0,13
USD	18.425.278	NZD	26.430.494	15/12/2021	353.323	0,10
USD	18.326.574	SEK	158.122.835	15/12/2021	780.679	0,20
USD	2.245.945	SGD	3.055.047	15/12/2021	5.901	0,00
USD	3.730.871	THB	124.747.807	15/12/2021	28.920	0,01
USD	16.172.336	TRY	146.545.345	15/12/2021	5.055.321	1,39
USD USD	6.614.429	ZAR TRY	98.226.938	15/12/2021	466.073	0,13
USD	711.175 281.967	ILS	8.518.142 863.947	20/12/2021 21/12/2021	66.481	0,02 0,00
USD	1.318.013	ILS	4.135.400	22/12/2021	7.076 2.129	0,00
ILS	9.757.363	USD	3.080.000	24/12/2021	25.185	0,00
USD	267.129	ILS	824.494	24/12/2021	4.742	0,00
TWD	76.934.977	USD	2.770.335	19/01/2022	19.388	0,00
USD	1.205.427	SEK	10.347.640	20/01/2022	55.691	0,02
USD	8.512.675	GBP	6.245.549	21/01/2022	161.727	0,04
USD	6.097.913	MXN	124.746.841	24/01/2022	307.149	0,08
USD	829.576	CHF	757.106	25/01/2022	1.283	0,00
USD	3.037.384	NOK	25.338.309	25/01/2022	238.005	0,07
USD	8.566.517	ILS	26.403.269	26/01/2022	154.533	0,04
USD	7.094.343	AUD	9.579.726	31/01/2022	229.221	0,07
USD	5.164.135	CAD	6.428.960	31/01/2022	127.368	0,03
USD	1.889.862	CZK	41.234.000	31/01/2022	56.967	0,02
USD	4.639.923	ZAR	71.590.000	03/02/2022	189.127	0,05
USD	1.891.575	CLP	1.558.865.555	07/02/2022	39.354	0,01
EUR	10.241.446	USD	11.575.087	10/02/2022	104.680	0,02
USD	2.957.864	HKD	23.044.651	10/02/2022	1.674	0,00
USD	4.177.438	KRW	4.948.325.942	10/02/2022	7.242	0,00
USD	18.093.167	PLN	73.653.701	10/02/2022	242.343	0,07
USD	3.289.724	RUB	247.063.130	10/02/2022	6.677	0,01

#### Contratos de divisas a plazo – (continuación)

					Plusvalía	
				Fecha	latente	% del
Divisa	Compra	Divisa	Venta	de vencimiento	en USD	patrimonio
JPY	140.864.000	USD	1.238.675	16/02/2022	13.764	0,00
USD	1.555.425	NZD	2.233.298	16/02/2022	29.731	0,01
USD	4.600.000	TRY	44.387.700	14/06/2022	1.552.095	0,42
PLUSVALÍA LATE	NTE SOBRE CONTRATOS	DE DIVISAS A PLAZ	0		15.304.046	4.19

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente en USD	% del patrimonio
USD	1.120.827	BRL	6.346.120	02/12/2021	(12.328)	(0,00)
PLN	1.774.870	EUR	385.900	06/12/2021	(6.945)	(0,00)
INR	868.462.239	USD	11.727.831	07/12/2021	(162.212)	(0,03)
USD	6.047.504	ZAR	96.608.188	09/12/2021	(4.807)	(0,00)
ZAR	113.590.283	USD	7.123.140	09/12/2021	(6.934)	(0,00)
ZAR	35.407.855	USD	2.309.859	13/12/2021	(92.918)	(0,03)
TRY	40.710.000	USD	4.600.000	14/12/2021	(1.510.280)	(0,41)
AUD	22.905.314	USD	16.913.809	15/12/2021	(506.874)	(0,16)
CAD	24.384.296	USD	19.428.199	15/12/2021	(330.446)	(0,09)
CHF	9.774.086	USD	10.684.151	15/12/2021	(8.427)	(0,01)
CZK	71.974.577	EUR	2.835.541	15/12/2021	(23.406)	(0,00)
CZK	142.522.225	USD	6.601.591	15/12/2021	(256.216)	(0,07)
EUR	2.890.914	AUD	4.661.601	15/12/2021	(48.183)	(0,01)
EUR	1.946.992	CHF	2.106.723	15/12/2021	(84.692)	(0,02)
EUR	1.938.778	CZK	49.771.312	15/12/2021	(8.896)	(0,00)
EUR	1.128.029	GBP	968.097	15/12/2021	(9.490)	(0,00)
EUR	4.816.072	HUF	1.763.818.376	15/12/2021	(1.780)	(0,01)
EUR	3.870.051	JPY	508.438.328	15/12/2021	(110.842)	(0,03)
EUR	103.961.154	USD	120.095.420	15/12/2021	(1.750.499)	(0,48)
GBP	10.933.577	USD	14.888.792	15/12/2021	(279.135)	(80,0)
HUF	1.400.870.243	EUR	3.917.557	15/12/2021	(103.894)	(0,03)
HUF	492.642.582 3.667.497.959	USD	1.659.478	15/12/2021	(127.718)	(0,04)
JPY MXN	70.358.806	USD USD	32.975.510	15/12/2021 15/12/2021	(397.947)	(0,11)
	60.606.886	EUR	3.396.074 5.917.483	15/12/2021 15/12/2021	(105.005)	(0,03)
NOK NOK	51.592.349	USD	5.949.451	15/12/2021	(37.764) (247.320)	(0,01) (0,06)
NZD	23.620.467	USD	16.630.850	15/12/2021	(480.264)	(0,00)
PLN	17.720.704	EUR	3.853.237	15/12/2021	(73.693)	(0,03)
PLN	14.486.665	USD	3.791.532	15/12/2021	(265.929)	(0,07)
SEK	19.273.429	EUR	1.923.408	15/12/2021	(50.875)	(0,01)
SEK	90.049.337	USD	10.005.882	15/12/2021	(13.673)	(0,02)
SGD	3.048.222	USD	2.260.697	15/12/2021	(25.657)	(0,01)
THB	109.938.858	USD	3.287.715	15/12/2021	(25.226)	(0,01)
TRY	89.164.383	USD	9.175.412	15/12/2021	(2.411.348)	(0,66)
USD	17.643.519	CHF	16.235.991	15/12/2021	(90.207)	(0,02)
USD	16.164.700	CNH	104.451.638	15/12/2021	(220.574)	(0,06)
USD	1.219.711	ILS	3.907.405	15/12/2021	(23.077)	(0,01)
ZAR	131.218.335	USD	8.764.524	15/12/2021	(551.125)	(0,15)
ILS	7.205.893	USD	2.304.170	22/12/2021	(11.254)	(0,00)
INR	107.615.125	USD	1.431.960	27/12/2021	(1.018)	(0,00)
USD	13.648.621	TWD	377.899.236	19/01/2022	(54.302)	(0,02)
SEK	4.367.451	USD	507.030	20/01/2022	(21.758)	(0,01)
GBP	6.679.099	USD	9.152.341	21/01/2022	(221.690)	(0,06)
MXN	124.423.507	USD	6.049.935	24/01/2022	(274.181)	(0,07)
CHF	446.674	USD	489.429	25/01/2022	(757)	(0,00)
NOK	20.518.066	USD	2.438.914	25/01/2022	(172.076)	(0,05)
HUF	402.782.992	USD	1.286.062	26/01/2022	(36.139)	(0,01)
USD	1.984.824	HUF	640.851.619	26/01/2022	(3.878)	(0,00)
AUD	11.249.986	USD	8.331.267	31/01/2022	(269.186)	(0,07)
CAD	5.316.650	USD	4.270.658	31/01/2022	(105.331)	(0,03)
CZK	52.005.212	USD	2.383.535	31/01/2022	(71.848)	(0,02)
ZAR	52.883.075	USD	3.427.481	03/02/2022	(139.707)	(0,04)
CLP	1.770.895.841	USD	2.194.113	07/02/2022	(89.962)	(0,02)
SGD	1.587.891	USD	1.176.508	07/02/2022	(12.490)	(0,00)
HKD	22.610.118	USD	2.902.090	10/02/2022	(1.643)	(0,00)
IDR	35.546.466.182	USD	2.469.190	10/02/2022	(3.719)	(0,00)
PLN	70.497.541	USD	17.317.851	10/02/2022	(231.958)	(0,06)
RUB	357.673.838	USD	4.949.290	10/02/2022	(196.416)	(0,05)
USD	6.706.388	EUR	5.933.701	10/02/2022	(60.650)	(0,02)
USD	1.562.134	JPY	177.648.237	16/02/2022	(17.358)	(0,01)
USD	14.524.084	JPY	1.672.541.216	25/03/2022	(352.650)	(0,10)

Contratos	de	divisas a	plazo –	(continuación)

					Minusvalía		
				Fecha	latente	% del	
Divisa	Compra	Divisa	Venta	de vencimiento	en USD	patrimonio	
USD	55.607.493	JPY	6.401.206.514	11/04/2022	(1.340.729)	(0,37)	
TRY	24.110.900	USD	2.300.000	14/06/2022	(644.413)	(0,18)	
MINUSVALÍA LATE	NTE SOBRE CONTRATOS	DE DIVISAS	S A PLAZO		(14.801.719)	(4.09)	

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones – (0,11 %)

			Piusvalia			
				Fecha	latente	% del
Divisa	Compra	Divisa	Venta	de vencimiento	en USD	patrimonio
USD	807.300	SEK	6.956.243	20/01/2022	34.385	0,01
USD	19.153	GBP	14.000	21/01/2022	434	0,00
EUR	183.277.744	USD	206.955.560	10/02/2022	2.061.937	0,57
			430 OF FRRANCO CON FINES RE CORFERINA			

PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA 2.096.756 0,58

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente en USD	% del patrimonio
SEK	461.320.198	USD	53.678.812	20/01/2022	(2.421.120)	(0,66)
GBP	1.469.427	USD	2.020.143	21/01/2022	(55.364)	(0,02)
CHF	4.591.570	USD	5.032.491	25/01/2022	(9.207)	(0,00)
USD	163.352	CHF	149.976	25/01/2022	(725)	(0,00)
PLN	2.139.714	USD	525.679	10/02/2022	(7.095)	(0,00)
USD	3.161.483	EUR	2.798.524	10/02/2022	(30.071)	(0,01)
MINUSVALÍA LATE	IINUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FINES DE COBERTURA				(2.523.582)	(0,69)

Opciones - (1,77 %)

				Plusvalía/ (minusvalía) latente	Valor de mercado	% del
Tenencias	Descripción del valor			USD	en USD	patrimonio
	Opciones adquiridas EUR					
3.859.000	Put EUR / Call PLN	Vence 02/12/2021	Precio de ejercicio 4,56	(10.078)	5	0,00
3.859.000	Put EUR / Call PLN	Vence 02/12/2021	Precio de ejercicio 4,56	(11.653)	4	0,00
30.370.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,12	(53.031)	43.818	0,01
34.019.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,12	(104.728)	35.031	0,01
30.508.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	(17.919)	110.563	0,03
30.529.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,14	55.237	172.923	0,05
				(142.172)	362.344	0,10
	GBP					
34.490.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,28	(54.792)	11.100	0,00
45.050.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,30	(72.286)	15.395	0,00
41.790.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,42	(68.476)	22.108	0,01
38.170.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,46	(60.658)	22.845	0,01
43.780.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 11/10/2022	Precio de ejercicio 0,92	(14.905)	104.588	0,03
34.540.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 13/10/2022	Precio de ejercicio 0,93	(12.755)	84.651	0,02
40.410.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 15/11/2022	Precio de ejercicio 0,52	(64.124)	30.810	0,01
36.800.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,54	(55.899)	30.658	0,01
				(403.895)	322.155	0,09
	JPY					
829.840.000	Put Swaption del LIBOR a 6 meses	Vence 26/05/2022	Precio de ejercicio 0,43	(89.071)	55.653	0,02
	USD					
29.300.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 14/11/2022	Precio de ejercicio 0,70	(228.770)	67.788	0,02
8.680.000	Call USD / Put ILS	Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 3,11	147.030	178.808	0,05
8.586.000	Call USD / Put ILS	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 3,13	88.522	122.351	0,03
8.800.000	Call USD / Put ILS	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 3,14	84.850	119.962	0,03
17.568.000	Call USD / Put INR	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 75,26	36.629	84.941	0,02
6.622.000	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 15,90	19.402	74.895	0,02
13.200.000	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 16,15	(30.716)	64.178	0,02
				116.947	712.923	0,19
TOTAL DE OPCIO (coste USD 1.971.	NES ADQUIRIDAS 265)				1.453.075	0,40
	Opciones suscritas					
(23.500.000)	EUR Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 0,20	(84.975)	(262.598)	(0,07)

Opciones -	(continuación)

encias	Descripción del valor			Plusvalía/ (minusvalía) latente USD	Valor de mercado en USD	% patrime
	Opciones suscritas – (continuación)					patrilli
	EUR – (continuación)					
(23.500.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 0,19	(99.646)	(267.676)	(0
(23.500.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 0,23	(194.650)	(371.246)	(0
(23.500.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 06/01/2022	Precio de ejercicio 0,18	(77.872)	(278.011)	(0
(16.180.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(47.853)	(296.045)	((
(16.180.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(70.734)	(296.045)	ì
(20.020.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(46.261)	(366.306)	(
(16.190.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	(92.516)	(360.546)	Ò
(13.360.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	(73.972)	(297.523)	Ò
(23.500.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 0,20	120.945	(56.677)	(
(23.500.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 0,19	62.213	(105.816)	(
(23.500.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 0,23	79.029	(97.567)	Ċ
(23.500.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 06/01/2022	Precio de ejercicio 0,18	34.153	(165.986)	Ċ
(14.630.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 26/05/2022	Precio de ejercicio 0,11	4.855	(144.720)	(
(16.180.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	54.878	(157.429)	(
(16.180.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	67.381	(157.429)	
(20.020.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	46.928	(194.792)	Ċ
(16.190.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	120.572	(134.956)	
(13.360.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	112.185	(111.366)	
(15.185.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	39.492	(55.031)	
(15.552.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	90.852	(56.361)	Ċ
(15.254.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,14	3.816	(86.402)	
				48.820	(4.320.528)	('
	GBP					
(3.560.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,36	17.823	(48.081)	(
(4.650.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,40	18.665	(69.037)	(
(4.300.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,38	23.520	(66.904)	(
(3.910.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,42	15.999	(67.616)	(
(4.610.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 11/10/2022	Precio de ejercicio 1,04	(139.285)	(258.948)	(
(3.630.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 13/10/2022	Precio de ejercicio 0,99	(90.795)	(188.134)	(
(4.180.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 15/11/2022	Precio de ejercicio 0,55	(9.201)	(104.253)	(
(3.800.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,60	(17.697)	(104.208) (907.181)	(1
	USD			(100.971)	(907.101)	
(26.490.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 06/12/2021	Precio de ejercicio 1,58	(43.804)	(244.134)	(
(26.490.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,64	(166.967)	(395.774)	
(26.490.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 1,67	(267.991)	(494.481)	(
(26.490.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 1,60	(123.004)	(369.361)	(
(5.700.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 14/11/2022	Precio de ejercicio 1,06	163.220	(132.850)	(
(4.340.000)	Call USD / Put ILS	Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 3,06	(107.515)	(143.242)	(
(4.293.000)	Call USD / Put ILS	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 3,08	(78.043)	(116.422)	(
(4.400.000)	Call USD / Put ILS	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 3,09	(76.789)	(117.841)	(
(8.784.000)	Call USD / Put INR	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 74,72	(31.991)	(77.422)	(
(2.141.000)	Call USD / Put TRY	Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 12,30	(153.030)	(177.097)	(
(6.600.000)	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 15,90	8.538	(74.646)	(
(26.490.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 06/12/2021	Precio de ejercicio 1,58	158.935	(41.396)	(
(26.490.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,64	170.940	(57.867)	(
(26.490.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 1,67	141.152	(85.338)	(
(26.490.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 1,60	86.379	(159.978)	(
AL DE ODCION	IFC CHCCDITAC			(319.970)	(2.687.849)	((
Ste USD (7.463.4	IES SUSCRITAS 436))				(7.915.558)	(2
AL DE OPCION	IES					

#### Contratos de permutas financieras – (0,38 %)

Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
	Permutas de tipos de interés					
19.050.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 2,000 %	AUD	17/03/2032	97.705	0,03
66.220.000	Fijo 5,800 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2023	525.710	0,14
16.750.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,400 %	BRL	02/01/2023	25.200	0,01
81.630.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,300 %	BRL	02/01/2024	141.921	0,04
60.190.000	Fijo 6,320 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2025	1.047.427	0,29

Contratos de	permutas financieras – (	(continuación)	

Importe					Plusvalía	
teórico local neto	Anagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	latente	% del
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	recna de vencimiento	en USD	patrimonio
	Permutas de tipos de interés – (continuación)					
66.405.000	Fijo 8,495 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	04/01/2027	942.063	0,26
	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 11,230 %	BRL	04/01/2027	81.658	0,02
19.430.000	Fijo 1,000 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2023	122.041	0,03
	Fijo 1,750 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2026	43.397	0,01
	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,500 %	CAD	14/10/2031	125.978	0,03
	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)  Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 2,250 %	CAD CHF	15/12/2051 16/03/2032	360.224 264.419	0,10 0,07
	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,000 % Fijo 0,500 %	CHF	17/03/2032	49.259	0,07
22.589.759.310	,	Variable (CLOIS a 6 meses en CLP)	CLP	15/12/2023	432.205	0,12
	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,500 %	CNY	15/09/2023	90.378	0,02
	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,500 %	CNY	15/12/2026	118.394	0,03
33.793.020.000	Fijo 4,900 %	Variable (LIBOR a 3 meses en COP)	COP	15/12/2023	146.387	0,04
21.920.920.000	Fijo 6,400 %	Variable (LIBOR a 3 meses en COP)	COP	15/12/2031	48.843	0,01
1.943.711.227	•	Variable (PRIBOR a 6 meses en CZK)	CZK	15/12/2023	965.310	0,26
	Variable (PRIBOR a 6 meses en CZK)	Fijo 3,600 %	CZK	15/12/2023	172.719	0,05
	Fijo 2,200 %	Variable (PRIBOR a 6 meses en CZK)	CZK	15/12/2031	99.492	0,03
	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	03/11/2023	362.104	0,10
	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2026	8.499	0,00
	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,200 %	EUR	03/11/2027	100.322	0,03
	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR) Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,500 % Fijo 0,000 %	EUR EUR	26/11/2031 15/12/2031	125.044 123.049	0,03 0,03
	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,500 %	EUR	17/03/2032	56.915	0,03
	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,720 %	EUR	02/12/2036	22.369	0,02
	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,257 %	EUR	02/12/2046	29.199	0,01
	Variable (TELBOR a 3 meses en ILS)	Fijo 1,300 %	ILS	15/12/2031	234.602	0,06
	Variable (LIBOR a 6 meses en INR)	Fijo 5,500 %	INR	15/09/2026	182.552	0,05
58.864.820.000	Fijo 1,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en KRW)	KRW	16/03/2024	129.494	0,04
417.570.000	Fijo 6,200 %	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	13/12/2023	314.330	0,09
213.380.842	Fijo 6,700 %	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	09/12/2026	259.396	0,07
	Fijo 7,150 %	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	03/12/2031	164.003	0,05
	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	Fijo 2,000 %	NOK	16/03/2027	34.362	0,01
	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 3,000 %	NZD	16/09/2031	13.234	0,00
	Fijo 1,700 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2026	75.943	0,02
	Fijo 0,000 %	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	SEK	15/12/2023	42	0,00
	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK) Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,500 % Fijo 0,750 %	SEK SEK	16/03/2024 15/12/2031	64.251 64.570	0,02 0,02
	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 1,000 %	SEK	17/03/2032	4.599	0,02
	Fijo 0,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD	15/12/2023	129.208	0,04
	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	Fijo 1,530 %	USD	22/09/2031	698.009	0,19
	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	Fijo 1,750 %	USD	15/12/2031	185.934	0,05
PLUSVALÍA LATE	ENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE I	INTERÉS			9.282.760	2,54
	Permutas de inflación					
12 250 000	Fijo 2,250 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/10/2023	6.088	0,00
	Fijo 3,250 %	Variable (LIBOR a 12 meses en USD)	USD	07/10/2022	193.478	0,06
	Fijo 2,104 %	Variable (USCP a 12 meses en USD)	USD	14/12/2024	1.070.426	0,00
	ENTE SOBRE PERMUTAS DE INFLACIÓN			11/12/2021	1.269.992	0,35
						<del></del>
TOTAL DE PLUS	VALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DI	E PERMUTAS FINANCIERAS			10.552.752	2,89
Importe					Minusvalía	
teórico					latente	% del
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	en USD	patrimonio
	Permutas de tipos de interés					
166.370.000	Variable (BBSW a 3 meses en AUD)	Fijo 0,190 %	AUD	22/02/2023	(274.038)	(80,0)
19.240.000	Variable (BBSW a 3 meses en AUD)	Fijo 0,250 %	AUD	15/12/2023	(64.789)	(0,02)
123.750.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 1,250 %	AUD	15/12/2026	(1.439.952)	(0,39)
24.810.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 2,000 %	AUD	15/12/2031	(321.270)	(0,09)
	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 10,565 %	BRL	02/01/2023	(12.721)	(0,00)
	Variable (LIBOR a 1 mes en BRL)	Fijo 7,200 %	BRL	02/01/2023	(832.556)	(0,23)
	Fijo 11,814 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(4.179)	(0,00)
	Fijo 11,905 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(4.886)	(0,00)
	Fijo 12,185 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(12.741)	(0,00)
	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 4,930 %	BRL	02/01/2024	(379.919)	(0,10)
	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 7,370 %	BRL BRL	02/01/2024	(866.859)	(0,24)
	Variable (CETIP a 1 mes en BRL) Fijo 2,000 %	Fijo 9,200 % Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	02/01/2024 15/12/2031	(320.467) (295.450)	(0,09) (0,08)
	Variable (LIBOR a 6 meses en CLP)	Fijo 5,100 %	CAD	15/12/2031	(65.229)	(0,08)
	Fijo 2,600 %	Variable (PRIBOR a 6 meses en CZK)	CZK	15/12/2031	(4.480)	(0,02)
	- ·	,	-		,/	(-,)

#### Contratos de permutas financieras – (continuación)

Importe teórico Iocal neto	A nagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente en USD	% de
local neto	A pagar	A recidir	DIVISA	recna de vencimiento	eu 02D	patrimon
	Permutas de tipos de interés – (continuación)					
21.430.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/12/2026	(136.165)	(0,0
	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	03/11/2027	(452.879)	(0,1
	Fijo 0,000 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2031	(4.318)	(0,0
7.880.000	Fijo 0,750 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	26/11/2041	(124.637)	(0,0
13.690.000	Fijo 0,531 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	02/12/2041	(60.059)	(0,0
4.580.000	Fijo 0,250 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2051	(95.198)	(0,0
700.000	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	Fijo 0,270 %	GBP	17/06/2025	(18.684)	(0,0
21.200.000	Fijo 0,500 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2026	(123.201)	(0,0
8.260.000	Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)	Fijo 4,060 %	GBP	15/12/2028	(841.999)	(0,2
320.000	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	Fijo 0,308 %	GBP	17/06/2030	(23.735)	(0,0
32.200.000	Fijo 0,750 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2031	(182.571)	(0,0
26.240.000	Fijo 1,000 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	17/03/2032	(229.128)	(0,0
73.390.000	Variable (HIBOR a 3 meses en HKD)	Fijo 1,500 %	HKD	15/09/2031	(41.015)	(0,0
16.439.373.109		Variable (BUBOR a 6 meses en HUF)	HUF	16/03/2024	(12.866)	(0,0
1.827.874.880	•	Variable (BUBOR a 6 meses en HUF)	HUF	16/03/2032	(67.242)	(0,0
	Fijo 0,400 %	Variable (TELBOR a 3 meses en ILS)	ILS	15/12/2023	(7.904)	(0,0
1.562.600.000	• •	Variable (LIBOR a 6 meses en INR)	INR	16/03/2024	(134.210)	(0,0
2.532.500.000	•	Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)	JPY	15/12/2031	(21.052)	(0,0
14.116.200.000	•	Variable (KWCDC a 3 meses en KRW)	KRW	15/09/2031	(140.595)	(0,0
	Fijo 2,000 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	16/03/2027	(162.400)	(0,0
	Fijo 2,130 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	11/05/2031	(184.360)	
	•				, ,	(0,0
	Fijo 2,000 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	16/03/2032	(47.926)	(0,0
	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 0,500 %	NZD	15/09/2022	(231.372)	(0,0
	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 1,250 %	NZD	15/12/2022	(22.058)	(0,0
	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 1,750 %	NZD	15/12/2026	(296.433)	(0,0
	Fijo 2,000 %	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	NZD	15/12/2031	(43.962)	(0,0
	Fijo 0,250 %	Variable (WIBOR a 3 meses en PLN)	PLN	16/12/2021	(134.240)	(0,0
	Fijo 1,750 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2023	(13.667)	(0,0
	Fijo 2,000 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2031	(3.412)	(0,0
	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,250 %	SEK	15/12/2026	(20.633)	(0,0
	Variable (LIBOR a 6 meses en THB)	Fijo 1,000 %	THB	15/09/2026	(15.511)	(0,0
148.930.000	Variable (LIBOR a 6 meses en THB)	Fijo 1,000 %	THB	16/03/2027	(13.988)	(0,0
20.680.000	Fijo 0,250 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2024	(70.933)	(0,0
410.000	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	Fijo 1,250 %	USD	15/12/2026	(5.935)	(0,0
31.090.000	Fijo 1,000 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2027	(111.266)	(0,0
8.630.000	Fijo 2,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD	17/09/2031	(27.099)	(0,0
8.300.000	Fijo 1,750 %	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD	15/12/2031	(150.033)	(0,0
64.590.000	Fijo 1,630 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	22/09/2036	(658.500)	(0,1
	Fijo 1,750 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2052	(178.069)	(0,0
	Fijo 5,500 %	Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	ZAR	15/12/2023	(66.658)	(0,0
	Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	Fijo 7,400 %	ZAR	15/12/2031	(18.943)	(0,0
_	TENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS				(10.094.392)	(2,76
'L INTERES	Permutas de inflación					
14 300 000	Fijo 1,920 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/11/2031	(110.116)	(0,0
	Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)					
	TENTE SOBRE PERMUTAS DE INFLACI	Fijo 4,170 % ÓN	GBP	15/11/2028	(1.735.797) (1.845.913)	(0,4 ( <b>0,5</b>
OTAL DE MINUS	SVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS				(11.940.305)	(3,2
DE PERMUTAS F VALOR DE MERO	CADO DE LAS INVERSIONES					
coste USD 345.1	63.532)				344.826.406	94,2
OTROS ACTIVOS	S Y PASIVOS				20.779.975	5,7
PATRIMONIO					365.606.381	100,0

TOTAL DE INVERSIONES	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Total inversiones excluyendo derivados (coste USD 350.655.703)	353.624.221	96,72
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	2.611.223	0,71
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(3.634.503)	(0,99)
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	15.304.046	4,19
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	(14.801.719)	(4,09)
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	2.096.756	0,58
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	(2.523.582)	(0,69)
Valor de mercado de opciones compradas (coste USD 1.971.265)	1.453.075	0,40
Valor de mercado de opciones suscritas (coste USD (7.463.436))	(7.915.558)	(2,17)
Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	10.552.752	2,89
Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	(11.940.305)	(3,27)
Otros activos y pasivos	20.779.975	5,72
Patrimonio	365.606.381	100,00

El Comisionista de futuros fue Morgan Stanley & Co., Inc.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Australia & New Zealand Banking Group Ltd., Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Credit Suisse International, Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Natwest Markets Plc., Standard Chartered Bank, State Street Bank & Trust, UBS AG y Westpac Banking Corp.

Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc. y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Morgan Stanley y Morgan Stanley & Co. LLC.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 2,63 %.

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- (d) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,238 %.
- $^{(e)}\,$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.
- (f) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (9) Los valores TBA (por confirmar) se compran sobre una vez suscrito un compromiso a plazo con un importe de principal aproximado (por lo general +/-2,5 %) y sin fecha definitiva de vencimiento. El importe real del principal y la fecha de vencimiento se determinarán tras la liquidación cuando se asignen los "pools" de hipotecas específicos.

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD p	% del
		Divisa	Tipo de interes	T cond de venemiento	CII 00D F	, au illioni
Bonos - 48,3	liarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial 4 %					
Islas Caimán						
	SA Global Sukuk Ltd.	USD	2,694 %	17/06/2031	210.525	0,27
	Seagate HDD Cayman	USD	3,125 %	15/07/2029	196.391	0,2
	Tencent Holdings Ltd.	USD	2,880 %	22/04/2031	224.596	0,28
125.000	Transocean, Inc.	USD	11,500 %	30/01/2027	750.262	0,15
Colombia						-,-,
	Bonos internacionales del Estado de Colombia	USD	3,875 %	15/02/2061	159.783	0,20
Alemania 200 000	Commerzbank AG <sup>(c)</sup>	EUR	6,125 %	Perp.	246.060	0,31
Indonesia	Online 25 drik 710		0,120 70	1 616.	240.000	0,0
200.000	Bonos internacionales del Estado de Indonesia	USD	3,350 %	12/03/2071	189.750	0,24
Isla de Man						
	Sasol Financing International Ltd.	USD	4,500 %	14/11/2022	203.000	0,26
Italia 100.000	Nexi SpA	EUR	2,125 %	30/04/2029	110.983	0,14
Costa de Marfi						-,
200.000	Bonos internacionales del Estado de Costa de Marfil	USD	6,125 %	15/06/2033	205.279	0,26
Japón						
944.650.000	Depósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1018	JPY	(0,163 %)	25/02/2022	8.392.703	10,67
1.081.750.000	Depósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1021	JPY	(0,170 %)	10/03/2022	9.611.435	12,22
403.000.000	Depósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1025	JPY	(0,153 %)	25/03/2022	3.580.759	4,55
264.300.000	Depósito con descuento del Tesoro de Japón – Serie 1028	JPY	(0,147 %)	11/04/2022		2,98
Jersey					23.933.388	30,42
•	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,160 %	31/03/2034	194.550	0,25
México						
200 000	Mexico City Airport Trust	USD	5,500 %	31/10/2046	193.540	0,25
	Bonos internacionales del Estado de México	USD	2,659 %	24/05/2031	192.905	0,24
	Bonos internacionales del Estado de México	USD	3,771 %	24/05/2061	180.465	0,23
					566.910	0,72
Países Bajos						
200.000	Lukoil Securities BV	USD	3,875 %	06/05/2030	205.150	0,26
Nigeria						
	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	7,875 %	16/02/2032	191.250	0,25
200.000	Bonos internacionales del Estado de Nigeria	USD	7,375 %	28/09/2033	182.750 374.000	0,23
Omán					374.000	0,40
	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	4,750 %	15/06/2026	202.625	0,26
200.000	Bonos internacionales del Estado de Omán	USD	5,375 %	08/03/2027	205.875	0,26
Catan					408.500	0,52
Catar	Oatar Energy	USD	3,125 %	12/07/2041	200.900	0,25
	Qatar Energy Qatar Energy	USD	3,125 %	12/07/2041	200.900	0,26
	Bonos internacionales del Estado de Catar	USD	4,500 %	23/04/2028	367.200	0,20
320.000	Bollos ilicitiacionales del Estado de Gatal	OOD	4,300 70	23/04/2020	773.475	0,98
Rumanía		1				•
200.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	EUR	2,000 %	14/04/2033	207.374	0,26
170.000	Bonos internacionales del Estado de Rumanía	USD	4,000 %	14/02/2051	165.856	0,21
					373.230	0,47
Arabia Saudí						
	Bonos internacionales del Estado saudí	USD	3,625 %	04/03/2028	250.125	0,32
Sudáfrica	Panas internacionales del Estado de Cudéfrica	HCD	4.050.0/	20/00/2020	204 050	0.00
200.000	Bonos internacionales del Estado de Sudáfrica	USD	4,850 %	30/09/2029	201.853	0,26

Tenencias	Descripción del velor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado	% de
	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interes	recha de vencimiento(**/	en USD p	atrimoni
Bonos – (cont España	unuacion)					
•	Banco Santander S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	4,375 %	Perp.	231.325	0,29
200.000	CaixaBank S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	5,875 %	Perp.	254.992	0,33
					486.317	0,62
Supranacional	es					
200.000	African Export-Import Bank	USD	3,798 %	17/05/2031	203.238	0,26
Suecia						
100.000	Heimstaden Bostad AB <sup>(c)</sup>	EUR	3,625 %	Perp.	112.710	0,14
Turquía						
200.000	Bonos internacionales del Estado de Turquía	USD	5,750 %	11/05/2047	161.052	0,2
Ucrania						
170.000	Bonos internacionales del Estado de Ucrania	USD	7,750 %	01/09/2026	170.205	0,2
Emiratos Árabe						
200.000	Bonos internacionales del Estado de Abu Dabi	USD	3,875 %	16/04/2050	232.250	0,30
Estados Unido						_
	Apache Corp.	USD	4,625 %	15/11/2025	47.363	0,0
	B&G Foods, Inc.	USD	5,250 %	01/04/2025	96.456	0,1
	B&G Foods, Inc. Buckeye Partners LP	USD USD	5,250 % 4,350 %	15/09/2027 15/10/2024	35.352 31.050	0,0 0,0
	Buckeye Partners LP	USD	3,950 %	01/12/2026	40.000	0,0
	Chemours Co.	USD	5,375 %	15/05/2027	172.200	0,0
	Cheniere Energy Partners LP	USD	4,500 %	01/10/2029	84.100	0,1
	CHS Via Community Health Systems, Inc.	USD	5,625 %	15/03/2027	108.806	0,1
	Citigroup Global Markets Holdings, Inc. (c)	USD	3,872 %	20/09/2023	250.650	0,3
	Cleveland-Cliffs, Inc.	USD	5,875 %	01/06/2027	242.190	0,3
30.000	Dana, Inc.	USD	5,375 %	15/11/2027	31.425	0,0
352.000	DaVita, Inc.	USD	3,750 %	15/02/2031	328.240	0,4
75.000	DISH DBS Corp.	USD	5,875 %	15/07/2022	76.078	0,1
35.000	DISH DBS Corp.	USD	5,875 %	15/11/2024	35.394	0,0
	DISH DBS Corp.	USD	7,750 %	01/07/2026	35.963	0,0
	Encompass Health Corp.	USD	4,500 %	01/02/2028	50.375	0,0
	EQT Corp.	USD	3,625 %	15/05/2031	197.101	0,2
	Genesis Energy LP Via Genesis Energy Finance Corp.	USD	7,750 %	01/02/2028	73.781	0,0
	Global Partners LP Via GLP Finance Corp. Group 1 Automotive, Inc.	USD USD	7,000 % 4,000 %	01/08/2027 15/08/2028	223.560 49.500	0,2
	Hilton Domestic Operating Co., Inc.	USD	4,875 %	15/01/2030	334.551	0,0
	Icahn Enterprises LP Via Icahn Enterprises Finance Corp.	USD	4,750 %	15/09/2024	117.300	0,1
	iHeartCommunications, Inc.	USD	8,375 %	01/05/2027	31.575	0,0
	Ingevity Corp.	USD	3,875 %	01/11/2028	43.200	0,0
	Kraft Heinz Foods Co.	USD	5,000 %	15/07/2035	322.590	0,4
37.000	Kraft Heinz Foods Co.	USD	4,375 %	01/06/2046	42.657	0,0
105.000	Kraft Heinz Foods Co.	USD	4,875 %	01/10/2049	130.838	0,1
60.000	Lumen Technologies, Inc. – Serie T	USD	5,800 %	15/03/2022	60.413	0,0
70.000	Mercer International, Inc.	USD	5,500 %	15/01/2026	70.935	0,0
195.000	Navient Corp.	USD	5,625 %	01/08/2033	181.350	0,2
	Netflix, Inc.	USD	5,500 %	15/02/2022	70.569	0,0
	Occidental Petroleum Corp.	USD	8,000 %	15/07/2025	231.290	0,2
	Occidental Petroleum Corp.	USD	6,625 %	01/09/2030	103.062	0,1
	Penske Automotive Group, Inc.	USD	3,500 %	01/09/2025	71.356	0,0
	Scripps Escrow II, Inc.	USD	5,375 %	15/01/2031	40.300	0,0
	Stericycle, Inc.	USD	5,375 %	15/07/2024	71.812	0,0
	T-Mobile USA, Inc. TransDigm, Inc.	USD USD	2,875 % 5,500 %	15/02/2031 15/11/2027	257.977 166.237	0,3 0,2
	United Rentals North America, Inc.	USD	3,875 %	15/02/2031	280.700	0,2
	Cupones de bonos strip del Tesoro de Estados Unidos	USD	1,784 %	15/02/2038	836.299	1,0
	Cupones de bonos strip del Tesoro de Estados Unidos	USD	1,823 %	15/08/2038	1.548.088	1,0
	USA Compression Partners LP Via USA Compression Finance Corp.	USD	6,875 %	01/04/2026	92.025	0,1
	·				7.314.708	9,3
Venezuela						
	Petroleos de Venezuela S.A.	USD	6,000 %	28/10/2022	202.800	0,2
TOTAL DE BON	NOS		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·			

5.976.572 TOTAL DE FON (coste USD 5.97	ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VALOR		(e)		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	patrimonio
Irlanda 5.976.572  TOTAL DE FON (coste USD 5.93  TOTAL DE VAL (coste USD 47.8	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de distri DOS DE INVERSIÓN 76.572) ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VALOR		(e)			
TOTAL DE VAL (coste USD 47.9	76.572) ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VALOR	ES OFICIAI			5.976.572	7,60
TOTAL DE VAL (coste USD 47.9	ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VALOR	ES OFICIAI			5.976.572	7,60
·	948.689)		-			
Tenencias					44.006.150	55,94
	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Valores mobili Bonos – 9,68	iarios negociados en otro mercado regulado %					
Islas Caimán						
112.076	Global Aircraft Leasing Co., Ltd. 144A <sup>(f)</sup>	USD	6,500 %	15/09/2024	108.574	0,14
Luxemburgo						
	Altice Financing S.A. 144A <sup>(f)</sup>	USD	5,000 %	15/01/2028	189.500	0,24
	Camelot Finance S.A. 144A <sup>(f)</sup>	USD	4,500 %	01/11/2026	410.800	0,52
	Intelsat Jackson Holdings S.A. 144A <sup>(f)</sup>	USD USD	8,000 % 5,000 %	15/02/2024 01/02/2025	178.719 35.533	0,23 0,04
33.000	Nielsen Co. Luxembourg SARL 144A <sup>(f)</sup>	030	5,000 %	01/02/2023		
					814.552	1,03
Supranacionale 272 000	clarios Global LP Via Clarios US Finance Co. 144A <sup>(f)</sup>	LIOD	0.500.0/	45/05/0007	000 000	0.07
	Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144A <sup>(f)</sup>	USD USD	8,500 %	15/05/2027 25/05/2024	288.320	0,37
	Digicel International Finance Ltd. Via Digicel International Holdings Ltd. 144A <sup>(f)</sup>	USD	8,750 % 13,000 %	31/12/2025	48.271 26.736	0,06 0,03
	Digicel International Finance Ltd. Via Digicel international Holdings Ltd. 144A <sup>(f)</sup>	USD	8,000 %	31/12/2026	18.214	0,02
	Titan Acquisition Ltd. Via Titan Co-Borrower LLC 144A <sup>(f)</sup>	USD	7,750 %	15/04/2026	169.211	0,22
					550.752	0,70
Estados Unidos	S				330.732	
	Acrisure LLC Via Acrisure Finance, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	7,000 %	15/11/2025	119.740	0,15
	Albertsons Cos., Inc. Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via Albertsons LLC 144A <sup>(f)</sup>	USD	7,500 %	15/03/2026	138.307	0,18
	Albertsons Cos., Inc. Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via Albertsons	OOD	7,300 70	13/03/2020	130.307	0,10
	LLC 144A <sup>(f)</sup>	USD	4,625 %	15/01/2027	62.325	0,08
	Albertsons Cos., Inc. Via Safeway, Inc. Via New Albertsons LP Via Albertsons LLC 144A <sup>(f)</sup>	USD	4,875 %	15/02/2030	58.437	0,07
	Alliant Holdings Intermediate LLC Via Alliant Holdings Co-Issuer 144A <sup>(f)</sup>	USD	6,750 %	15/10/2027	172.125	0,22
	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp. 144A <sup>(f)</sup>	USD	6,625 %	15/07/2026	51.625	0,07
55.000	Allied Universal Holdco LLC Via Allied Universal Finance Corp. 144A <sup>(f)</sup>	USD	9,750 %	15/07/2027	57.784	0,07
69.000	Berry Global, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	4,500 %	15/02/2026	69.816	0,09
104.000	Booz Allen Hamilton, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	3,875 %	01/09/2028	104.650	0,13
	Castle US Holding Corp. 144A <sup>(f)</sup>	USD	9,500 %	15/02/2028	54.188	0,07
	Cedar Fair LP Via Canada's Wonderland Co. Via Magnum Management Corp. Via Millennium Op 144A <sup>(f)</sup>	USD	5,500 %	01/05/2025	174.915	0,22
50.000	Change Healthcare Holdings LLC Via Change Healthcare Finance, Inc.		2,222 /2			-,
	144A <sup>(f)</sup>	USD	5,750 %	01/03/2025	50.003	0,06
	CHS Via Community Health Systems, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	8,000 %	15/03/2026	31.463	0,04
	Cumulus Media New Holdings, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	6,750 %	01/07/2026	46.744	0,06
	Diamond Sports Group LLC Via Diamond Sports Finance Co. 144A <sup>(f)</sup>	USD	5,375 %	15/08/2026	6.675	0,01
	Diamond Sports Group LLC Via Diamond Sports Finance Co. 144A <sup>(f)</sup> Flex Acquisition Co., Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD USD	6,625 %	15/08/2027 15/01/2025	17.638 70.013	0,02
	Flex Acquisition Co., Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	6,875 % 7,875 %	15/07/2026	41.671	0,09 0,05
	Freedom Mortgage Corp. 144A <sup>(f)</sup>	USD	7,625 %	01/05/2026	288.535	0,03
	Group 1 Automotive, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	4,000 %	15/08/2028	228.690	0,37
	H&E Equipment Services, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	3,875 %	15/12/2028	27.335	0,29
	Herc Holdings, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	5,500 %	15/07/2027	282.896	0,03
	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	5,375 %	01/05/2025	5.159	0,01
	iHeartCommunications, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	5,250 %	15/08/2027	50.813	0,06
	IRB Holding Corp. 144A <sup>(f)</sup>	USD	7,000 %	15/06/2025	288.015	0,37
	Iron Mountain, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	5,250 %	15/07/2030	30.750	0,04
	LABL, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	6,750 %	15/07/2026	30.938	0,04
	LABL, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	10,500 %	15/07/2027	31.575	0,04
	LCM Investments Holdings II LLC 144A <sup>(f)</sup>	USD	4,875 %	01/05/2029	50.375	0,06
	Lumen Technologies, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	5,125 %	15/12/2026	35.219	0,04
	Manitowoc Co., Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	9,000 %	01/04/2026	100.700	0,13

enencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
sonos – (con	tinuación)					-
stados Unido	os – (continuación)					
	Match Group Holdings II LLC 144A <sup>(f)</sup>	USD	4,625 %	01/06/2028	143.467	0,18
	Mattel, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	5,875 %	15/12/2027	134.062	0,17
	Par Pharmaceutical, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	7,500 %	01/04/2027	35.613	0,05
	Performance Food Group, Inc. 144A <sup>(f)</sup> Performance Food Group, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD USD	6,875 % 5,500 %	01/05/2025 15/10/2027	21.000 51.750	0,03 0,07
	Prime Security Services Borrower LLC 144A <sup>(f)</sup>	USD	6,250 %	15/01/2028	55.550	0,07
	PTC, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	3,625 %	15/02/2025	32.137	0,04
	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. Via LifePoint Health, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	9,750 %	01/12/2026	282.277	0,36
50.000	Rocket Mortgage LLC Via Rocket Mortgage Co-Issuer, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	3,875 %	01/03/2031	49.853	0,06
	Scripps Escrow II, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	5,375 %	15/01/2031	80.800	0,10
	Scripps Escrow, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	5,875 %	15/07/2027	163.600	0,21
	Sensata Technologies, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	3,750 %	15/02/2031	167.875	0,21
	Staples, Inc. 144A <sup>(†)</sup> State of California	USD USD	7,500 %	15/04/2026	30.150	0,04
	State of California State of Illinois	USD	7,625 % 5,100 %	01/03/2040 01/06/2033	58.758 591.614	0,07 0,75
	State of Illinois	USD	6,630 %	01/02/2035	745.475	0,75
	Station Casinos LLC 144A <sup>(f)</sup>	USD	4,500 %	15/02/2028	294.555	0,37
	Summit Materials LLC Via Summit Materials Finance Corp. 144A <sup>(f)</sup>	USD	6,500 %	15/03/2027	93.544	0,12
	Univar Solutions USA, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	5,125 %	01/12/2027	52.313	0,07
	USI, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	6,875 %	01/05/2025	86.062	0,11
60.000	Verscend Escrow Corp. 144A <sup>(f)</sup>	USD	9,750 %	15/08/2026	63.059	0,08
	VICI Properties LP Via VICI Note Co., Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	3,500 %	15/02/2025	67.921	0,09
	Wolverine Escrow LLC 144A <sup>(f)</sup>	USD	8,500 %	15/11/2024	28.275	0,04
	Wolverine Escrow LLC 144A <sup>(f)</sup>	USD	9,000 %	15/11/2026	28.275	0,04
7.000	Yum! Brands, Inc. 144A <sup>(f)</sup>	USD	7,750 %	01/04/2025	7.368	0,01
OTAL DE BOI	NOS				6.144.472	7,81
coste USD 7.4					7.618.350	9,68
bligaciones stados Unido	con garantía de activos emitidos o garantizados por agencias – 10,60	%				
		HOD	0.000.0/	04/00/0000	4.000	0.00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup>	USD USD	2,000 % 2,238 %	01/09/2033 01/09/2033	1.988 5.881	0,00 0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup>	USD	2,215 %	01/10/2034	4.780	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup>	USD	2,090 %	01/11/2034	62.286	0,08
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	2,150 %	01/11/2034	756	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	2,150 %	01/11/2034	3.353	0,00
2.021	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	2,260 %	01/11/2034	2.135	0,00
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	2,375 %	01/11/2034	7.414	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	2,276 %	01/02/2035	4.715	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	2,375 %	01/02/2035	5.430	0,01
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(C)	USD			10.050	0.05
13.444			2,125 %	01/05/2036	42.853	
171 830	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(C)	USD	0,689 %	15/09/2037	13.675	0,02
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD USD	0,689 % 5,911 %	15/09/2037 15/05/2041	13.675 26.091	0,02 0,03
283.598	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup>	USD USD USD	0,689 % 5,911 % 5,911 %	15/09/2037 15/05/2041 15/09/2043	13.675 26.091 42.430	0,02 0,03 0,05
283.598 331.792	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup>	USD USD	0,689 % 5,911 % 5,911 % 5,511 %	15/09/2037 15/05/2041	13.675 26.091	0,02 0,03 0,05 0,06
283.598 331.792 331.321	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup>	USD USD USD	0,689 % 5,911 % 5,911 %	15/09/2037 15/05/2041 15/09/2043 15/05/2045	13.675 26.091 42.430 44.733	0,02 0,03 0,05 0,06 0,07
283.598 331.792 331.321 392.962	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup>	USD USD USD USD USD	0,689 % 5,911 % 5,911 % 5,511 % 5,911 %	15/09/2037 15/05/2041 15/09/2043 15/05/2045 15/05/2046	13.675 26.091 42.430 44.733 56.239	0,02 0,03 0,05 0,06 0,07 0,08
283.598 331.792 331.321 392.962 481.954	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup>	USD USD USD USD USD USD	0,689 % 5,911 % 5,911 % 5,511 % 5,911 % 5,958 %	15/09/2037 15/05/2041 15/09/2043 15/05/2045 15/05/2046 25/10/2048	13.675 26.091 42.430 44.733 56.239 60.631	0,02 0,03 0,05 0,06 0,07 0,08
283.598 331.792 331.321 392.962 481.954 314.686	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup>	USD USD USD USD USD USD USD	0,689 % 5,911 % 5,911 % 5,511 % 5,911 % 5,958 % 4,500 %	15/09/2037 15/05/2041 15/09/2043 15/05/2046 15/05/2046 25/10/2048 01/03/2049	13.675 26.091 42.430 44.733 56.239 60.631 516.807	0,02 0,03 0,05 0,06 0,07 0,08 0,66 0,40
283.598 331.792 331.321 392.962 481.954 314.686 33.372	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) <sup>(c)</sup> Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)	USD USD USD USD USD USD USD	0,689 % 5,911 % 5,911 % 5,511 % 5,918 % 4,500 % 1,792 %	15/09/2037 15/05/2041 15/09/2043 15/05/2045 15/05/2046 25/10/2048 01/03/2049 25/01/2050	13.675 26.091 42.430 44.733 56.239 60.631 516.807 316.150	0,02 0,03 0,05 0,06 0,07 0,08 0,66 0,40
283.598 331.792 331.321 392.962 481.954 314.686 33.372 39.685 1.896	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal National Mortgage Association (FNMA)(c) Federal National Mortgage Association (FNMA)(c) Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD USD USD USD USD USD USD USD USD USD	0,689 % 5,911 % 5,911 % 5,511 % 5,911 % 5,958 % 4,500 % 1,792 % 1,538 % 1,584 % 2,278 %	15/09/2037 15/05/2041 15/09/2043 15/05/2046 25/10/2048 01/03/2049 25/01/2050 01/04/2033 01/06/2033	13.675 26.091 42.430 44.733 56.239 60.631 516.807 316.150 34.475 41.084 1.995	0,02 0,03 0,05 0,06 0,07 0,08 0,66 0,40 0,04
283.598 331.792 331.321 392.962 481.954 314.686 33.372 39.685 1.896 562	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,689 % 5,911 % 5,911 % 5,511 % 5,918 % 4,500 % 1,792 % 1,538 % 1,584 % 2,278 % 2,391 %	15/09/2037 15/05/2041 15/09/2043 15/05/2046 25/10/2048 01/03/2049 25/01/2050 01/04/2033 01/06/2033 01/07/2033	13.675 26.091 42.430 44.733 56.239 60.631 516.807 316.150 34.475 41.084 1.995 592	0,02 0,03 0,05 0,06 0,07 0,08 0,66 0,40 0,04 0,05 0,00
283.598 331.792 331.321 392.962 481.954 314.686 33.372 39.685 1.896 562 22.649	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A(c)(f) Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,689 % 5,911 % 5,911 % 5,511 % 5,918 % 4,500 % 1,792 % 1,538 % 1,584 % 2,278 % 2,391 % 2,533 %	15/09/2037 15/05/2041 15/09/2043 15/05/2046 25/10/2048 01/03/2049 25/01/2050 01/04/2033 01/06/2033 01/07/2033 01/04/2034	13.675 26.091 42.430 44.733 56.239 60.631 516.807 316.150 34.475 41.084 1.995 592 23.899	0,02 0,03 0,06 0,06 0,07 0,08 0,66 0,40 0,04 0,05 0,00 0,00
283.598 331.792 331.321 392.962 481.954 314.686 33.372 39.685 1.896 562 22.649 33.551	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,689 % 5,911 % 5,911 % 5,911 % 5,958 % 4,500 % 1,792 % 1,538 % 1,584 % 2,278 % 2,391 % 2,533 % 1,838 %	15/09/2037 15/05/2041 15/09/2043 15/05/2046 15/05/2046 25/10/2048 01/03/2049 25/01/2050 01/04/2033 01/06/2033 01/07/2033 01/04/2034 01/09/2034	13.675 26.091 42.430 44.733 56.239 60.631 516.807 316.150 34.475 41.084 1.995 592 23.899 35.183	0,02 0,03 0,05 0,06 0,07 0,08 0,40 0,04 0,05 0,00 0,00 0,00 0,00
283.598 331.792 331.321 392.962 481.954 314.686 33.372 39.685 1.896 562 22.649 33.551 59.417	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,689 % 5,911 % 5,911 % 5,911 % 5,958 % 4,500 % 1,792 % 1,538 % 2,278 % 2,391 % 2,533 % 1,838 % 2,235 %	15/09/2037 15/05/2041 15/09/2043 15/05/2046 15/05/2046 25/10/2048 01/03/2049 25/01/2050 01/04/2033 01/06/2033 01/07/2033 01/04/2034 01/04/2034 01/04/2034	13.675 26.091 42.430 44.733 56.239 60.631 516.807 316.150 34.475 41.084 1.995 592 23.899 35.183 62.663	0,02 0,03 0,06 0,06 0,06 0,44 0,02 0,06 0,00 0,00 0,00 0,00
283.598 331.792 331.321 392.962 481.954 314.686 33.372 39.685 1.896 562 22.649 33.551 59.417 6.674	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,689 % 5,911 % 5,911 % 5,911 % 5,958 % 4,500 % 1,792 % 1,538 % 2,278 % 2,391 % 2,533 % 1,838 % 2,235 % 1,933 %	15/09/2037 15/05/2041 15/09/2043 15/05/2046 25/10/2048 01/03/2049 25/01/2050 01/04/2033 01/07/2033 01/07/2034 01/04/2034 01/04/2034 01/04/2034	13.675 26.091 42.430 44.733 56.239 60.631 516.807 34.475 41.084 1.995 592 23.899 35.183 62.663 7.013	0,02 0,03 0,06 0,07 0,08 0,66 0,44 0,02 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00
283.598 331.792 331.321 392.962 481.954 314.686 33.372 39.685 1.896 562 22.649 33.551 59.417 6.674 5.795	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,689 % 5,911 % 5,911 % 5,911 % 5,958 % 4,500 % 1,792 % 1,538 % 2,278 % 2,391 % 2,533 % 1,838 % 2,235 % 1,933 % 2,321 %	15/09/2037 15/05/2041 15/09/2043 15/05/2046 25/10/2048 01/03/2049 25/01/2050 01/04/2033 01/06/2033 01/07/2034 01/09/2034 01/10/2034 01/10/2034 01/10/2034	13.675 26.091 42.430 44.733 56.239 60.631 516.807 316.150 34.475 41.084 1.995 592 23.899 35.183 62.663 7.013 6.125	0,02 0,03 0,06 0,07 0,07 0,08 0,66 0,44 0,02 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00
283.598 331.792 331.321 392.962 481.954 314.686 33.372 39.685 1.896 562 22.649 33.551 59.417 6.674 5.795 22.440	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A(c)(f) Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,689 % 5,911 % 5,911 % 5,911 % 5,918 % 4,500 % 1,792 % 1,538 % 2,278 % 2,391 % 2,533 % 1,838 % 2,235 % 1,933 % 2,321 % 1,984 %	15/09/2037 15/05/2041 15/09/2043 15/05/2046 25/10/2048 01/03/2049 25/01/2050 01/04/2033 01/06/2033 01/07/2033 01/04/2034 01/09/2034 01/10/2034 01/10/2034 01/11/2034 01/11/2034 01/10/2035	13.675 26.091 42.430 44.733 56.239 60.631 516.807 316.150 34.475 41.084 1.995 592 23.899 35.183 62.663 7.013 6.125 23.594	0,02 0,03 0,06 0,07 0,07 0,08 0,66 0,44 0,02 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00
283.598 331.792 331.321 392.962 481.954 314.686 33.372 39.685 1.896 562 22.649 33.551 59.417 6.674 5.795 22.440 18.443	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,689 % 5,911 % 5,911 % 5,918 % 4,500 % 1,792 % 1,538 % 4,504 % 2,278 % 2,391 % 2,531 % 2,535 % 1,933 % 2,321 % 1,984 % 2,046 %	15/09/2037 15/05/2041 15/09/2043 15/05/2046 15/05/2046 25/10/2048 01/03/2049 25/01/2050 01/04/2033 01/06/2033 01/07/2033 01/04/2034 01/04/2034 01/10/2034 01/11/2034 01/11/2034 01/03/2035 01/03/2035	13.675 26.091 42.430 44.733 56.239 60.631 516.807 316.150 34.475 41.084 1.995 592 23.899 35.183 62.663 7.013 6.125 23.594 19.390	0,02 0,03 0,06 0,06 0,06 0,06 0,00 0,00 0,00
283.598 331.792 331.321 392.962 481.954 314.686 33.372 39.685 1.896 562 22.649 33.551 59.417 6.674 5.795 22.440 18.443 7.363	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) 144A(c)(f) Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,689 % 5,911 % 5,911 % 5,911 % 5,958 % 4,500 % 1,792 % 1,538 % 2,278 % 2,391 % 2,533 % 1,838 % 2,235 % 1,933 % 2,321 % 1,946 % 2,046 % 2,185 %	15/09/2037 15/05/2041 15/09/2043 15/05/2046 25/10/2048 01/03/2049 25/01/2050 01/04/2033 01/06/2033 01/07/2033 01/04/2034 01/09/2034 01/10/2034 01/10/2034 01/11/2034 01/11/2034 01/10/2035	13.675 26.091 42.430 44.733 56.239 60.631 516.807 316.150 34.475 41.084 1.995 592 23.899 35.183 62.663 7.013 6.125 23.594 19.390 7.784	0,02 0,03 0,06 0,06 0,06 0,06 0,06 0,06 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00
283.598 331.792 331.321 392.962 481.954 314.686 33.372 39.685 562 22.649 33.551 6.674 5.795 22.440 18.443 7.363 8.427	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,689 % 5,911 % 5,911 % 5,918 % 4,500 % 1,792 % 1,538 % 4,504 % 2,278 % 2,391 % 2,531 % 2,535 % 1,933 % 2,321 % 1,984 % 2,046 %	15/09/2037 15/05/2041 15/09/2043 15/05/2046 15/05/2046 25/10/2048 01/03/2049 25/01/2050 01/04/2033 01/06/2033 01/07/2033 01/04/2034 01/04/2034 01/10/2034 01/10/2035 01/03/2035 01/03/2035	13.675 26.091 42.430 44.733 56.239 60.631 516.807 316.150 34.475 41.084 1.995 592 23.899 35.183 62.663 7.013 6.125 23.594 19.390	0,02 0,03 0,06 0,07 0,06 0,66 0,44 0,02 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00
283.598 331.792 331.321 392.962 481.954 314.686 33.372 39.685 1.896 562 22.649 33.551 59.417 6.674 5.795 22.440 18.443 7.363 8.427 6.124	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal National Mortgage Corp. (FHLMC) Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,689 % 5,911 % 5,911 % 5,911 % 5,958 % 4,500 % 1,792 % 1,538 % 2,278 % 2,391 % 2,533 % 1,838 % 2,235 % 1,933 % 2,321 % 1,984 % 2,046 % 2,185 % 1,774 %	15/09/2037 15/05/2041 15/05/2043 15/05/2046 25/10/2048 01/03/2049 25/01/2050 01/04/2033 01/07/2033 01/07/2033 01/04/2034 01/04/2034 01/10/2034 01/10/2034 01/10/2035 01/03/2035 01/03/2035 01/04/2035 01/04/2035	13.675 26.091 42.430 44.733 56.239 60.631 516.807 316.150 34.475 41.084 1.995 592 23.899 35.183 62.663 7.013 6.125 23.594 19.390 7.784 8.800	0,02 0,03 0,06 0,07 0,07 0,08 0,66 0,44 0,02 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00
283.598 331.792 331.321 392.962 481.954 314.686 33.372 39.685 1.896 562 22.649 33.551 59.417 6.674 5.795 22.440 18.443 7.363 8.427 6.124 25.727 54.221	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,689 % 5,911 % 5,911 % 5,918 % 4,500 % 1,792 % 1,538 % 2,278 % 2,391 % 2,533 % 1,838 % 2,235 % 1,933 % 2,321 % 1,984 % 2,046 % 2,185 %	15/09/2037 15/05/2041 15/09/2043 15/05/2046 25/10/2048 01/03/2049 25/01/2050 01/04/2033 01/06/2033 01/07/2034 01/04/2034 01/04/2034 01/10/2034 01/10/2034 01/10/2035 01/03/2035 01/03/2035 01/03/2035 01/04/2035 01/05/2035	13.675 26.091 42.430 44.733 56.239 60.631 516.807 316.150 34.475 41.084 1.995 592 23.899 35.183 62.663 7.013 6.125 23.594 19.390 7.784 8.800 6.470	0,05 0,02 0,03 0,05 0,06 0,07 0,08 0,66 0,40 0,04 0,05 0,00 0,00 0,03 0,04 0,08 0,01 0,01 0,01 0,01 0,01 0,01 0,01
283.598 331.792 331.321 392.962 481.954 314.686 33.372 39.685 562 22.649 33.551 6.674 5.795 22.440 18.443 7.363 8.427 6.124 25.727 54.221 10.945	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal National Mortgage Corp. (FHLMC) Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,689 % 5,911 % 5,911 % 5,911 % 5,918 % 4,500 % 1,792 % 1,538 % 2,278 % 2,391 % 2,533 % 1,838 % 2,235 % 1,933 % 2,321 % 1,984 % 2,046 % 2,185 % 1,774 % 2,385 % 2,000 % 4,500 %	15/09/2037 15/05/2041 15/09/2043 15/05/2046 25/10/2048 01/03/2049 25/01/2050 01/04/2033 01/06/2033 01/07/2033 01/04/2034 01/04/2034 01/10/2035 01/10/2035 01/03/2035 01/04/2035 01/06/2035 01/06/2035 01/06/2035 01/06/2035 01/06/2035	13.675 26.091 42.430 44.733 56.239 60.631 516.807 316.150 34.475 41.084 1.995 592 23.899 35.183 62.663 7.013 6.125 23.594 19.390 7.784 8.800 6.470 27.109 59.123 11.462	0,02 0,03 0,05 0,06 0,07 0,08 0,40 0,05 0,00 0,00 0,03 0,04 0,01 0,01 0,01 0,01 0,01 0,01 0,01
283.598 331.792 331.321 392.962 481.954 314.686 33.372 39.685 562 22.649 33.551 59.417 6.674 5.795 22.440 18.443 7.363 8.427 6.124 25.727 54.221 10.945 28.357	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC) Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,689 % 5,911 % 5,911 % 5,918 % 4,500 % 1,792 % 1,538 % 2,278 % 2,391 % 2,533 % 1,838 % 2,235 % 1,933 % 2,321 % 1,984 % 2,046 % 2,185 % 1,774 % 2,385 % 2,000 %	15/09/2037 15/05/2041 15/09/2043 15/05/2046 25/10/2048 01/03/2049 25/01/2050 01/04/2033 01/06/2033 01/07/2033 01/04/2034 01/10/2034 01/11/2034 01/11/2034 01/10/2035 01/03/2035 01/05/2035 01/05/2035 01/05/2035 01/06/2035 01/08/2035	13.675 26.091 42.430 44.733 56.239 60.631 516.807 316.150 34.475 41.084 1.995 592 23.899 35.183 62.663 7.013 6.125 23.594 19.390 7.784 8.800 6.470 27.109 59.123	0,02 0,03 0,05 0,06 0,07 0,08 0,66 0,40 0,05 0,00 0,03 0,04 0,08 0,01 0,01 0,03 0,02 0,02 0,01

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
-	con garantía de activos emitidos o garantizados por agencias – ss – (continuación)	(continuación)				
	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	4.500 %	01/08/2041	26.957	0,03
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	6,458 %	25/12/2041	46.918	0,06
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(c)</sup>	USD	6,578 %	25/07/2042	37.832	0,05
	Federal National Mortgage Association (FNMA) <sup>(c)</sup>	USD	6,508 %	25/02/2044	62.757	0,03
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	5,482 %	25/05/2045	58.435	0,07
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	6,058 %	25/11/2047	67.648	0,09
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	5,908 %	25/01/2050	70.596	0,09
506.757	Federal National Mortgage Association (FNMA)	USD	2,000 %	25/09/2050	49.289	0,06
2.000.000	Federal National Mortgage Association (FNMA) TBA <sup>(g)</sup>	USD	5,000 %	13/12/2051	2.190.310	2,78
161.779	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,059 %	20/04/2043	21.030	0,03
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,009 %	20/06/2043	110.084	0,14
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,059 %	20/07/2043	19.649	0,03
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,509 %	20/08/2044	119.499	0,15
		USD	4,000 %	20/08/2045		0,06
	Government National Mortgage Association (GNMA)				44.300	
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,109 %	20/08/2045	29.461	0,04
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,629 %	20/09/2045	29.380	0,04
303.529	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/10/2045	34.872	0,04
152.722	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,609 %	20/10/2045	25.988	0,03
575.517	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/11/2045	46.223	0,06
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,109 %	20/06/2048	59.297	0,08
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,059 %	20/10/2048	122.315	0,16
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,109 %	20/10/2048	147.212	0,19
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	5,000 %	20/12/2048	771.440	0,13
		USD				
	Government National Mortgage Association (GNMA)		4,500 %	20/01/2049	333.584	0,42
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/03/2049	791.573	1,01
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,959 %	20/08/2049	49.870	0,06
1.105.796	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,959 %	20/09/2049	187.039	0,24
937.889	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/10/2049	85.370	0,11
1.924.738	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/12/2049	266.408	0,34
336.350	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,500 %	20/12/2049	357.607	0,45
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	5,959 %	20/02/2050	38.809	0,05
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	3,500 %	20/04/2050	63.194	0,08
		USD	5,959 %	20/04/2050	51.597	0,00
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)					
	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	4,000 %	20/06/2050	20.320	0,03
	Government National Mortgage Association (GNMA)(c)	USD	6,059 %	20/06/2050	120.369	0,15
1.401.365	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	2,500 %	20/10/2050	136.989	0,18
202.332	Government National Mortgage Association (GNMA)	USD	2,500 %	20/11/2050	10.110	0,01
					0.227.004	
					8.337.081	10,60
TOTAL DE OBI POR AGENCIA (coste USD 8.4		oos			8.337.081	10,60
POR AGENCIA (coste USD 8.4	AS					
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Obligaciones Islas Caimán	AS 196.396)		1,424 %	15/01/2033	-	10,60
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Obligaciones Islas Caimán 700.000	AS 196.396) con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A <sup>(c)(f)</sup>	as – 12,41 % USD			<b>8.337.081</b> 700.601	<b>10,60</b>
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Obligaciones Islas Caimán 700.000 700.000	AS 196.396)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia  AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(c)(f)  Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(c)(f)	usD USD	3,374 %	23/10/2034	8.337.081 700.601 696.648	<b>10,60</b> 0,89 0,89
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Obligaciones Islas Caimán 700.000 700.000 300.000	AS (196.396)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia  AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(°)(f)  Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(°)(f)  Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(°)	usd USD USD USD	3,374 % 1,412 %	23/10/2034 20/01/2032	700.601 696.648 300.423	0,89 0,89 0,38
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Obligaciones Islas Caimán 700.000 700.000 300.000 1.100.000	AS (196.396)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia  AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(°)(f)  Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(°)(f)  Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(°)(f)  Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(°)(f)	us – 12,41 % USD USD USD USD	3,374 % 1,412 % 1,432 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033	700.601 696.648 300.423 1.100.975	0,89 0,89 0,38 1,40
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Obligaciones Islas Caimán 700.000 700.000 300.000 1.100.000 150.000	AS (196.396)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia  AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(°)(f)  Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(°)(f)  Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(°)(f)  Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(°)(f)  MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(°)(f)	USD USD USD USD USD USD USD USD USD	3,374 % 1,412 % 1,432 % 1,189 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033 16/07/2036	700.601 696.648 300.423 1.100.975 149.997	0,89 0,89 0,38 1,40 0,19
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Obligaciones Islas Caimán 700.000 300.000 1.100.000 150.000 600.000	AS 196.396)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia  AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(c)(f) Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(c)(f) Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(f) Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(c)(f) MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(c)(f) Mountain View CLO LLC 2016-1A "AR" 144A(c)(f)	USD	3,374 % 1,412 % 1,432 % 1,189 % 1,487 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033 16/07/2036 14/04/2033	700.601 696.648 300.423 1.100.975 149.997 600.395	0,89 0,89 0,38 1,40 0,19 0,76
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Obligaciones Islas Caimán 700.000 300.000 1.100.000 150.000 600.000	AS (196.396)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia  AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(°)(f)  Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(°)(f)  Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(°)(f)  Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(°)(f)  MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(°)(f)	USD USD USD USD USD USD USD USD USD	3,374 % 1,412 % 1,432 % 1,189 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033 16/07/2036	700.601 696.648 300.423 1.100.975 149.997	0,89 0,89 0,38 1,40 0,19 0,76
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Obligaciones Islas Caimán 700.000 700.000 300.000 1.100.000 150.000 600.000 400.000	AS 196.396)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia  AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(c)(f) Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(c)(f) Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(f) Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(c)(f) MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(c)(f) Mountain View CLO LLC 2016-1A "AR" 144A(c)(f)	USD	3,374 % 1,412 % 1,432 % 1,189 % 1,487 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033 16/07/2036 14/04/2033	700.601 696.648 300.423 1.100.975 149.997 600.395 397.690 795.348	0,89 0,89 0,38 1,40 0,19 0,76 0,51 1,01
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Obligaciones Islas Caimán 700.000 300.000 1.100.000 150.000 600.000 400.000 800.000	AS 196.396)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia  AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(c)(f) Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(c)(f)  Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(f)  Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(c)(f)  MFI Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(c)(f)  Mountain View CLO LLC 2016-1A "AR" 144A(c)(f)  Ocean Trails CLO IX 2020-9A "DR" 144A(c)(f)	USD	3,374 % 1,412 % 1,432 % 1,189 % 1,487 % 3,874 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033 16/07/2036 14/04/2033 15/10/2034	700.601 696.648 300.423 1.100.975 149.997 600.395 397.690	
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Obligaciones Islas Caimán 700.000 300.000 1.100.000 150.000 600.000 400.000 800.000	AS (196.396)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia  AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(c)(f)  Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(c)(f)  Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(f)  Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(c)(f)  MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(c)(f)  Mountain View CLO LLC 2016-1A "AR" 144A(c)(f)  Ocean Trails CLO IX 2020-9A "DR" 144A(c)(f)  Trinitas CLO XVII 2021-17A Ltd. "D" 144A(c)(f)	USD	3,374 % 1,412 % 1,432 % 1,189 % 1,487 % 3,874 % 3,613 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033 16/07/2036 14/04/2033 15/10/2034 20/10/2034	8.337.081 700.601 696.648 300.423 1.100.975 149.997 600.395 397.690 795.348 4.742.077	0,89 0,89 0,38 1,40 0,19 0,76 0,51 1,01
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Obligaciones Islas Calmán 700.000 300.000 1.100.000 150.000 400.000 800.000	AS (196.396)  Con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(c)(f) Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(c)(f) Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(f) Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(c)(f) MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(c)(f) Mountain View CLO LLC 2016-1A "AR" 144A(c)(f) Ocean Trails CLO IX 2020-9A "DR" 144A(c)(f) Trinitas CLO XVII 2021-17A Ltd. "D" 144A(c)(f)	us - 12,41 %  USD  USD  USD  USD  USD  USD  USD  US	3,374 % 1,412 % 1,432 % 1,189 % 1,487 % 3,874 % 3,613 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033 16/07/2036 14/04/2033 15/10/2034 20/10/2034	8.337.081 700.601 696.648 300.423 1.100.975 149.997 600.395 397.690 795.348 4.742.077	0,89 0,89 0,38 1,40 0,19 0,76 0,51 1,01 6,03
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Obligaciones Islas Calmán 700.000 300.000 1.100.000 150.000 400.000 800.000	AS (196.396)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia  AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(c)(f)  Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(c)(f)  Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(f)  Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(c)(f)  MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(c)(f)  Mountain View CLO LLC 2016-1A "AR" 144A(c)(f)  Ocean Trails CLO IX 2020-9A "DR" 144A(c)(f)  Trinitas CLO XVII 2021-17A Ltd. "D" 144A(c)(f)	USD	3,374 % 1,412 % 1,432 % 1,189 % 1,487 % 3,874 % 3,613 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033 16/07/2036 14/04/2033 15/10/2034 20/10/2034	8.337.081  700.601 696.648 300.423 1.100.975 149.997 600.395 397.690 795.348 4.742.077  620.862 931.184	0,89 0,89 0,38 1,40 0,19 0,76 0,51 1,01 6,03
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Coste USD 8.4 Cos	AS (196.396)  Con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(c)(f) Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(c)(f) Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(f) Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(c)(f) MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(c)(f) Mountain View CLO LLC 2016-1A "AR" 144A(c)(f) Ocean Trails CLO IX 2020-9A "DR" 144A(c)(f) Trinitas CLO XVII 2021-17A Ltd. "D" 144A(c)(f)	us - 12,41 %  USD  USD  USD  USD  USD  USD  USD  US	3,374 % 1,412 % 1,432 % 1,189 % 1,487 % 3,874 % 3,613 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033 16/07/2036 14/04/2033 15/10/2034 20/10/2034	8.337.081 700.601 696.648 300.423 1.100.975 149.997 600.395 397.690 795.348 4.742.077	0,89 0,89 0,38 1,40 0,19 0,76 0,51 1,01
POR AGENCIA (coste USD 8.4 (coste USD 8.4 (coste USD 8.4 Obligaciones Islas Caimán 700.000 700.000 1.100.000 1.100.000 600.000 400.000 800.000    Irlanda 574.363 843.681    Reino Unido	AS (196.396)  Con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(c)(f) Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(c)(f) Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(f) Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(c)(f) MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(c)(f) Mountain View CLO LLC 2016-1A "AR" 144A(c)(f) Ocean Trails CLO IX 2020-9A "DR" 144A(c)(f) Trinitas CLO XVII 2021-17A Ltd. "D" 144A(c)(f)	us - 12,41 %  USD  USD  USD  USD  USD  USD  USD  US	3,374 % 1,412 % 1,432 % 1,189 % 1,487 % 3,874 % 3,613 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033 16/07/2036 14/04/2033 15/10/2034 20/10/2034	8.337.081  700.601 696.648 300.423 1.100.975 149.997 600.395 397.690 795.348 4.742.077  620.862 931.184	0,89 0,89 0,38 1,40 0,19 0,76 0,51 1,01 6,03
POR AGENCIA (coste USD 8.4 (coste US	AS (196.396)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(°)(f) Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(°)(f) Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(°)(f) Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(°)(f) MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(°)(f) Mountain View CLO LLC 2016-1A "AR" 144A(°)(f) Ocean Trails CLO IX 2020-9A "DR" 144A(°)(f) Trinitas CLO XVII 2021-17A Ltd. "D" 144A(°)(f)  Magnolia Finance XI DAC 2018-3MGN "A"(°) Octagon Finance No 1 DAC "A"(°)	USD	3,374 % 1,412 % 1,432 % 1,189 % 1,487 % 3,874 % 3,613 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033 16/07/2036 14/04/2033 15/10/2034 20/10/2034	8.337.081  700.601 696.648 300.423 1.100.975 149.997 600.395 397.690 795.348 4.742.077  620.862 931.184 1.552.046	0,89 0,89 0,38 1,40 0,19 0,76 0,51 1,01 6,03
POR AGENCIA (coste USD 8.4 (coste US	AS (196.396)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(c)(f) Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(c)(f) Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(f) Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(c)(f) MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(c)(f) Mountain View CLO LLC 2016-1A "AR" 144A(c)(f) Ocean Trails CLO IX 2020-9A "DR" 144A(c)(f) Trinitas CLO XVII 2021-17A Ltd. "D" 144A(c)(f)  Magnolia Finance XI DAC 2018-3MGN "A"(c) Octagon Finance No 1 DAC "A"(c)	USD	3,374 % 1,412 % 1,432 % 1,189 % 1,487 % 3,874 % 3,613 %  2,750 % 1,809 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033 16/07/2036 14/04/2033 15/10/2034 20/10/2034 20/10/2025 17/01/2023	8.337.081  700.601 696.648 300.423 1.100.975 149.997 600.395 397.690 795.348 4.742.077  620.862 931.184 1.552.046	0,89 0,89 0,38 0,38 1,40 0,19 0,76 0,51 1,01 6,03 0,79 1,18
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Coste USD 8.4 Cost USD 8.4 Coste USD 8.4 Cost	AS (196.396)  Con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(c)(f) Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(c)(f) Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(f) Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(c)(f) MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(c)(f) MOuntain View CLO LLC 2016-1A "AR" 144A(c)(f) Ocean Trails CLO IX 2020-9A "DR" 144A(c)(f) Trinitas CLO XVII 2021-17A Ltd. "D" 144A(c)(f)  Magnolia Finance XI DAC 2018-3MGN "A"(c) Octagon Finance No 1 DAC "A"(c)  Red 2 Finance CLO 2018-1 DAC	USD	3,374 % 1,412 % 1,432 % 1,189 % 1,487 % 3,874 % 3,613 %  2,750 % 1,809 %  0,000 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033 16/07/2036 14/04/2033 15/10/2034 20/10/2034 20/10/2025 17/01/2023	8.337.081  700.601 696.648 300.423 1.100.975 149.997 600.395 397.690 795.348 4.742.077  620.862 931.184 1.552.046 651.276	0,89 0,89 0,38 1,40 0,19 0,76 0,51 1,01 6,03 0,79 1,18 1,97
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Coste USD 8.4 Cost USD 8.4 Coste USD 8.4 Cost	AS (196.396)  Con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(c)(f) Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(c)(f) Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(f) Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(c)(f) MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(c)(f) Mountain View CLO LLC 2016-1A "AR" 144A(c)(f) Ocean Trails CLO IX 2020-9A "DR" 144A(c)(f) Trinitas CLO XVII 2021-17A Ltd. "D" 144A(c)(f)  Magnolia Finance XI DAC 2018-3MGN "A"(c) Octagon Finance No 1 DAC "A"(c)  Red 2 Finance CLO 2018-1 DAC  DS Banc of America Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 "D" 144A(f) Bank 2018-BNK13 "D" 144A(f)	USD	3,374 % 1,412 % 1,432 % 1,189 % 1,487 % 3,874 % 3,613 %  2,750 % 1,809 %  0,000 %  3,000 % 3,000 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033 16/07/2036 14/04/2033 15/10/2034 20/10/2034 20/10/2025 17/01/2023 20/01/2028	8.337.081  700.601 696.648 300.423 1.100.975 149.997 600.395 397.690 795.348 4.742.077  620.862 931.184 1.552.046 651.276  139.141 86.815	0,89 0,89 0,38 1,40 0,19 0,76 0,51 1,01 6,03 0,79 1,18 1,97
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Coste USD 8.4 Cost USD 8.4 Coste USD 8.4 Cost	AS (196.396)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(°)(f) Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(°)(f) Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(°)(f) Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(°)(f) MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(°)(f) Mountain View CLO LLC 2016-1A "AR" 144A(°)(f) Ocean Trails CLO IX 2020-9A "DR" 144A(°)(f) Trinitas CLO XVII 2021-17A Ltd. "D" 144A(°)(f)  Magnolia Finance XI DAC 2018-3MGN "A"(°) Octagon Finance No 1 DAC "A"(°)  Red 2 Finance CLO 2018-1 DAC  DS Banc of America Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 "D" 144A(f) BBCMS Mortgage Trust 2017-C1 "D" 144A(°)(f)	USD	3,374 % 1,412 % 1,432 % 1,189 % 1,487 % 3,874 % 3,613 %  2,750 % 1,809 %  0,000 %  3,000 % 3,000 % 3,000 % 3,659 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033 16/07/2036 14/04/2033 15/10/2034 20/10/2034 20/10/2025 17/01/2023 20/01/2028	8.337.081  700.601 696.648 300.423 1.100.975 149.997 600.395 397.690 795.348 4.742.077  620.862 931.184 1.552.046  651.276  139.141 86.815 138.829	10,60 0,89 0,89 0,38 1,40 0,19 0,76 0,51 1,01 6,03 0,79 1,18 1,97 0,83
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Coste USD 8.4 Cost USD 8.4 Coste USD 8.4 Cost	AS (196.396)  con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia (196.396)  AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(°)(f) Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(°)(f) Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(°)(f) Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(°)(f) MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(°)(f) Mountain View CLO LLC 2016-1A "AR" 144A(°)(f) Ocean Trails CLO IX 2020-9A "DR" 144A(°)(f) Trinitas CLO XVII 2021-17A Ltd. "D" 144A(°)(f)  Magnolia Finance XI DAC 2018-3MGN "A"(°) Octagon Finance No 1 DAC "A"(°)  Red 2 Finance CLO 2018-1 DAC  DS Banc of America Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 "D" 144A(f) Bank 2018-BNK13 "D" 144A(f) BBCMS Mortgage Trust 2017-C1 "D" 144A(°)(f) CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C6 "D" 144A(°)(f)	USD	3,374 % 1,412 % 1,432 % 1,189 % 1,487 % 3,874 % 3,613 %  2,750 % 1,809 %  0,000 %  3,000 % 3,000 % 3,659 % 4,338 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033 16/07/2036 14/04/2033 15/10/2034 20/10/2034 20/10/2025 17/01/2023 20/01/2028 15/07/2049 15/08/2061 15/02/2050 10/11/2049	8.337.081  700.601 696.648 300.423 1.100.975 149.997 600.395 397.690 795.348 4.742.077  620.862 931.184 1.552.046  651.276  139.141 86.815 138.829 136.987	0,89 0,89 0,38 1,40 0,19 0,76 0,51 1,01 6,03 0,79 1,18 1,97
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Coste USD 8.4 Cost USD 8.4 Coste USD 8.4 Cost	AS (196.396)  Con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia (196.396)  AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(°)(f) Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(°)(f) Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(°)(f) Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(°)(f) MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(°)(f) MOuntain View CLO LLC 2016-1A "AR" 144A(°)(f) Ocean Trails CLO IX 2020-9A "DR" 144A(°)(f) Trinitas CLO XVII 2021-17A Ltd. "D" 144A(°)(f)  Magnolia Finance XI DAC 2018-3MGN "A"(°) Octagon Finance No 1 DAC "A"(°)  Red 2 Finance CLO 2018-1 DAC  DS  Banc of America Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 "D" 144A(f) BBCMS Mortgage Trust 2017-C1 "D" 144A(°)(f) CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C6 "D" 144A(°)(f) Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(f)	USD	3,374 % 1,412 % 1,432 % 1,189 % 1,487 % 3,874 % 3,613 %  2,750 % 1,809 %  0,000 %  3,000 % 3,000 % 3,659 % 4,338 % 3,000 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033 16/07/2036 14/04/2033 15/10/2034 20/10/2034 20/10/2025 17/01/2023 20/01/2028 15/07/2049 15/08/2061 15/02/2050 10/11/2049 15/09/2050	8.337.081  700.601 696.648 300.423 1.100.975 149.997 600.395 397.690 795.348 4.742.077  620.862 931.184 1.552.046  651.276  139.141 86.815 138.829 136.987 91.010	0,89 0,89 0,89 0,38 1,40 0,19 0,76 0,51 1,01 6,03 0,79 1,18 1,97 0,83
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Coste USD 8.4 Cost USD 8.4 Coste USD 8.4 Cost	AS (196.396)  Con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia (196.396)  AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(c)(f) Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(c)(f) Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(f) Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(c)(f) MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(c)(f) MOUNTAIN VIEW CLO LLC 2016-1A "AR" 144A(c)(f) Ocean Trails CLO IX 2020-9A "DR" 144A(c)(f) Trinitas CLO XVII 2021-17A Ltd. "D" 144A(c)(f)  Magnolia Finance XI DAC 2018-3MGN "A"(c) Octagon Finance No 1 DAC "A"(c)  Red 2 Finance CLO 2018-1 DAC  DS Banc of America Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 "D" 144A(f) BBCMS Mortgage Trust 2017-C1 "D" 144A(c)(f) CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C6 "D" 144A(c)(f) Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(f) Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(f) CitidMortgage Alternative Loan Trust Series 2006-A7 "1A1"(c)	USD	3,374 % 1,412 % 1,432 % 1,189 % 1,487 % 3,613 %  2,750 % 1,809 %  0,000 %  3,000 % 3,000 % 3,659 % 4,338 % 3,000 % 6,000 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033 16/07/2036 14/04/2033 15/10/2034 20/10/2034 20/10/2025 17/01/2023 20/01/2028 15/07/2049 15/08/2061 15/02/2050 10/11/2049	8.337.081  700.601 696.648 300.423 1.100.975 149.997 600.395 397.690 795.348 4.742.077  620.862 931.184 1.552.046  651.276  139.141 86.815 138.829 136.987	0,89 0,89 0,38 1,40 0,19 0,76 0,51 1,01 6,03 0,79 1,18 1,97 0,83 0,18 0,11 0,18 0,17 0,12 0,12
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Coste USD 8.4 Cost USD 8.4 Coste USD 8.4 Cost	AS (196.396)  Con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia (196.396)  AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(°)(f) Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(°)(f) Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(°)(f) Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(°)(f) MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(°)(f) MOuntain View CLO LLC 2016-1A "AR" 144A(°)(f) Ocean Trails CLO IX 2020-9A "DR" 144A(°)(f) Trinitas CLO XVII 2021-17A Ltd. "D" 144A(°)(f)  Magnolia Finance XI DAC 2018-3MGN "A"(°) Octagon Finance No 1 DAC "A"(°)  Red 2 Finance CLO 2018-1 DAC  DS  Banc of America Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 "D" 144A(f) BBCMS Mortgage Trust 2017-C1 "D" 144A(°)(f) CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C6 "D" 144A(°)(f) Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(f)	USD	3,374 % 1,412 % 1,432 % 1,189 % 1,487 % 3,874 % 3,613 %  2,750 % 1,809 %  0,000 %  3,000 % 3,000 % 3,659 % 4,338 % 3,000 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033 16/07/2036 14/04/2033 15/10/2034 20/10/2034 20/10/2025 17/01/2023 20/01/2028 15/07/2049 15/08/2061 15/02/2050 10/11/2049 15/09/2050	8.337.081  700.601 696.648 300.423 1.100.975 149.997 600.395 397.690 795.348 4.742.077  620.862 931.184 1.552.046  651.276  139.141 86.815 138.829 136.987 91.010	0,89 0,89 0,38 1,40 0,19 0,76 0,51 1,01 6,03 0,79 1,18 1,97 0,83 0,18 0,11 0,18 0,17 0,12 0,12
POR AGENCIA (coste USD 8.4 Coste USD 8.4 Cost USD 8.4 Coste USD 8.4 Cost	AS (196.396)  Con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencia (196.396)  AGL CLO 3 Ltd. 2020-3A "A" 144A(c)(f) Bain Capital Credit CLO 2020-3A Ltd. "DR" 144A(c)(f) Marble Point CLO XIV Ltd. 2018-2A "A1R" 144A(c)(f) Marble Point CLO XVII 2020-1A Ltd. "A" 144A(c)(f) MF1 Ltd. 2021-FL6 "A" 144A(c)(f) MOUNTAIN VIEW CLO LLC 2016-1A "AR" 144A(c)(f) Ocean Trails CLO IX 2020-9A "DR" 144A(c)(f) Trinitas CLO XVII 2021-17A Ltd. "D" 144A(c)(f)  Magnolia Finance XI DAC 2018-3MGN "A"(c) Octagon Finance No 1 DAC "A"(c)  Red 2 Finance CLO 2018-1 DAC  DS Banc of America Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 "D" 144A(f) BBCMS Mortgage Trust 2017-C1 "D" 144A(c)(f) CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C6 "D" 144A(c)(f) Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(f) Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 "D" 144A(f) CitidMortgage Alternative Loan Trust Series 2006-A7 "1A1"(c)	USD	3,374 % 1,412 % 1,432 % 1,189 % 1,487 % 3,613 %  2,750 % 1,809 %  0,000 %  3,000 % 3,000 % 3,659 % 4,338 % 3,000 % 6,000 %	23/10/2034 20/01/2032 20/04/2033 16/07/2036 14/04/2033 15/10/2034 20/10/2034 20/10/2025 17/01/2023 20/01/2028 15/07/2049 15/08/2061 15/02/2050 10/11/2049 15/09/2050 25/12/2036	8.337.081  700.601 696.648 300.423 1.100.975 149.997 600.395 397.690 795.348 4.742.077  620.862 931.184 1.552.046 651.276  139.141 86.815 138.829 136.987 91.010 93.555	0,89 0,89 0,38 1,40 0,19 0,76 0,51 1,01 6,03

Displace						Valor de	
Setados   Continuación	Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	mercado en USD	% del patrimonio
10.951 Commerciated Annew Securities Trust 2019-R01 (TMZ *144A-R070	-		continuació	n)			
Capa   Commentical Avenues Securities Triats 2009-R01* *1M0** 144AR****   USD   2.142 %   50910200		The state of the s	1100	0.040.0/	05/00/0004	40.000	2.24
150.000 CSMC 2014-L9A CA LLC "E" 14AM"   USD   3.48 % 1009602   15.550   0.17   10.0000 DM   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.000   10.0000   10.000   10.0000   10.0000   10.0000   10.0000   10.0000   10.0000   10.0000   10.0000   10.0000   10.0000   10.0000   10.0000   10.0000   10.0000   10.0000   10.0000   10.0000   10.0000				,			
100000 DBJMM Mortgage Trust FG-CT DT 144A(FG)***				,			
16 1070 C MACON Home Equity Loan Trust 2007HE 3*2A*1**********************************							
2,942   Imply Note   INDX Mortgage Learn Trust 2004 APR 1 1 Am 0		* *					
100.000		·					
\$3,0217   Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-W1, "2-MA*"   USD   0,682 %   2501/2038   613.195   0,78     \$1,000.00   Morgan Stanley Bank of America Merrill Loan Trust 2005-4 (A)4"   USD   0,244 %   2501/2021   30,555   0,41     \$1,171.14   SLM Student Loan Trust 2005-4 (A)4"   USD   0,244 %   2501/2021   30,555   0,41     \$1,3384   Structured Algustable Rate Mortgage Loan Trust Series 2006-12 "2A1"   USD   3,744 %   2501/2039   136.722   0,18     \$1,510.00   Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C42 "D 144.44*********************************				•			
100,000   Morgan Stanlery Samk of America Merrill Lynch Trust 2017-C34**[7" 1444**]		* *					
1717-14   SLM Student Loan Trust 2006-14 As "0"   USD   0,244 %   25011/2007   176 83   0,04		•					
319.210   SLM Sludent Loan Trust 2008-3 "A39"   0.41   1.32 48   25102021   320.559   0.41   1.33 48   510000   0.51   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32 48   1.32		· · ·					-
133.94 SINULITURA Alguisable Rate Mortgage Loan Trust Series 2006-12 "241" USD 3,744 % 2801/2037 120.762 0,15 151.000 Wells Farigo Commercial Mortgage Trust 2017-C42 "D" 144A/8/9/10 USD 2,800 % 15/12/2059 135.402 0,17 2,815.900 USD 15/10/2009 135.402 0,17 2,815.900 USD 15/10/2009 135.402 0,17 2,815.900 USD 2,800 % 15/12/2059 135.402 0,17 2,815.900 USD 2,810 WINDOWS NO CARRANTIA DE ACTIVOS NO EMITIDOS NI GARANTIZADOS POR AGENCIAS (Construint VIII AND ASSAULT V							
151,000   Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-LC26 TO *144A(MIX)							
150.000   Wells Fairgo Commercial Mortgage Trust 2017-C42 °D 144 Ale Mortgage Trust		the state of the s		•			
TOTAL DE OBLIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS NO EMITIDOS NI CARANTIZADOS POR AGENCIAS (COSTO USD 49.4575)   3.762.85   12.41	150.000	Wells Falgo Collinercial Moltgage Trust 2017-042 D 144A(5)(7)	030	2,800 %	15/12/2050		
SAPANTIZADOS POR AGENCIAS						2.816.986	3,58
Cooke USD 26.384.285    28.717.816   32.680						9.762.385	12,41
Otros valores mobiliarios           Bonos - 0,07 %         Setadaos Unidos           50.000 Novelis Corp. 144A/™         USD 4,750 % 30/01/2030 50.750 0,07           TOTAL DE BONOS (coste USD 50.000)         \$5.0.750 0,07           TOTAL DE OTROS VALORES MOBILIARIOS (coste USD 50.000)         \$50.750 0,07           Cordificados de depósito - 2,54 %         USD 0,000 % 06/12/2021 1,999.995 2,54           Estados Unidos 2 (coste USD 50.000)         USD 0,000 % 06/12/2021 1,999.995 2,54           TOTAL DE CERTIFICADOS DE DEPÓSITO (coste USD 50.000 12)         1,999.995 2,54           Efectos comerciales - 6,66 %         USD 0,000 % 02/11/2022 1 1,999.995 2,54           Estados Unidos 2 (coste USD 50.000 Ciligroup Global Markets, Inc. USD 0,000 % 02/11/2022 1 1,499.895 1,391 1,500.000 Pidelity National Information Services USD 0,000 % 16/02/2022 1 1,499.895 1,391 1,500.000 VW GR, Inc. USD 0,000 % 16/02/2022 1 1,499.895 1,391 1,500.000 VW GR, Inc. USD 0,000 % 16/02/2022 1 1,499.895 1,391 1,500.000 VW GR, Inc. USD 0,000 % 16/02/2022 1 1,499.895 1,391 1,500.000 VW GR, Inc. USD 0,000 % 16/02/2022 1 1,499.895 1,391 1,500.000 VW GR, Inc. USD 0,000 % 16/02/2022 1 1,499.895 1,391 1,500.000 VW GR, Inc. USD 0,000 % 16/02/2022 1 1,499.895 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,391 1,3						25.717.816	32.69
Bono	<u> </u>	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·				20.7 17.010	02,00
S0.000   Novelis Corp. 144Al <sup>(1)</sup>							
TOTAL DE BONOS (coste USD 50.000)   50.750   0.007	Estados Unido	s					
Solution	50.000	Novelis Corp. 144A <sup>(f)</sup>	USD	4,750 %	30/01/2030	50.750	0,07
TOTAL DE OTROS VALORES MOBILIARIOS (coste USD 50.000)   50.750   0.007						50.750	0,07
Sestados Unidos   2,000,000   Svenska Handelsbanken AB	TOTAL DE OTE	ROS VALORES MOBILIARIOS				50.750	0.07
Estados Unidos   2.000.000   Svenska Handelsbanken AB	<del>-</del>	<u>. '</u>				50.750	0,07
2.000.000   Svenska Handelsbanken AB	Certificados o	de deposito - 2,54 %					
	Estados Unido	s					
	2.000.000	Svenska Handelsbanken AB	USD	0,000 %	06/12/2021	1.999.995	2,54
Stados Unidos						1.999.995	2,54
2.000.000   Citigroup Global Markets, Inc.	Efectos come	erciales – 6,66 %					
2.000.000   Citigroup Global Markets, Inc.							
1.500.000   Fidelity National Information Services   USD   0,000 %   02/12/2021   1.499.989   1.91     1.500.000   VW CR, Inc.   USD   0,000 %   16/02/2022   1.499.295   1.90     250.000   Walt Disney Co.   USD   0,000 %   15/06/2022   249.663   0.32     5.242.429   6.66     TOTAL DE EFECTOS COMERCIALES (coste USD 5.244.268)			HOD	0.000.0/	04/40/0000	4 000 400	0.50
1.500.000 VW CR, Inc. 250.000 Walt Disney Co.  USD 0,000 % 15/06/2022 1.499.295 1,90 0,000 % 15/06/2022 249.663 0,32  5.242.429 6,66  TOTAL DE EFECTOS COMERCIALES (coste USD 5.244.268)  VALOR DE MERCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD 80.627.221)  Contratos de futuros – (0,32 %)  Número de contratos  Descripción del valor  USD 17 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Larga 19.135.125 221.322 0,28 19.000 % 16/02/2022 1.499.295 1.90 0,000 % 15/06/2022 249.663 0,32 249.663 0,32 249.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,32 240.666 0,				.,			
250.000   Walt Disney Co.   USD   0,000 %   15/06/2022   249.663   0,32		•					
TOTAL DE EFECTOS COMERCIALES (coste USD 5.244.268)   5.242.429   6,66							
TOTAL DE EFECTOS COMERCIALES (coste USD 5.244.268)   5.242.429   6,66	250.000	wall disfley co.	050	0,000 %	15/06/2022		
(coste USD 5.244.268)         5.242.429         6,66           VALOR DE MERCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD 80.627.221)         77.017.140         97,90           Contratos de futuros – (0,32 %)         Valor de mercado de la asignación en USD         Plusvalía latente en USD         % del patrimonio           USD         17 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022         Larga         2.753.469         67.038         0.09           146 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022         Larga         19.135.125         221.322         0.28           21.888.594         288.360         0.37						5.242.429	6,66
(coste USD 80.627.221)         77.017.140         97,90           Contratos de futuros – (0,32 %)         Valor de mercado de la asignación en USD         Plusvalía latente en USD         % del patrimonio           USD         17 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022         Larga         2.753.469         67.038         0.09           146         Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022         Larga         19.135.125         221.322         0.28           21.888.594         288.360         0.37						5.242.429	6,66
Número de contratos         Descripción del valor         Valor de mercado de la asignación del valor         Plusvalía latente en USD         % del patrimonio           17 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022         Larga         2.753.469         67.038         0,09           146 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022         Larga         19.135.125         221.322         0,28           21.888.594         288.360         0,37						77.017.140	97,90
Número de contratos         Descripción del valor         Valor de mercado de la asignación del valor         Plusvalía latente en USD         % del patrimonio           17 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022         Larga         2.753.469         67.038         0,09           146 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022         Larga         19.135.125         221.322         0,28           21.888.594         288.360         0,37	Contratas	futures (0.23.9/)					
Número de contratos         Descripción del valor         de la asignación en USD         latente en USD         % del patrimonio           17         Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022         Larga         2.753.469         67.038         0,09           146         Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022         Larga         19.135.125         221.322         0,28           21.888.594         288.360         0,37	Contratos de	TULUTUS - (U,32 %)			Water da ma	N	
USD 17 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022 Larga 2.753.469 67.038 0,09 146 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022 Larga 19.135.125 221.322 0,28 21.888.594 288.360 0,37	Número de				de la asignación	latente	
17 Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022       Larga       2.753.469       67.038       0,09         146 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022       Larga       19.135.125       221.322       0,28         21.888.594       288.360       0,37	contratos	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·			en USD	en USD	patrimonio
146 Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022     Larga     19.135.125     221.322     0,28       21.888.594     288.360     0,37				1	0.750.400	67.000	0.00
21.888.594 288.360 0,37		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		_			
	146	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/2022		Larga –			
PLUSVALIA LATENTÉ SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS 288.360 0,37							
	PLUSVALIA LA	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS			:	288.360	0,37

Contratos de futuros -	(continuación)
------------------------	----------------

mero de itratos	Descripción del valor		Valor de mercado de la asignación en USD	Minusvalía latente en USD	% del patrimonio
	EUR				
(1)	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años 08/12/2021	Corta	(196.336)	(967)	(0,00)
(3)	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/12/2021	Corta	(463.014)	(1.729)	(0,01)
			(659.350)	(2.696)	(0,01)
	USD				
(38)	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/2022	Corta	(8.322.891)	(15.858)	(0,02)
(86)	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2022	Corta	(10.465.797)	(88.453)	(0,11)
(19)	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo 22/03/2022	Corta	(3.795.250)	(130.447)	(0,17)
	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a muy largo plazo a 10 años				
(101)	22/03/2022	Corta	(14.845.422)	(302.785)	(0,38)
			(37.429.360)	(537.543)	(0,68)
NUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS			(540.239)	(0,69)

#### Contratos de divisas a plazo – (0,11 %)

Contratos de d	livisas a plazo – (0,11 %	6)			B1 1/	
					Plusvalía latente	% del
Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	en USD	patrimonio
BRL	1.174.795	USD	209.579	02/12/2021	191	0,00
EUR	308.202	PLN	1.421.012	06/12/2021	4.694	0,00
USD	2.102.692	INR	157.074.467	07/12/2021	10.878	0,01
ZAR	17.100.056	USD	1.069.138	09/12/2021	2.146	0,01
USD	55.798	TRY	708.630	10/12/2021	1.916	0,00
USD	80.800	ZAR	1.231.255	13/12/2021	3.709	0,00
USD	432.000	TRY	4.090.176	14/12/2021	121.573	0,15
CAD	1.624.168	EUR	1.091.039	15/12/2021	30.053	0,03
CHF	3.220.533	EUR	3.003.231	15/12/2021	98.872	0,13
CHF	3.353.548	USD	3.659.607	15/12/2021	3.298	0,00
CNH	29.457.705	USD	4.553.613	15/12/2021	67.401	0,07
EUR	121.956	CAD	175.693	15/12/2021	1.227	0,00
EUR	671.651	HUF	245.353.402	15/12/2021	1.708	0,01
EUR	576.807	NZD	953.024	15/12/2021	4.979	0,01
EUR	547.304	PLN	2.516.671	15/12/2021	10.549	0,01
EUR	545.144	SEK	5.501.341	15/12/2021	10.120	0,02
GBP	907.062	EUR	1.062.359	15/12/2021	2.691	0,00
ILS	583.683	EUR	160.800	15/12/2021	2.599	0,00
JPY	78.659.676	EUR	610.899	15/12/2021	3.295	0,00
USD	3.933.581	AUD	5.277.779	15/12/2021	153.141	0,18
USD	7.727.186	CAD	9.745.589	15/12/2021	94.449	0,13
USD	423.414	CZK	9.326.649	15/12/2021	8.173	0,02
USD	18.719.727	EUR	16.027.670	15/12/2021	474.510	0,62
USD	12.779.403	GBP	9.309.958	15/12/2021	339.257	0,44
USD	344.160	HUF	107.489.063	15/12/2021	9.948	0,02
USD	13.601.821	JPY	1.513.735.780	15/12/2021	155.647	0,20
USD	916.420	MXN	18.757.225	15/12/2021	39.041	0,04
USD	3.770.193	NOK	32.298.647	15/12/2021	200.456	0,26
USD	8.205.884	NZD	11.749.263	15/12/2021	172.282	0,22
USD	172.590	PLN	689.950	15/12/2021	4.678	0,01
USD	9.788.819	SEK	84.520.766	15/12/2021	410.081	0,52
USD	422.801	SGD	575.116	15/12/2021	1.111	0,00
USD	647.130	THB	21.676.314	15/12/2021	3.874	0,01
USD	1.876.538	TRY	17.194.873	15/12/2021	572.122	0,73
USD	1.181.085	ZAR	17.521.612	15/12/2021	84.347	0,11
USD	92.675	TRY	1.110.024	20/12/2021	8.663	0,01
USD	36.188	ILS	110.880	21/12/2021	908	0,00
USD	171.621	ILS	538.479	22/12/2021	277	0,00
ILS	1.235.193	USD	389.900	24/12/2021	3.188	0,00
USD	33.816	ILS	104.373	24/12/2021	600	0,00
TWD	11.880.614	USD	429.272	19/01/2022	1.529	0,00
SEK	1.515.480	USD	167.331	20/01/2022	1.056	0,00
USD	95.427	SEK	821.988	20/01/2022	4.095	0,01
USD	1.963.907	GBP	1.436.775	21/01/2022	42.790	0,06
CHF	108.216	USD	115.911	25/01/2022	2.480	0,00
USD	78.061	CHF	71.242	25/01/2022	121	0,00
USD	597.301	NOK	4.982.771	25/01/2022	46.804	0,06
USD	95.682	AUD	132.404	31/01/2022	798	0,00
USD	104.986	CAD	132.934	31/01/2022	839	0,00
USD	332.089	CLP	273.677.604	07/02/2022	6.909	0,01
EUR	213.775	USD	241.119	10/02/2022	2.678	0,00
USD	854.550	KRW	1.012.607.738	10/02/2022	1.176	0,00

Contratos de	e divisas a	a plazo – (	(continuación)
--------------	-------------	-------------	----------------

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	latente en USD	% del patrimonio
USD	240.921	PLN	980.740	10/02/2022	3.227	0,00
USD	594.487	RUB	44.108.889	10/02/2022	8.355	0,01
USD	90.024	NZD	130.416	16/02/2022	930	0,00
USD	863.000	TRY	8.327.518	14/06/2022	291.187	0,37
PLUSVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO					3.533.626	4,49

Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del patrimonio
USD	188.971	BRL	1.069.952	02/12/2021	(2.079)	(0,00)
PLN	295.275	EUR	64.200	06/12/2021	(1.155)	(0,00)
INR	159.268.666	USD	2.150.861	07/12/2021	(29.824)	(0,03)
USD	885.012	ZAR	14.158.859	09/12/2021	(2.012)	(0,00)
ZAR	6.311.394	USD	411.729	13/12/2021	(16.562)	(0,02)
TRY	7.637.550	USD	863.000	14/12/2021	(283.342)	(0,36)
AUD	2.162.574	NZD	2.275.601	15/12/2021	(6.912)	(0,01)
AUD	10.643.881	USD	7.824.533	15/12/2021	(200.386)	(0,23)
CAD	8.012.907	USD	6.374.985	15/12/2021	(99.283)	(0,14)
CZK	10.031.109	EUR	394.912	15/12/2021	(2.946)	(0,00)
CZK	22.178.703	USD	1.026.591	15/12/2021	(39.151)	(0,05)
EUR	545.794	AUD	880.111	15/12/2021	(9.110)	(0,01)
EUR	364.684	CHF	394.603	15/12/2021	(15.863)	(0,02)
EUR	355.942	CZK	9.136.138	15/12/2021	(1.570)	(0,00)
EUR	153.140	GBP	131.428	15/12/2021	(1.288)	(0,00)
EUR	611.474	JPY	80.498.080	15/12/2021	(18.971)	(0,02)
EUR	20.964.733	USD	24.307.778	15/12/2021	(442.429)	(0,57)
GBP	6.848.264	USD	9.341.375	15/12/2021	(190.593)	(0,25)
HUF	260.478.547	EUR	728.363	15/12/2021	(19.239)	(0,03)
HUF	58.589.491	USD	197.360	15/12/2021	(15.189)	(0,02)
JPY	1.293.319.272	USD	11.559.614	15/12/2021	(71.352)	(0,11)
MXN	13.172.847	USD	635.829	15/12/2021	(19.663)	(0,03)
NOK	11.182.318	EUR	1.091.905	15/12/2021	. ,	(0,03)
		USD			(7.077)	,
NOK NZD	19.686.927	USD	2.285.361 11.417.457	15/12/2021 15/12/2021	(109.506)	(0,14)
	16.080.545				(422.323)	(0,54)
PLN	3.224.702	EUR	701.250	15/12/2021	(13.481)	(0,01)
PLN	2.596.307	USD	679.520	15/12/2021	(47.660)	(0,06)
SEK	2.544.730	EUR	254.069	15/12/2021	(6.848)	(0,01)
SEK	77.648.476	USD	8.862.503	15/12/2021	(246.338)	(0,31)
SGD	569.181	USD	422.130	15/12/2021	(4.791)	(0,01)
THB	19.362.513	USD	578.555	15/12/2021	(3.963)	(0,00)
TRY	11.527.253	USD	1.184.596	15/12/2021	(310.131)	(0,39)
USD	5.088.698	CHF	4.676.439	15/12/2021	(19.132)	(0,02)
USD	3.582.292	CNH	23.161.414	15/12/2021	(51.026)	(0,06)
USD	238.329	ILS	763.499	15/12/2021	(4.509)	(0,01)
ZAR	23.083.890	USD	1.543.377	15/12/2021	(98.479)	(0,13)
ILS	938.294	USD	300.031	22/12/2021	(1.465)	(0,00)
INR	13.574.403	USD	180.625	27/12/2021	(128)	(0,00)
USD	1.830.216	TWD	50.699.148	19/01/2022	(8.174)	(0,01)
GBP	952.000	USD	1.279.157	21/01/2022	(6.234)	(0,01)
MXN	1.210.123	USD	57.964	24/01/2022	(1.790)	(0,00)
NOK	2.002.978	USD	233.189	25/01/2022	(11.900)	(0,02)
AUD	401.488	USD	297.325	31/01/2022	(9.607)	(0,01)
CAD	265.868	USD	209.821	31/01/2022	(1.527)	(0,00)
CLP	242.974.420	USD	300.872	07/02/2022	(12.174)	(0,02)
IDR	5.190.397.029	USD	360.544	10/02/2022	(543)	(0,00)
KRW	166.881.365	USD	141.433	10/02/2022	(794)	(0,00)
RUB	43.112.626	USD	596.568	10/02/2022	(23.675)	(0,03)
USD	2.480.468	EUR	2.194.677	10/02/2022	(22.432)	(0,03)
NZD	117.962	USD	82.157	16/02/2022	(1.570)	(0,00)
USD	8.204.452	JPY	944.942.842	25/02/2022	(197.844)	(0,25)
USD	9.396.081	JPY	1.082.134.476	10/03/2022	(227.457)	(0,29)
USD	3.501.523	JPY	403.164.674	25/03/2022	(84.501)	(0,11)
USD	2.302.740	JPY	265.045.171	11/04/2022	(55.230)	(0,07)
TRY	4.528.656	USD	432.000	14/06/2022	(121.037)	(0,15)
MINUSVALÍA LAT	ENTE SOBRE CONTR	ATOS D	E DIVISAS A PLAZO		(3.622.265)	(4,60)

				Fecha	Plusvalía latente	% de
Divisa 	2.402.188 GBP	1.760.963		21/01/2022	en USD 47.598	patrimoni 0,0
EUR	2.189.024 USD	2.471.834		10/02/2022	24.620	0,0
PLUSVALÍA LATE	ENTE SOBRE CONTRATOS DE D	IVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI	NES DE COBERTURA		72.218	0,0
				Fecha	Plusvalía latente	% de
Divisa	Compra Divisa	Venta		de vencimiento	USD	patrimonio
GBP USD	58.305.116 USD 15.847 EUR	80.233.379 14.071		21/01/2022 10/02/2022	(2.273.388) (201)	(2,89 (0,00
MINUSVALÍA LAT	TENTE SOBRE CONTRATOS DE	DIVISAS A PLAZO CELEBRADOS CON F	INES DE COBERTURA		(2.273.589)	(2,89
Opciones - (1,1	6 %)					
Opciones = (1,1	0 /8)			Plusvalía/	Valor de	
Tenencias	Descripción del valor			(minusvalía) latente USD	mercado en USD	% del patrimonio
	Opciones adquiridas					
642.000	EUR Put EUR / Call PLN	Vence 02/12/2021	Precio de ejercicio 4,56	(1.677)	1	0,00
642.000	Put EUR / Call PLN	Vence 02/12/2021	Precio de ejercicio 4,56	(1.939)	1	0,00
3.953.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,12	(6.902)	5.703	0,01
4.304.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,12	(13.250)	4.432	0,00
3.889.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	(2.284)	14.094	0,02
3.896.000	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,14	7.049	22.068	0,03
				(19.003)	46.299	0,06
44 000 000	GBP		D : 1 : :: 000	(40,000)	0.050	0.04
11.980.000	Call Swaption del SONIA a 12 mo		Precio de ejercicio 0,28	(19.032)	3.856	0,01
15.640.000	Call Swaption del SONIA a 12 mo		Precio de ejercicio 0,30	(25.095)	5.345	0,01
14.540.000 13.290.000	Call Swaption del SONIA a 12 me Call Swaption del SONIA a 12 me		Precio de ejercicio 0,42 Precio de ejercicio 0,46	(23.825)	7.692 7.954	0,01 0,01
14.600.000	Call Swaption del SONIA a 12 ma		Precio de ejercicio 0,40	(21.120) (23.168)	11.131	0,01
13.290.000	Call Swaption del SONIA a 12 me		Precio de ejercicio 0,54	(20.187)	11.072	0,01
10.200.000	Can ewaption der Contra 12 mi	VOIIGO 10/11/2022	1 redio de ejercicio e,e4	(132.427)	47.050	0,06
	JPY					
199.900.000	Put Swaption del LIBOR a 6 mes	es Vence 26/05/2022	Precio de ejercicio 0,43	(21.456)	13.406	0,02
	USD					
12.840.000	Call Swaption del LIBOR a 3 mes		Precio de ejercicio 0,63	(33.108)	2.788	0,00
12.830.000	Call Swaption del LIBOR a 3 mes		Precio de ejercicio 0,61	(33.197)	3.979	0,01
13.210.000	Call Swaption del LIBOR a 3 mes		Precio de ejercicio 0,47	(14.247)	2.573	0,00
12.840.000	Call Swaption del LIBOR a 3 mes		Precio de ejercicio 0,86	(31.055)	27.424	0,04
7.890.000 6.000.000	Call Swaption del LIBOR a 3 mes Call Swaption del LIBOR a 3 mes		Precio de ejercicio 1,05 Precio de ejercicio 0,70	(31.776) (46.847)	38.622 13.882	0,05 0,02
1.115.000	Call USD / Put ILS	Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 3,11	18.887	22.969	0,02
1.118.000	Call USD / Put ILS	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 3,13	11.526	15.931	0,03
1.113.000		Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 3,14	10.731	15.172	0,02
2.216.000	Call USD / Put INR	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 75,26	4.620	10.714	0,01
847.000	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 15,90	2.482	9.580	0,01
1.670.000	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 16,15	(3.886)	8.119	0,01
				(145.870)	171.753	0,22
TOTAL DE OPCIO (coste USD 597.2	ONES ADQUIRIDAS (64)				278.508	0,36
	Opciones suscritas					
(2.080.000)	EUR Call Swaption del EURIBOR a 6	meses Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 0,20	(7.521)	(23.243)	(0,03)
(2.080.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6		Precio de ejercicio 0,20	(8.820)	(23.692)	(0,03)
(2.080.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6		Precio de ejercicio 0,23	(17.229)	(32.859)	(0,04)
(2.080.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6		Precio de ejercicio 0,18	(6.893)	(24.607)	(0,03)
(1.880.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6	meses Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(8.219)	(34.398)	(0,04)
(1.750.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6	meses Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(2.429)	(32.020)	(0,04)
(1.740.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6	meses Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	461	(31.837)	(0,04)
(1.750.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6	meses Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(2.429)	(32.020)	(0,04)
(1.750.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6	meses Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(2.429)	(32.020)	(0,04)
(1.880.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6	meses Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	(10.743)	(41.867)	(0,05)
(1.550.000)	Call Swaption del EURIBOR a 6	meses Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	(8.582)	(34.518)	(0,05)
(1.000.000)	·			, ,	, ,	, , ,

Opciones - (co	ntinuación)					
Tenencias	, Descripción del valor			Plusvalía/ (minusvalía) latente USD	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
	Opciones suscritas – (continuad EUR – (continuación)	ción)				
(2.080.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 mese	es Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 0,19	5.507	(9.366)	(0,01)
(2.080.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 mese		Precio de ejercicio 0,23	6.995	(8.636)	(0,01)
(2.080.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 mese	es Vence 06/01/2022	Precio de ejercicio 0,18	3.023	(14.691)	(0,02)
(3.520.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 mese	es Vence 26/05/2022	Precio de ejercicio 0,11	1.168	(34.820)	(0,05)
(1.880.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 mese	es Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	7.829	(18.292)	(0,02)
(1.750.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 mese	es Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(752)	(17.027)	(0,02)
(1.740.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 mese	es Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(681)	(16.930)	(0,02)
(1.750.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 mese	es Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(887)	(17.027)	(0,02)
(1.750.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 mese	es Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(887)	(17.027)	(0,02)
(1.880.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 mese	es Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	14.001	(15.671)	(0,02)
(1.550.000)	Put Swaption del EURIBOR a 6 mese		Precio de ejercicio 0,22	13.016	(12.920)	(0,02)
(1.977.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	5.142	(7.165)	(0,01)
(1.967.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,13	11.491	(7.129)	(0,01)
(1.945.000)	Put EUR / Call USD	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,14	487	(11.017)	(0,02)
				1.324	(555.816)	(0,71)
(4.040.000)	GBP		D : 1 : :: 000	0.000	(10.717)	(0.00)
(1.240.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses		Precio de ejercicio 0,36	6.208	(16.747)	(0,02)
(1.610.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses		Precio de ejercicio 0,40	6.462	(23.903)	(0,03)
(1.500.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses		Precio de ejercicio 0,38	8.205	(23.339)	(0,03)
(1.360.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses		Precio de ejercicio 0,42	5.565	(23.518)	(0,03)
(1.510.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses		Precio de ejercicio 0,55	(3.324)	(37.661)	(0,05)
(1.370.000)	Call Swaption del SONIA a 12 meses	vence 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,60	(6.380)	(37.570)	(0,05)
	USD					
(3.370.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 06/12/2021	Precio de ejercicio 1,58	(5.573)	(31.058)	(0,04)
(3.370.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,64	(21.241)	(50.349)	(0,06)
(3.370.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 1,67	(34.093)	(62.907)	(0,08)
(4.170.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 1,30	27.568	(8.325)	(0,01)
(3.370.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 1,60	(15.648)	(46.989)	(0,06)
(4.170.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 07/01/2022	Precio de ejercicio 1,12	33.003	(4.198)	(0,01)
(4.170.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/02/2022	Precio de ejercicio 0,85	13.523	(3.291)	(0,00)
(4.170.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 23/03/2022	Precio de ejercicio 1,41	11.528	(46.948)	(0,06)
(4.160.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 21/06/2022	Precio de ejercicio 1,38	12.734	(57.713)	(0,07)
(1.200.000)	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 14/11/2022	Precio de ejercicio 1,06	34.362	(27.969)	(0,04)
(557.000)	Call USD / Put ILS	Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 3,06	(13.799)	(18.384)	(0,02)
(559.000)	Call USD / Put ILS	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 3,08	(10.162)	(15.160)	(0,02)
(557.000)	Call USD / Put ILS	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 3,09	(9.721)	(14.918)	(0,02)
(1.108.000)	Call USD / Put INR	Vence 23/12/2021	Precio de ejercicio 74,72	(4.035)	(9.766)	(0,01)
(279.000)	Call USD / Put TRY	Vence 17/12/2021	Precio de ejercicio 12,30	(19.942)	(23.078)	(0,03)
(835.000)	Call USD / Put ZAR	Vence 07/12/2021	Precio de ejercicio 15,90	1.080	(9.444)	(0,01)
(3.370.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 06/12/2021	Precio de ejercicio 1,58	20.219	(5.266)	(0,01)
(3.370.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,64	21.747	(7.362)	(0,01)
(3.370.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 1,67	17.957	(10.856)	(0,01)
(3.370.000)	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 1,60	10.989	(20.352)	(0,03)
				70.496	(474.333)	(0,60)
TOTAL DE OPCIO	ONES SUSCRITAS (1.443))				(1.192.887)	(1,52)
TOTAL DE OPCIO					(914.379)	(1,16)
	ermutas financieras – (1,59 %)					., .,
Importe	- (1,00 /0)				Plusvalía	
teórico					latente	% del
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	en USD	patrimonio
	Permutas de tipos de interés					
4.520.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 2,000 %	AUD	17/03/2032	22.653	0,03
4.470.000	Fijo 5,800 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2023	34.252	0,04
870.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 12,300 %	BRL	02/01/2024	1.113	0,00
2.120.000	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 11,230 %	BRL	04/01/2027	2.020	0,00
4.370.000	Fijo 1,000 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2023	27.455	0,03
6.300.000	Fijo 1,680 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	22/08/2028	85.723	0,11
3.950.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)		CAD	14/10/2031	29.872	0,04
5.360.000	,	Fijo 2,250 %	CAD	15/12/2051	89.999	0,11
660.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,180 %	CAD	22/08/2052	276	0,00

Importe	ermutas financieras – (continuación)				Plusvalía	
teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	latente en USD	% de patrimonio
	Permutas de tipos de interés - (continua	ación)				
1.120.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,000 %	CHF	16/03/2027	4.837	0,0
5.720.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,000 %	CHF	16/03/2032	61.315	0,0
1.530.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,500 %	CHF	17/03/2032	11.498	0,0
18.690.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,500 %	CNY	15/09/2023	5.061	0,0
4.820.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,750 %	CNY	15/09/2026	5.181	0,0
1.670.000	Variable (LIBOR a 3 meses en CNY)	Fijo 2,500 %	CNY	15/12/2026	2.083	0,0
32.270.000	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	03/11/2023	40.512	0,0
40.000	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2023	11	0,0
5.035.289	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2026	22.037	0,0
4.840.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,200 %	EUR	03/11/2027	15.299	0,0
2.280.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2031	7.921	0,0
2.610.000	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,500 %	EUR	17/03/2032	13.595	0,02
1.994.080.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)	JPY	15/12/2026	1.782	0,00
2.297.420.000	Fijo 1,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en KRW)	KRW	16/03/2024	5.059	0,0
39.070.000	Fijo 6,200 %	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	13/12/2023	29.414	0,04
4.556.195	Fijo 6,700 %	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	09/12/2026	5.525	0,01
2.360.000	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 3,000 %	NZD	16/09/2031	5.121	0,01
300.000	Fijo 1,700 %	Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2026	3.997	0,01
1.420.000	Fijo 0,000 %	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	SEK	15/12/2023	83	0,00
70.650.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,500 %	SEK	16/03/2024	17.732	0,02
38.150.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,750 %	SEK	15/12/2031	16.238	0,02
10.860.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 1,000 %	SEK	17/03/2032	1.094	0,00
11.740.000	Fijo 0,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD	15/12/2023	26.593	0,03
75.880.000	Fijo 1,000 %	Fijo 1,000 %	USD	25/07/2024	1.606	0,00
4.940.000	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	Fijo 1,530 %	USD	22/09/2031	64.873	0,08
8.070.000	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	Fijo 1,750 %	USD	15/12/2031	44.248	0,06
1.160.000	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	Fijo 2,000 %	USD	15/12/2051	3.645	0,00
3.625.000	Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	Fijo 7,400 %	ZAR	15/12/2031	4.414	0,01
PLUSVALÍA LATI	ENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE IN	ITERÉS			714.137	0,91
	Permutas de incumplimiento crediticio (	CDS)				
800.000	Variable (General Electric Co.)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2026	4.116	0,01
610.000	Variable (Bonos internacionales del Estado Saudí)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	43	0,00
300.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 11 Index)	Fijo 3,000 %	USD	18/11/2054	73.133	0,09
100.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 11 Index)	Fijo 3,000 %	USD	18/11/2054	2.984	0,00
100.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/10/2057	13.073	0,02
100.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/10/2057	1.981	0,00
250.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 8 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/10/2057	4.115	0,01
100.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 10 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/11/2059	17.744	0,02
150.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 10 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/11/2059	8.794	0,01
100.000	Variable (The Markit CMBX North America BBB- 10 Index)	Fijo 3,000 %	USD	17/11/2059	3.132	0,00
PLUSVALÍA LATI	ENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIM	IENTO CREDITICIO (CDS)			129.115	0,16
	Permutas de inflación	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	,		-	-,
1.630.000	Fijo 2,250 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/10/2023	837	0,00
2.230.000	Fijo 3,250 %	Variable (LIBOR a 12 meses en USD)	USD	07/10/2022	25.809	0,03
PLUSVALÍA LATI	ENTE SOBRE PERMUTAS DE INFLACIÓN				26.646	0,03
TOTAL DE PLUS	VALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE	PERMUTAS FINANCIERAS			869.898	1,10
Importe teórico					Minusvalía latente	% del
local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	en USD	patrimonio
	Permutas de tipos de interés					
38.160.000	Variable (BBSW a 3 meses en AUD)	Fijo 0,190 %	AUD	22/02/2023	(63.343)	(0,08)
4.540.000	Variable (BBSW a 3 meses en AUD)	Fijo 0,250 %	AUD	15/12/2023	(15.281)	(0,02)
38.290.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 1,250 %	AUD	15/12/2026	(548.447)	(0,70)
5.890.000	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 2,000 %	AUD	15/12/2031	(76.141)	(0,10)
1.920.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 10,565 %	BRL	02/01/2023	(2.811)	(0,00)
5.030.000	Variable (LIBOR a 1 mes en BRL)	Fijo 7,200 %	BRL	02/01/2023	(34.063)	(0,04)

Contratos de per	rmutas financieras	<ul> <li>(continuación)</li> </ul>
------------------	--------------------	------------------------------------

Importe					Minusvalía	0/ 1.1
teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	latente en USD	% del patrimonio
-	Permutas de tipos de interés – (cont	inuación)				
225.000	Fijo 11,814 %	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(169)	(0,00)
225.000		Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	BRL	02/01/2024	(190)	(0,00)
200.000	Variable (BRCDI a 1 mes en BRL)	Fijo 4,930 %	BRL	02/01/2024	(3.176)	(0,00)
3.183.386	Variable (CETIP a 1 mes en BRL)	Fijo 9,200 %	BRL	02/01/2024	(7.331)	(0,01)
8.930.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 1,560 %	CAD	22/08/2025	(77.519)	(0,10)
7.230.000	Fijo 1,750 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2026	(16.103)	(0,02)
5.870.000	Fijo 2,000 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2031	(70.735)	(0,09)
24.632	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2023	(29)	(0,00)
5.280.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/12/2026	(33.642)	(0,04)
7.520.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	03/11/2027	(47.026)	(0,06)
110.000	Fijo 0,000 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2031	(790)	(0,00)
1.060.000	Fijo 0,250 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2051	(21.975)	(0,03)
11.380.000	Fijo 0,500 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2026	(60.428)	(80,0)
200.000	Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)	Fijo 4,060 %	GBP	15/12/2028	(20.388)	(0,03)
7.800.000	Fijo 0,750 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2031	(46.384)	(0,06)
6.240.000	Fijo 1,000 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	17/03/2032	(53.564)	(0,07)
578.840.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)	JPY	15/12/2031	(5.573)	(0,01)
509.230.000	Fijo 1,750 %	Variable (KWCDC a 3 meses en KRW)	KRW	15/09/2031	(11.075)	(0,01)
3.330.000	Fijo 7,150 %	Variable (TIIE a 1 mes en MXN)	MXN	03/12/2031	(3.412)	(0,00)
29.630.000	Fijo 2,000 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	16/03/2027	(36.743)	(0,05)
31.790.000	Fijo 2,130 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	11/05/2031	(43.881)	(0,06)
6.080.000	Fijo 2,000 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	16/03/2032	(12.592)	(0,02)
90.070.000	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 0,500 %	NZD	15/09/2022	(176.898)	(0,22)
4.760.000	,	Fijo 1,250 %	NZD	15/12/2022	(5.909)	(0,01)
9.790.000	,	Fijo 1,750 %	NZD	15/12/2026	(121.809)	(0,15)
3.480.000		Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	NZD	15/12/2031	(11.521)	(0,01)
6.050.000		Variable (WIBOR a 3 meses en PLN)	PLN	16/12/2021	(2.718)	(0,00)
260.847		Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2023	(193)	(0,00)
1.325.000		Variable (WIBOR a 6 meses en PLN)	PLN	15/12/2031	(1.764)	(0,00)
57.840.000		Fijo 0,250 %	SEK	15/12/2026	(3.601)	(0,00)
	Fijo 0,250 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2024	(20.426)	(0,03)
30.000		Fijo 1,250 %	USD	15/12/2026	(3)	(0,00)
	Fijo 1,000 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2027	(25.308)	(0,03)
2.140.000		Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD	17/09/2031	(6.650)	(0,01)
6.040.000		Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	22/09/2036	(61.651)	(0,08)
2.400.000		Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2052	(43.685)	(0,06)
	Fijo 5,500 %	Variable (JIBAR a 3 meses en ZAR)	ZAR	15/12/2023	(5.985)	(0,01)
MINUSVALÍA LA	TENTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS	DE INTERÉS			(1.800.932)	(2,29)
					,	( , - ,
560.000	Permutas de incumplimiento credition Fijo 1,000 %	Variable (Bonos internacionales del	USD	20/12/2021	(257)	(0,00)
1.000.000	Variable (Bonos internacionales del Estado de Chile)	Estado de China) Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	(8.671)	(0,01)
620.000		Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(4.157)	(0,01)
620.000		Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(6.936)	(0,01)
	Variable (Bonos extranjeros rusos – Eurobono)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(3.187)	(0,00)
3.150.000	Variable (The Markit CDX Emerging Markets 36 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(57.048)	(0,07)
MINUSVALÍA LA	TENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUM	PLIMIENTO CREDITICIO (CDS)			(80.256)	(0,10)
	Permutas de inflación					
1.380.000 2.960.000	Fijo 1,920 % Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR) Fijo 4,170 %	EUR GBP	15/11/2031 15/11/2028	(11.121) (226.823)	(0,01) (0,29)
MINUSVALÍA LA	TENTE SOBRE PERMUTAS DE INFLAC	CIÓN			(237.944)	(0,30)
TOTAL DE MINUS	SVALÍA LATENTE SOBRE CONTRATO	S DE PERMUTAS FINANCIERAS			(2.119.132)	(2,69)
VALOR DE MERO (coste USD 79.94	CADO DE LAS INVERSIONES 43.042)				72.311.638	91,92
OTROS ACTIVOS	S Y PASIVOS				6.359.366	8,08
PATRIMONIO					78.671.004	100,00

TOTAL DE INVERSIONES	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Total inversiones excluyendo derivados (coste USD 80.627.221)	77.017.140	97,90
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	288.360	0,37
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(540.239)	(0,69)
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	3.533.626	4,49
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	(3.622.265)	(4,60)
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	72.218	0,09
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	(2.273.589)	(2,89)
Valor de mercado de opciones compradas (coste USD 597.264)	278.508	0,36
Valor de mercado de opciones suscritas (coste USD (1.281.443))	(1.192.887)	(1,52)
Plusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	869.898	1,10
Minusvalía latente sobre contratos de permutas financieras	(2.119.132)	(2,69)
Otros activos y pasivos	6.359.366	8,08
Patrimonio	78.671.004	100,00

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Australia & New Zealand Banking Group Ltd., Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Credit Suisse International, Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Merrill Lynch International, Morgan Stanley & Co. International Plc., Natwest Markets Plc., Royal Bank of Canada, Standard Chartered Bank, State Street Bank & Trust y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, HSBC Bank Plc., JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc. y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Barclays Capital, Inc., Citibank N.A., Credit Suisse, JP Morgan Securities Inc., Merrill Lynch International y Morgan Stanley & Co. International Plc.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 2,05 %

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (d) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds
- (e) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.
- (f) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (g) Los valores TBA (por confirmar) se compran sobre una vez suscrito un compromiso a plazo con un importe de principal aproximado (por lo general +/-2,5 %) y sin fecha definitiva de vencimiento. El importe real del principal y la fecha de vencimiento se determinarán tras la liquidación cuando se asignen los "pools" de hipotecas específicos.

#### Goldman Sachs Funds—Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Tenencia	ıs	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
		rios admitidos a cotización en una bo arias – 94,53 %	olsa de valore	s oficial
Argentii		MercadoLibre, Inc.	3.862.591	0,60
	3.120	WercauoLibre, Inc.	3.002.391	
Bélgica				
	31.565	Groupe Bruxelles Lambert S.A.	3.455.862	0,54
Brasil				
		Magazine Luiza S.A.	1.114.439	0,17
	314.422	Telefonica Brasil S.A.—ADR <sup>(a)</sup>	2.798.356	0,44
			3.912.795	0,61
Canadá				
		CGI, Inc.	1.230.870	0,19
		Enghouse Systems Ltd.	1.183.815	0,19
		Imperial Oil Ltd.	2.825.141	0,44
		Lululemon Athletica, Inc.	3.841.918	0,60
		Ritchie Bros Auctioneers, Inc. Rogers Communications, Inc. "B"	1.546.460 1.169.048	0,24
		Shopify, Inc. "A"	9.796.844	0,18 1,53
	0.100	Shopily, Inc. A		
			21.594.096	3,37
China				
		Alibaba Group Holding Ltd.	3.384.036	0,53
		Alibaba Group Holding Ltd.—ADR <sup>(a)</sup>	2.046.679	0,32
	316.240	Wuxi Biologics Cayman, Inc. 144A <sup>(b)</sup>	4.338.389	0,67
			9.769.104	1,52
Dinama	rca			
	13.210	Ambu A/S "B"	383.105	0,06
	14.314	Chr Hansen Holding A/S	1.079.252	0,17
	15.118	GN Store Nord A/S	885.900	0,14
		Novo Nordisk A/S "B"	1.057.164	0,17
		Novozymes A/S "B"	790.629	0,12
	32.418	Vestas Wind Systems A/S	1.105.077	0,17
			5.301.127	0,83
Finlandi	ia	-		
	17.073	Huhtamaki OYJ	741.122	0,12
Francia				
	141.930	Danone S.A.	8.396.132	1,31
	429	Hermes International	814.458	0,13
	10.146	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton S.E.	7.954.252	1,24
		Pernod Ricard S.A.	3.958.873	0,62
		Safran S.A.—ADR <sup>(a)</sup>	1.635.407	0,25
	17.328	Sodexo S.A.	1.468.498	0,23
			24.227.620	3,78
Alemani	ia			
	12.301	Deutsche Boerse AG	1.960.938	0,31
		HeidelbergCement AG	6.352.049	0,99
	15.848	SAP S.E.	2.077.362	0,32
		_	10.390.349	1,62
Hong K	ona			<u> </u>
		AIA Group Ltd.(b)	3.253.065	0,51
		Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	888.265	0,14
		Techtronic Industries Co., Ltd.	1.359.378	0,21
		-	5.500.708	0,86
lelon de			0.000.700	
Irlanda	3 038	Accenture Plc. "A"	1.432.251	0,22
		AerCap Holdings NV	1.346.147	0,22
		ICON Plc.	1.273.067	0,20
		-		
			4.051.465	0,63

Tenencias		Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% de
	dinar	rias – (continuación)		patimoni
Israel		(		
	482	Check Point Software Technologies Ltd.	1.281.621	0,2
Italia	100	Ferrari NV	4 020 072	0.6
		Moncler SpA	4.029.072 873.486	0,6 0,1
	.040	-		
			4.902.558	0,7
Japón				
7.	100	Keyence Corp.	4.433.643	0,6
14.	.200	Nintendo Co., Ltd.	6.308.684	0,9
			10.742.327	1,6
Países Bajos				
-		Adyen NV 144A <sup>(b)</sup>	4.962.166	0,7
		ASML Holding NV	1.144.861	0,1
		Euronext NV 144A <sup>(b)</sup>	1.491.087	0,2
		ING Groep NV	3.095.596	0,4
134.	330	Koninklijke Philips NV	4.779.540	0,7
68.	944	Prosus NV—ADR <sup>(a)</sup>	1.120.340	0,1
122	.511	Royal Dutch Shell Plc. "B"	2.565.014	0,4
		_	19.158.604	2,9
			10.100.001	
Sudáfrica	E70	Noopore Ltd. ADD(a)	490 224	0.0
10.	.570	Naspers Ltd.—ADR <sup>(a)</sup>	480.334	0,0
Corea del Su				
160.	454	Samsung Electronics Co., Ltd.	9.658.017	1,5
España				
13.	234	Amadeus IT Group S.A.	864.347	0,1
Suecia				
	573	Assa Abloy AB "B"	1.072.300	0,1
		Atlas Copco AB "A"	4.160.369	0,6
24.	870	Evolution AB 144A(b)	2.711.626	0,4
17.	928	Thule Group AB 144A(b)	1.046.961	0,1
		-	8.991.256	1,4
			0.001.200	
Suiza	005		0.070.045	
		Alcon, Inc.	2.973.845	0,4
		Compagnie Financiere Richemont S.A.	6.719.785	1,0
		Nestlé S.A. Novartis AG	1.225.963 8.821.789	0,1
			1.200.500	1,3
		Partners Group Holding AG	1.468.760	0,1 0,2
		Roche Holding AG UBS Group AG	7.307.226	1,1
72-1.		-		
			29.717.868	4,6
Taiwán				
50.	580			
		Co., Ltd.—ADR <sup>(a)</sup>	6.065.048	0,9
Reino Unido				
631.	703	BAE Systems Plc.	4.636.517	0,7
28.	070	Bunzl Plc.	1.084.503	0,1
		Compass Group Plc.	6.792.862	1,0
		Croda International Plc.	871.853	0,1
10		Diageo Plc.	945.879	0,1
		GlaxoSmithKline Plc.	1.161.894	0,1
56.				
56. 14.	.013	Intertek Group Plc.	1.009.044	
56. 14. 5.375.	.013 .438	Intertek Group Plc. Lloyds Banking Group Plc.	3.348.288	0,5
56. 14. 5.375. 18.	.013 .438 .766	Intertek Group Plc. Lloyds Banking Group Plc. Reckitt Benckiser Group Plc.	3.348.288 1.542.584	0,5 0,2
56. 14. 5.375. 18. 33.	.013 .438 .766 .503	Intertek Group Plc. Lloyds Banking Group Plc. Reckitt Benckiser Group Plc. RELX Plc.	3.348.288 1.542.584 1.050.245	0,5 0,2 0,1
56. 14. 5.375. 18. 33. 126.	.013 .438 .766 .503	Intertek Group Plc. Lloyds Banking Group Plc. Reckitt Benckiser Group Plc. RELX Plc. Rightmove Plc.	3.348.288 1.542.584 1.050.245 1.275.969	0,1 0,5 0,2 0,1 0,2
56. 14. 5.375. 18. 33. 126.	.013 .438 .766 .503 .907 .286	Intertek Group Plc. Lloyds Banking Group Plc. Reckitt Benckiser Group Plc. RELX Plc. Rightmove Plc. Unilever Plc.	3.348.288 1.542.584 1.050.245 1.275.969 1.210.072	0,5 0,2 0,1 0,2 0,1
56. 14. 5.375. 18. 33. 126.	.013 .438 .766 .503 .907 .286	Intertek Group Plc. Lloyds Banking Group Plc. Reckitt Benckiser Group Plc. RELX Plc. Rightmove Plc.	3.348.288 1.542.584 1.050.245 1.275.969	0,5 0,2 0,1 0,2

# Goldman Sachs Funds—Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Estados Unidos  2.134 A 12.027 A 4.239 A 4.239 A 4.572 A 3.657 A 5.082 A 40.234 A 13.421 A 6.313 A 80.470 A 33.708 A 22.372 A 8.488 A 138.427 B 22.416 B 816 B 14.630 B 5.119 B 12.841 C 7.849 C 17.609 C 1.193 C 1.193 C 1.194 C 1.194 C 1.194 C 1.194 C 1.194 C 1.195 C 1.194 C 1.195 C 1.194 C 1.195 C 1.196 C 1.196 C 1.197 C 1.198 C	ias – (continuación)  Adobe, Inc. Advance Auto Parts, Inc. Alphabet, Inc. "A" Alphabet, Inc. "C" Amazon.com, Inc. American Express Co. AmerisourceBergen Corp. Amgen, Inc. Amphenol Corp. "A" Anthem, Inc. Aon Pic. "A" Arista Networks, Inc. Bank of New York Mellon Corp. Berkshire Hathaway, Inc. "B" Booking Holdings, Inc. Booking Holdings, Inc. Bradidge Financial Corp. Bradridge Financial Corp. Capital One Financial Corp. Capital One Financial Corp. Capital Corp. Capital Corp. Charles River Laboratories International, Inc. Charter Communications, Inc. "A" Church & Dwight Co., Inc.	1.475.490 2.697.416 12.353.802 13.389.879 13.072.788 736.992 6.214.544 1.582.873 1.280.466 6.611.415 13.767.021 6.599.516 1.061.849 7.663.319 6.248.460 1.753.804 1.244.867 894.392 1.861.175 766.062 1.270.313	0,23 0,42 1,93 2,09 2,04 0,11 0,97 0,25 0,20 1,03 2,15 1,03 0,17 1,19 0,27 0,19 0,14	2.738 2.738 3.617 2.738 3.617 2.750 9.868 44.841 21.600 15.009 6.436 2.656 44.100 14.630 2.639 14.367 9.600 25.920 75.923 34.910	Moody's Corp. Morgan Stanley MSCI, Inc. Netflix, Inc. NIKE, Inc. "B" Old Dominion Freight Line, Oracle Corp. PepsiCo, Inc. Pool Corp. Progressive Corp. Repligen Corp. S&P Global, Inc. Service Corp. International ServiceNow, Inc. Sherwin-Williams Co. Southwest Airlines Co.	Inc.	1.089.697 6.062.064 5.324.550 6.642.447 7.601.446 7.672.536 1.393.886 1.049.390 1.473.921 4.122.909 4.353.742 1.226.818 959.716 6.492.384 8.655.466	0,17 0,95 0,83 1,04 1,19 1,20 0,22 0,16 0,23 0,64 0,68 0,19 0,15 1,01
2.134 A 12.027 A 4.239 A 4.239 A 4.572 A 3.657 A 5.082 A 40.234 A 13.421 A 6.313 A 80.470 A 33.708 A 22.372 A 8.488 A 138.427 B 22.416 B 816 B 14.630 B 5.119 B 12.841 C 7.849 C 17.609 C 2.193 C If 3.484 C 61.346 C	Advance Auto Parts, Inc. Alphabet, Inc. "A" Alphabet, Inc. "C" Amazon.com, Inc. Amedisys, Inc. American Express Co. AmerisourceBergen Corp. Ampen, Inc. Amphenol Corp. "A" Anthem, Inc. Aon Plc. "A" Arista Networks, Inc. Bank of New York Mellon Corp. Berkshire Hathaway, Inc. "B" Booking Holdings, Inc. Booz Allen Hamilton Holding Corp. Capital One Financial Corp. CBRE Group, Inc. "A" Cerner Corp. Charles River Laboratories International, Inc. Charter Communications, Inc. "A"	2.697.416 12.353.802 13.389.879 13.072.788 736.992 6.214.544 1.582.873 1.280.466 6.611.415 13.767.021 6.599.516 1.061.849 7.663.319 6.248.460 1.753.804 1.244.867 894.392 1.861.175 766.062 1.270.313	0,42 1,93 2,09 2,04 0,11 0,97 0,25 0,20 1,03 2,15 1,03 0,17 1,19 0,97 0,27 0,19 0,14 0,29	2.738 63.617 8.250 9.868 44.841 21.600 15.009 6.436 2.656 44.100 14.630 2.639 14.367 9.600 25.920 75.923 34.910	Moody's Corp. Morgan Stanley MSCI, Inc. Netflix, Inc. NIKE, Inc. "B" Old Dominion Freight Line, Oracle Corp. PepsiCo, Inc. Pool Corp. Progressive Corp. Repligen Corp. S&P Global, Inc. Service Corp. International ServiceNow, Inc. Sherwin-Williams Co. Southwest Airlines Co.	Inc.	6.062.064 5.324.550 6.642.447 7.601.446 7.672.536 1.393.886 1.049.390 1.473.921 4.122.909 4.353.742 1.226.818 959.716 6.492.384	0,95 0,83 1,04 1,19 1,20 0,22 0,16 0,23 0,64 0,68 0,19 0,15
12.027 A 4.239 A 4.572 A 3.657 A 5.082 A 40.234 A 13.421 A 6.313 A 80.470 A 22.372 A 8.488 A 138.427 B 22.416 B 816 B 14.630 B 5.119 B 12.841 C 7.849 C 17.609 C 2.193 C 1.3484 C 61.346 C 19.289 C	Advance Auto Parts, Inc. Alphabet, Inc. "A" Alphabet, Inc. "C" Amazon.com, Inc. Amedisys, Inc. American Express Co. AmerisourceBergen Corp. Ampen, Inc. Amphenol Corp. "A" Anthem, Inc. Aon Plc. "A" Arista Networks, Inc. Bank of New York Mellon Corp. Berkshire Hathaway, Inc. "B" Booking Holdings, Inc. Booz Allen Hamilton Holding Corp. Capital One Financial Corp. CBRE Group, Inc. "A" Cerner Corp. Charles River Laboratories International, Inc. Charter Communications, Inc. "A"	2.697.416 12.353.802 13.389.879 13.072.788 736.992 6.214.544 1.582.873 1.280.466 6.611.415 13.767.021 6.599.516 1.061.849 7.663.319 6.248.460 1.753.804 1.244.867 894.392 1.861.175 766.062 1.270.313	0,42 1,93 2,09 2,04 0,11 0,97 0,25 0,20 1,03 2,15 1,03 0,17 1,19 0,97 0,27 0,19 0,14 0,29	63.617 8.250 9.868 44.841 21.600 15.009 6.436 2.656 44.100 14.630 2.639 14.367 9.600 25.920 75.923 34.910	Morgan Stanley MSCI, Inc. Netflix, Inc. NIKE, Inc. "B" Old Dominion Freight Line, Oracle Corp. PepsiCo, Inc. Pool Corp. Progressive Corp. Repligen Corp. S&P Global, Inc. Service Corp. International ServiceNow, Inc. Sherwin-Williams Co. Southwest Airlines Co.	Inc.	6.062.064 5.324.550 6.642.447 7.601.446 7.672.536 1.393.886 1.049.390 1.473.921 4.122.909 4.353.742 1.226.818 959.716 6.492.384	0,95 0,83 1,04 1,19 1,20 0,22 0,16 0,23 0,64 0,68 0,19 0,15
4.239 A 4.572 A 3.657 A 5.082 A 40.234 A 13.421 A 6.313 A 80.470 A 33.708 A 22.372 A 8.488 A 138.427 B 22.416 B 816 B 14.630 B 5.119 B 12.841 C 7.849 C 2.193 C 17.609 C 2.193 C 19.384 C 19.289 C	Alphabet, Inc. "A" Alphabet, Inc. "C" Amazon.com, Inc. Amedisys, Inc. American Express Co. AmerisourceBergen Corp. Amgen, Inc. Amphenol Corp. "A" Anthem, Inc. Aon Pic. "A" Arista Networks, Inc. Bank of New York Mellon Corp. Berkshire Hathaway, Inc. "B" Booking Holdings, Inc. Broadridge Financial Solutions, Inc. Capital One Financial Corp. CBRE Group, Inc. "A" Cerner Corp. Charles River Laboratories International, Inc. Charter Communications, Inc. "A"	12.353.802 13.389.879 13.072.788 736.992 6.214.544 1.582.873 1.280.466 6.611.415 13.767.021 6.599.516 1.061.849 7.663.319 6.248.460 1.753.804 1.244.867 894.392 1.861.175 766.062 1.270.313	1,93 2,09 2,04 0,11 0,97 0,25 0,20 1,03 2,15 1,03 0,17 1,19 0,97 0,27 0,19 0,14 0,29	8.250 9.868 44.841 21.600 15.009 6.436 2.656 44.100 14.630 2.639 14.367 9.600 25.920 75.923 34.910	MSCI, Inc. Netflix, Inc. NIKE, Inc. "B" Old Dominion Freight Line, Oracle Corp. PepsiCo, Inc. Pool Corp. Progressive Corp. Repligen Corp. S&P Global, Inc. Service Corp. International ServiceNow, Inc. Sherwin-Williams Co. Southwest Airlines Co.	Inc.	5.324.550 6.642.447 7.601.446 7.672.536 1.393.886 1.049.390 1.473.921 4.122.909 4.353.742 1.226.818 959.716 6.492.384	0,83 1,04 1,19 1,20 0,22 0,16 0,63 0,64 0,68 0,19 0,15 1,01
4.572 A 3.657 A 5.082 A 40.234 A 13.421 A 6.313 A 80.470 A 33.708 A 22.372 A 8.488 A 138.427 B 22.416 B 816 B 14.630 B 5.119 B 12.841 C 7.849 C 2.193 C II 3.484 C 61.346 C	Alphabet, Inc. "C" Amazon.com, Inc. Amedisys, Inc. AmerisourceBergen Corp. Amgen, Inc. Amphenol Corp. "A" Anthem, Inc. Aon Pic. "A" Arista Networks, Inc. Bank of New York Mellon Corp. Berkshire Hathaway, Inc. "B" Bookang Holdings, Inc. Booz Allen Hamilton Holding Corp. Broadridge Financial Solutions, Inc. Capital One Financial Corp. CBRE Group, Inc. "A" Cerner Corp. Charles River Laboratories Inc. "Charter Communications, Inc. "A"	13.389.879 13.072.788 736.992 6.214.544 1.562.873 1.280.466 6.611.415 13.767.021 1.061.849 7.663.319 6.248.460 4.244.867 894.392 1.861.175 766.062 1.270.313	2,09 2,04 0,11 0,97 0,25 0,20 1,03 2,15 1,03 0,17 1,19 0,97 0,27 0,19 0,14 0,29	9.868 44.841 21.600 15.009 6.436 2.656 44.100 14.630 2.639 14.367 9.600 25.920 75.923 34.910	Netflix, Inc. NIKE, Inc. "B" Old Dominion Freight Line, Oracle Corp. PepsiCo, Inc. Pool Corp. Progressive Corp. Repligen Corp. S&P Global, Inc. Service Corp. International ServiceNow, Inc. Sherwin-Williams Co. Southwest Airlines Co.	Inc.	6.642.447 7.601.446 7.672.536 1.393.886 1.049.390 1.473.921 4.122.909 4.353.742 1.226.818 959.716 6.492.384	1,04 1,19 1,20 0,22 0,16 0,23 0,64 0,68 0,19 0,15 1,01
3.657 A 5.082 A 40.234 A 13.421 A 6.313 A 80.470 A 33.708 A 22.372 A 8.488 A 138.427 B 22.416 B 816 B 14.630 B 5.119 B 12.841 C 7.849 C 2.193 C I 3.484 C 19.289 C	Amazon.com, Inc. Amedisys, Inc. Amedisys, Inc. American Express Co. American Express Co. Ampen. Amphenol Corp. "A" Anthem, Inc. Aon Plc. "A" Arista Networks, Inc. Bank of New York Mellon Corp. Berkshire Hathaway, Inc. "B" Book Allen Hamilton Holding Corp. Broadridge Financial Solutions, Inc. Capital One Financial Corp. CBRE Group, Inc. "A" Cerner Corp. Charles River Laboratories International, Inc. Charter Communications, Inc. "A"	13.072.788 736.992 6.214.544 1.582.873 1.280.466 6.611.415 13.767.021 6.599.516 1.061.849 7.663.319 6.248.460 1.753.804 1.244.867 894.392 1.861.175 766.062 1.270.313	2,04 0,11 0,97 0,25 0,20 1,03 2,15 1,03 0,17 1,19 0,97 0,27 0,19 0,14 0,29	44.841 21.600 15.009 6.436 2.656 44.100 14.630 2.639 14.367 9.600 25.920 75.923	NIKE, Inc. "B" Old Dominion Freight Line, Oracle Corp. PepsiCo, Inc. Pool Corp. Progressive Corp. Repligen Corp. S&P Global, Inc. Service Corp. International ServiceNow, Inc. Sherwin-Williams Co. Southwest Airlines Co.	Inc.	7.601.446 7.672.536 1.393.886 1.049.390 1.473.921 4.122.909 4.353.742 1.226.818 959.716 6.492.384	1,19 1,20 0,22 0,16 0,23 0,64 0,68 0,19 0,15 1,01
5.082 A 40.234 A 13.421 A 6.313 A 80.470 A 33.708 A 22.372 A 8.488 A 138.427 B 22.416 B 816 B 14.630 B 5.119 B 12.841 C 7.849 C 17.609 C 2.193 C I 3.484 C 61.346 C 19.289 C	Amedisys, Inc. American Express Co. AmerisourceBergen Corp. Amgen, Inc. Amphenol Corp. "A" Anthem, Inc. Anista Networks, Inc. Bank of New York Mellon Corp. Berkshire Hathaway, Inc. "B" Booking Holdings, Inc. Booz Allen Hamilton Holding Corp. Broadridge Financial Solutions, Inc. Capital One Financial Corp. CBRE Group, Inc. "A" Cerner Corp. Charles River Laboratories International, Inc. Charter Communications, Inc. "A"	736.992 6.214.544 1.582.873 1.280.466 6.611.415 13.767.021 6.599.516 1.061.849 7.663.319 6.248.460 1.753.804 1.244.867 894.392 1.861.175 766.062 1.270.313	0,11 0,97 0,25 0,20 1,03 2,15 1,03 0,17 1,19 0,97 0,27 0,19 0,14 0,29	21.600 15.009 6.436 2.656 44.100 14.630 2.639 14.367 9.600 25.920 75.923 34.910	Old Dominion Freight Line, Oracle Corp. PepsiCo, Inc. Pool Corp. Progressive Corp. Repligen Corp. S&P Global, Inc. Service Corp. International ServiceNow, Inc. Sherwin-Williams Co. Southwest Airlines Co.	Inc.	7.672.536 1.393.886 1.049.390 1.473.921 4.122.909 4.353.742 1.226.818 959.716 6.492.384	1,20 0,22 0,16 0,23 0,64 0,68 0,19 0,15 1,01
40.234 A 13.421 A 6.313 A 80.470 A 33.708 A 22.372 A 8.488 A 138.427 B 22.416 B 816 B 14.630 B 5.119 B 12.841 C 7.849 C 17.609 C 2.193 C Ir 3.484 C 61.346 C	American Express Co. AmerisourceBergen Corp. Amgen, Inc. Amphenol Corp. "A" Anthem, Inc. Ann Plc. "A" Arista Networks, Inc. Bank of New York Mellon Corp. Berkshire Hathaway, Inc. "B" Booking Holdings, Inc. Broadridge Financial Solutions, Inc. Capital One Financial Corp. CBRE Group, Inc. "A" Cerner Corp. Charles River Laboratories International, Inc. Charter Communications, Inc. "A"	6.214.544 1.582.873 1.280.466 6.611.415 13.767.021 6.599.516 1.061.849 7.663.319 6.248.460 1.753.804 1.244.867 894.392 1.861.175 766.062 1.270.313	0,97 0,25 0,20 1,03 2,15 1,03 0,17 1,19 0,97 0,27 0,19 0,14 0,29	15.009 6.436 2.656 44.100 14.630 2.639 14.367 9.600 25.920 75.923 34.910	Oracle Corp. PepsiCo, Inc. Pool Corp. Progressive Corp. Repligen Corp. S&P Global, Inc. Service Corp. International ServiceNow, Inc. Sherwin-Williams Co. Southwest Airlines Co.	inc.	1.393.886 1.049.390 1.473.921 4.122.909 4.353.742 1.226.818 959.716 6.492.384	0,22 0,16 0,23 0,64 0,68 0,19 0,15 1,01
13.421 A 6.313 A 80.470 A 33.708 A 22.372 A 8.488 A 138.427 B 22.416 B 816 B 14.630 B 5.119 B 12.841 C 7.849 C 2.193 C I 3.484 C 61.346 C	AmerisourceBergen Corp. Amgen, Inc. Amphenol Corp. "A" Anthem, Inc. Aon Plc. "A" Arista Networks, Inc. Bank of New York Mellon Corp. Berkshire Hathaway, Inc. "B" Booking Holdings, Inc. Booz Allen Hamilton Holding Corp. Broadridge Financial Solutions, Inc. Capital One Financial Corp. CBRE Group, Inc. "A" Cerner Corp. Charles River Laboratories Inc. "A"	1.582.873 1.280.466 6.611.415 13.767.021 6.599.516 1.061.849 7.663.319 6.248.460 1.753.804 1.244.867 894.392 1.861.175 766.062 1.270.313	0,25 0,20 1,03 2,15 1,03 0,17 1,19 0,97 0,27 0,19 0,14 0,29	6.436 2.656 44.100 14.630 2.639 14.367 9.600 25.920 75.923 34.910	PepsiCo, Inc. Pool Corp. Progressive Corp. Repligen Corp. S&P Global, Inc. Service Corp. International ServiceNow, Inc. Sherwin-Williams Co. Southwest Airlines Co.		1.049.390 1.473.921 4.122.909 4.353.742 1.226.818 959.716 6.492.384	0,16 0,23 0,64 0,68 0,19 0,15 1,01
80.470 A 33.708 A 22.372 A 8.488 A 138.427 B 22.416 B 816 B 14.630 B 5.119 B 12.841 C 7.849 C 17.609 C 2.193 C Ir 3.484 C 61.346 C	Amphenol Corp. "A" Anthem, Inc. Aon Plc. "A" Arrista Networks, Inc. Bank of New York Mellon Corp. Berkshire Hathaway, Inc. "B" Book Allen Hamilton Holding Corp. Broadridge Financial Solutions, Inc. Capital One Financial Corp. CBRE Group, Inc. "A" Cerner Corp. Charles River Laboratories International, Inc. Charter Communications, Inc. "A"	6.611.415 13.767.021 6.599.516 1.061.849 7.663.319 6.248.460 1.753.804 1.244.867 894.392 1.861.175 766.062 1.270.313	1,03 2,15 1,03 0,17 1,19 0,97 0,27 0,19 0,14 0,29	2.656 44.100 14.630 2.639 14.367 9.600 25.920 75.923 34.910	Pool Corp. Progressive Corp. Repligen Corp. S&P Global, Inc. Service Corp. International ServiceNow, Inc. Sherwin-Williams Co. Southwest Airlines Co.		1.473.921 4.122.909 4.353.742 1.226.818 959.716 6.492.384	0,23 0,64 0,68 0,19 0,15 1,01
33.708 A 22.372 A 8.488 A 138.427 B 22.416 B 816 B 14.630 B 5.119 B 12.841 C 7.849 C 17.609 C 2.193 C Ir 3.484 C 61.346 C	Anthem, Inc. Anthem, Inc. An Pic. "A" Arista Networks, Inc. Bank of New York Mellon Corp. Berkshire Hathaway, Inc. "B" Booking Holdings, Inc. Booking Holdings, Inc. Broadridge Financial Solutions, Inc. Capital One Financial Corp. CBRE Group, Inc. "A" Cerner Corp. Charles River Laboratories International, Inc. Charter Communications, Inc. "A"	13.767.021 6.599.516 1.061.849 7.663.319 6.248.460 1.753.804 1.244.867 894.392 1.861.175 766.062 1.270.313	2,15 1,03 0,17 1,19 0,97 0,27 0,19 0,14 0,29	44.100 14.630 2.639 14.367 9.600 25.920 75.923 34.910	Progressive Corp. Repligen Corp. S&P Global, Inc. Service Corp. International ServiceNow, Inc. Sherwin-Williams Co. Southwest Airlines Co.		4.122.909 4.353.742 1.226.818 959.716 6.492.384	0,64 0,68 0,19 0,15 1,01
22.372 A 8.488 A 138.427 B 22.416 B 816 B 14.630 B 5.119 B 12.841 C 7.849 C 17.609 C 2.193 C Ir 3.484 C 61.346 C	Aon Plc. "A" Arista Networks, Inc. Bank of New York Mellon Corp. Berkshire Hathaway, Inc. "B" Booking Holdings, Inc. Booz Allen Hamilton Holding Corp. Broadridge Financial Solutions, Inc. Capital One Financial Corp. CBRE Group, Inc. "A" Cerner Corp. Charles River Laboratories International, Inc. Charter Communications, Inc. "A"	6.599.516 1.061.849 7.663.319 6.248.460 1.753.804 1.244.867 894.392 1.861.175 766.062 1.270.313	1,03 0,17 1,19 0,97 0,27 0,19 0,14 0,29	14.630 2.639 14.367 9.600 25.920 75.923 34.910	Repligen Corp. S&P Global, Inc. Service Corp. International ServiceNow, Inc. Sherwin-Williams Co. Southwest Airlines Co.		4.353.742 1.226.818 959.716 6.492.384	0,68 0,19 0,15 1,01
8.488 A 138.427 B 22.416 B 816 B 14.630 B 5.119 B 12.841 C 7.849 C 2.193 C I 3.484 C 19.289 C	Arista Networks, Inc. Bank of New York Mellon Corp. Berkshire Hathaway, Inc. "B" Booking Holdings, Inc. Booz Allen Hamilton Holding Corp. Broadridge Financial Solutions, Inc. Capital One Financial Corp. BRE Group, Inc. "A" Cerner Corp. Charles River Laboratories International, Inc. Charter Communications, Inc. "A"	1.061.849 7.663.319 6.248.460 1.753.804 1.244.867 894.392 1.861.175 766.062 1.270.313	0,17 1,19 0,97 0,27 0,19 0,14 0,29	2.639 14.367 9.600 25.920 75.923 34.910	S&P Global, Inc. Service Corp. International ServiceNow, Inc. Sherwin-Williams Co. Southwest Airlines Co.		1.226.818 959.716 6.492.384	0,19 0,15 1,01
138.427 B 22.416 B 816 B 14.630 B 5.119 B 12.841 C 7.849 C 2.193 C I 3.484 C 61.346 C	Bank of New York Mellon Corp. Berkshire Hathaway, Inc. "B" Booking Holdings, Inc. Booz Allen Hamilton Holding Corp. Broadridge Financial Solutions, Inc. Capital One Financial Corp. CBRE Group, Inc. "A" Cerner Corp. Charles River Laboratories International, Inc. Charter Communications, Inc. "A"	7.663.319 6.248.460 1.753.804 1.244.867 894.392 1.861.175 766.062 1.270.313	1,19 0,97 0,27 0,19 0,14 0,29	14.367 9.600 25.920 75.923 34.910	Service Corp. International ServiceNow, Inc. Sherwin-Williams Co. Southwest Airlines Co.		959.716 6.492.384	0,15 1,01
22.416 B 816 B 14.630 B 5.119 B 12.841 C 7.849 C 17.609 C 2.193 C Ir 3.484 C 61.346 C	Berkshire Hathaway, Inc. "B" Booking Holdings, Inc. Booz Allen Hamilton Holding Corp. Broadridge Financial Solutions, Inc. Capital One Financial Corp. CBRE Group, Inc. "A" Cerner Corp. Charles River Laboratories International, Inc. Charter Communications, Inc. "A"	6.248.460 1.753.804 1.244.867 894.392 1.861.175 766.062 1.270.313	0,97 0,27 0,19 0,14 0,29	9.600 25.920 75.923 34.910	ServiceNow, Inc. Sherwin-Williams Co. Southwest Airlines Co.		6.492.384	1,01
816 B 14.630 B 5.119 B 12.841 C 7.849 C 17.609 C 2.193 C Ir 3.484 C 61.346 C	Booking Holdings, Înc. Booz Allen Hamilton Holding Corp. Broadridge Financial Solutions, Inc. Capital One Financial Corp. CBRE Group, Inc. "A" Cerner Corp. Charles River Laboratories International, Inc. Charter Communications, Inc. "A"	1.753.804 1.244.867 894.392 1.861.175 766.062 1.270.313	0,27 0,19 0,14 0,29	25.920 75.923 34.910	Sherwin-Williams Co. Southwest Airlines Co.			
14.630 B 5.119 B 12.841 C 7.849 C 17.609 C 2.193 C Ir 3.484 C 61.346 C 19.289 C	Booz Allen Hamilton Holding Corp. Broadridge Financial Solutions, Inc. Capital One Financial Corp. CBRE Group, Inc. "A" Cerner Corp. Charles River Laboratories International, Inc. Charter Communications, Inc. "A"	1.244.867 894.392 1.861.175 766.062 1.270.313	0,19 0,14 0,29	75.923 34.910	Southwest Airlines Co.			1.35
5.119 B 12.841 C 7.849 C 17.609 C 2.193 C Ir 3.484 C 61.346 C 19.289 C	Broadridge Financial Solutions, Inc. Capital One Financial Corp. CBRE Group, Inc. "A" Cerner Corp. Charles River Laboratories International, Inc. Charter Communications, Inc. "A"	894.392 1.861.175 766.062 1.270.313	0,14 0,29	34.910			3.364.148	0,52
12.841 C 7.849 C 17.609 C 2.193 C Ir 3.484 C 61.346 C	Capital One Financial Corp.  BRE Group, Inc. "A"  Cerner Corp.  Charles River Laboratories  International, Inc.  Charter Communications, Inc. "A"	1.861.175 766.062 1.270.313	0,29		SILVKEL COID.		8.513.851	1,33
7.849 C 17.609 C 2.193 C 3.484 C 61.346 C 19.289 C	CBRE Group, Inc. "A" Derner Corp. Charles River Laboratories International, Inc. Charter Communications, Inc. "A"	766.062 1.270.313			Thermo Fisher Scientific, In	C.	8.204.813	1,28
17.609 C 2.193 C Ir 3.484 C 61.346 C 19.289 C	Cerner Corp. Charles River Laboratories nternational, Inc. Charter Communications, Inc. "A"				Toro Co.		941.949	0,15
2.193 C Ir 3.484 C 61.346 C 19.289 C	Charles River Laboratories nternational, Inc. Charter Communications, Inc. "A"		0,20		Tractor Supply Co.		1.292.953	0,20
3.484 C 61.346 C 19.289 C	Charter Communications, Inc. "A"		,		Union Pacific Corp.		1.592.846	0,25
61.346 C 19.289 C		824.502	0,13		UnitedHealth Group, Inc.		7.425.323	1,16
19.289 C	Church & Dwight Co., Inc.	2.318.846	0,36		Verizon Communications, Ir	nc.	1.560.645	0,24
	•	5.692.295	0,89	40.726	Visa, Inc. "A"		7.982.296	1,24
	Cisco Systems, Inc.	1.068.225	0,17	13.198	Walt Disney Co.		1.936.015	0,30
	Citigroup, Inc.	12.185.817	1,90	114.089	Wells Fargo & Co.		5.509.358	0,86
	Cognizant Technology Solutions Corp. "A"	1.198.035	0,19	17.100	West Pharmaceutical Servi	ces, Inc.	7.715.007	1,20
	Comcast Corp. "A"	5.187.640	0,81	6.842	Woodward, Inc.		732.983	0,11
	Costco Wholesale Corp. Dentsply Sirona, Inc.	5.866.711 3.392.839	0,91 0,53	12.973	YETI Holdings, Inc.		1.213.105	0,19
	DISH Network Corp. "A"	2.114.285	0,33	1.781	Zebra Technologies Corp. ".	A"	1.082.866	0,17
	Ecolab, Inc.	1.053.705	0,16	4.515	Zoetis, Inc.		1.007.477	0,16
	Edwards Lifesciences Corp.	811.266	0,13				395.103.516	61,59
	Electronic Arts, Inc.	1.712.515	0,27				393.103.310	
31.760 E	Entegris, Inc.	4.972.981	0,78		ONES ORDINARIAS			
2.181 E	Estee Lauder Cos., Inc. "A"	734.648	0,11	(coste USD 464.6	48.620)		606.381.301	94,53
	Expedia Group, Inc.	5.263.076	0,82	Warrants - 0,05	%			
	air Isaac Corp.	2.438.233	0,38	Suiza				
	First Republic Bank	6.741.228	1,05	309.737	Compagnie Financiere Rich	nemont		
16.929 F		1.651.255	0,26		S.A., exp. 11/23—Warrants		324.615	0,05
	Floor & Decor Holdings, Inc. "A" Fortune Brands Home & Security, Inc.	4.600.096 1.531.499	0,72 0,24	TOTAL DE WARR	RANTS			
	Fox Factory Holding Corp.	928.181	0,14	(coste USD 91.01			324.615	0,05
	General Electric Co.	4.971.314	0,77	Forder de la con-				
	General Motors Co.	2.581.343	0,40	Fondos de inve	rsion – 4,29 %			
	Genpact Ltd.	1.638.993	0,26	Irlanda	Goldman Sachs US\$ Liquid			
62.290 G		4.647.457	0,72	27.551.610	Reserves Fund (Clase de a			
6.261 H	HCA Healthcare, Inc.	1.427.445	0,22		de distribución X) <sup>(c)(d)</sup>	00101100	27.551.610	4,29
27.560 H	HEICO Corp. "A"	3.486.064	0,54	TOTAL DE				
	Hershey Co.	921.017	0,14	(coste USD 27.55	OS DE INVERSIÓN		27.551.610	4 20
	Hilton Worldwide Holdings, Inc.	3.685.182	0,57	(COSTE OSD 27.55	11.010)		27.551.610	4,29
	Home Depot, Inc.	1.599.863	0,25		RES MOBILIARIOS ADMITI			
	Honeywell International, Inc.	927.130	0,14		N UNA BOLSA DE VALORI	ES OFICIAL	624 257 526	00.07
	AC via InterActiveCorp lack Henry & Associates, Inc.	341.602 1.184.684	0,05 0,18	(coste USD 492.2	91.242)		634.257.526	98,87
	Johnson & Johnson	1.715.222	0,18		CADO DE LAS INVERSIONE	S		
	Keysight Technologies, Inc.	1.144.571	0,18	EXCLUYENDO D			0046=====	
	Kroger Co.	1.063.541	0,17	(coste USD 492.2	91.242)		634.257.526	98,87
	Lam Research Corp.	4.238.486	0,66	Contratos de di	visas a plazo – 0,00 %			
	.iberty Broadband Corp. "C"	3.891.013	0,61	Jonitalios de di	1.545 a piazo - 0,00 /0		B1 "	
	Lowe's Cos., Inc.	2.018.470	0,31			Fecha de	Plusvalía latente en	% del
	yondellBasell Industries NV "A"	969.077	0,15	Divisa Cor	mpra Divisa Venta	vencimiento	USD	patrimonio
	Marriott International, Inc. "A"	4.944.195	0,77					
	Marsh & McLennan Cos., Inc.	5.967.071	0,93	USD 503	.989 CHF 451.000	15/12/2021	11.385	0,00
	Mastercard, Inc. "A"	1.615.738	0,25		ENTE SOBRE CONTRATOS	DE		
	McDonald's Corp.	873.032 17 153 701	0,14	DIVISAS A PLAZ	0		11.385	0,00
	Meta Platforms, Inc. "A"  Mettler-Toledo International, Inc.	17.153.701 5.367.241	2,67 0,84					
52.676 N		17.699.136	2,76					

## Goldman Sachs Funds—Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Contratos de divisas a plazo específicos de una clase de acciones - (0,03 %)

			•			, ,
Divisa	Compra	Divisa	Venta	Fecha de vencimiento		% del patrimonio
EUR	271.597	USD	323.634	15/12/2021	(14.459)	(0,00)
GBP	793.735	USD	1.102.333	15/12/2021	(41.729)	(0,01)
EUR	8.883.297	USD	10.187.849	20/01/2022	(61.556)	(0,01)
GBP	24.717.376	USD	33.157.122	20/01/2022	(107.453)	(0,01)
USD	362.452	EUR	320.780	20/01/2022	(3.213)	(0,00)
USD	1.200.809	GBP	901.943	20/01/2022	(5.181)	(0,00)
				RATOS DE DIVISAS A E COBERTURA	(233.591)	(0,03)
(coste	USD 492.29	1.242)	E LAS INVER	RSIONES	634.035.320	98,84
UIKU	3 ACTIVOS	I FASI	VU3		7.440.053	1,10
PATRI	MONIO				641.475.373	100,00
TOTAL	_ DE INVERS	SIONES	3	me	Valor de rcado en USD	% del patrimonio
	nversiones ex te USD 492.2			634	.257.526	98,87
Plusva	lía latente so	bre cor	rtratos de divi	isas a plazo	11.385	0,00
	valía latente s ados con fine			ivisas a plazo (	233.591)	(0,03)
Otros	activos y pas	ivos		7	.440.053	1,16
Patrim	nonio			641	.475.373	100,00

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Morgan Stanley & Co., Inc. y State Street Bank & Trust.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,00 %.

Distribución de la cartera a 30 de noviembre de 2021	% del patrimonio
Acciones ordinarias	
Internet	14,34
Bancos	8,09
Software	6,99
Atención sanitaria – Productos	6,42
Venta al por menor	4,90
Atención sanitaria – Servicios	4,64
Seguros	4,34
Semiconductores	4,08
Alimentación, bebidas y tabaco	4,03
Servicios financieros diversos	3,83
Otros	32,87
TOTAL DE ACCIONES ORDINARIAS	94,53
Fondos de inversión	4,29
Warrants	
Servicios financieros diversos	0,05
TOTAL DE WARRANTS	0,05
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	0,00
Minusvalia latente sobre contratos de divisas a plazo celebrados con fines de cobertura	(0,03)
Otros activos y pasivos	1,16
TOTAL	100,00

<sup>(</sup>a) Los valores se negocian/están denominados en USD. (ADR: American Depositary Receipt (Certificado de depósito estadounidense)/GDR: Global Depositary Receipt (Igual que el anterior pero a escala internacional)).

<sup>(</sup>b) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.

<sup>(</sup>c) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

<sup>(</sup>d) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,092 %.

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en NOK	% del
	liarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	211.00	po dotoros			patrinionio
Bonos -83,67						
Australia	70					
	APT Pipelines Ltd.	EUR	2,000 %	15/07/2030	19.084.515	0,11
	APT Pipelines Ltd.	GBP	3,125 %	18/07/2031	14.840.848	0,09
	Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	EUR	0,625 %	21/02/2023	10.379.831	0,06
6.125.000	Macquarie Bank Ltd.	GBP	1,125 %	15/12/2025	72.965.142	0,42
1.350.000	Macquarie Group Ltd.	EUR	0,625 %	03/02/2027	13.966.251	0,08
1.150.000	Scentre Group Trust 1	GBP	3,875 %	16/07/2026	15.280.037	0,09
		-			146.516.624	0,85
Austria						
	Erste Group Bank AG	EUR	0,375 %	16/04/2024	10.368.960	0,06
	Volksbank Wien AG	EUR	0,875 %	23/03/2026	52.583.560	0,31
		-	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		62.952.520	0,37
					02.932.320	0,37
Bélgica	Cofinimmo S.A.	EUR	0.875.%	02/12/2030	14.040.862	0.09
	Connimmo S.A.  Euroclear Bank S.A.	EUR	0,875 % 0,500 %	10/07/2023	10.393.471	0,08 0,06
	KBC Group NV <sup>(c)</sup>	GBP	1,250 %	21/09/2027	35.479.825	0,00
	KBC Group NV <sup>(c)</sup>	EUR	0.125 %	14/01/2029	46.908.702	0,27
			-,			
					106.822.860	0,62
Bermudas			/			
	IHS Markit Ltd.	USD	3,625 %	01/05/2024	6.233.006	0,04
1.500.000	IHS Markit Ltd.	USD	4,250 %	01/05/2029	15.580.409	0,09
					21.813.415	0,13
Islas Vírgenes	Británicas					
310.000	China Cinda 2020 I Management Ltd.	USD	2,500 %	20/01/2028	2.754.435	0,02
690.000	China Cinda 2020 I Management Ltd.	USD	3,000 %	20/01/2031	6.134.769	0,03
975.000	Global Switch Holdings Ltd.	EUR	1,500 %	31/01/2024	10.160.732	0,06
360.000	Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	USD	4,750 %	27/04/2027	3.304.687	0,02
580.000	Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	USD	4,250 %	07/11/2027	5.205.314	0,03
300.000	Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	USD	3,750 %	29/05/2024	2.706.071	0,01
	Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	USD	3,625 %	30/09/2030	2.904.243	0,02
	Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	5,000 %	19/11/2025	10.037.063	0,06
	Huarong Finance II Co., Ltd.	USD	4,875 %	22/11/2026	3.321.087	0,02
1.130.000	TSMC Global Ltd.	USD	2,250 %	23/04/2031	10.271.836	0,06
					56.800.237	0,33
Canadá						
	Bank of Nova Scotia	EUR	0,500 %	30/04/2024	10.379.113	0,06
	Bank of Nova Scotia	GBP	1,250 %	17/12/2025	55.014.565	0,32
2.150.000	Canadian Pacific Railway Co.	USD	2,450 %	02/12/2031	19.831.136	0,12
					85.224.814	0,50
Islas Caimán						
1.250.000	Baidu, Inc.	USD	3,425 %	07/04/2030	11.994.978	0,07
	CK Hutchison International 19 II Ltd.	USD	2,750 %	06/09/2029	3.222.703	0,02
	CK Hutchison International 20 Ltd.	USD	2,500 %	08/05/2030	11.976.726	0,07
2.340.000	CK Hutchison International 21 Ltd.	USD	2,500 %	15/04/2031	21.670.856	0,13
1.370.000	DP World Crescent Ltd.	USD	4,848 %	26/09/2028	13.964.852	0,08
	DP World Crescent Ltd.	USD	3,875 %	18/07/2029	2.998.932	0,02
	QNB Finance Ltd.	USD	3,500 %	28/03/2024	1.911.106	0,01
	SA Global Sukuk Ltd.	USD	2,694 %	17/06/2031	119.540.912	0,69
	Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd.	USD	4,500 %	14/02/2022	30.279.806	0,18
	Tencent Holdings Ltd.	USD	3,595 %	19/01/2028	23.165.449	0,13
210.000	Tencent Holdings Ltd.	USD	2,880 %	22/04/2031	1.947.710	0,01
					242.674.030	1,41
Chile						
	Corp Nacional del Cobre de Chile 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,500 %	01/08/2047	18.021.749	0,10
3.705.505	GNL Quintero S.A.	USD	4,634 %	31/07/2029	35.720.352	0,21
					53.742.101	0,31
China						
200.000	Bank of China Ltd.	USD	4,000 %	08/03/2028	2.013.381	0,01

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en NOK	% de
Bonos – (con						
Dinamarca						
3.325.000	Danske Bank A/S <sup>(c)</sup>	EUR	(0,018 %)	10/11/2024	34.121.124	0,20
Finlandia						
3.100.000	SBB Treasury OYJ	EUR	0,750 %	14/12/2028	30.383.409	0,18
Francia						
3.800.000	ALD S.A.	EUR	(0,042 %)	23/02/2024	38.995.181	0,2
1.000.000	APRR S.A.	EUR	1,500 %	15/01/2024	10.575.920	0,0
	Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.	GBP	1,000 %	16/07/2026	51.989.342	0,30
	Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.	EUR	1,250 %	03/06/2030	24.515.210	0,1
	BNP Paribas S.A. BNP Paribas S.A.(c)	EUR	1,125 %	22/11/2023	28.601.397	0,1
	BNP Paribas S.A. <sup>(c)</sup>	EUR EUR	0,375 % 0,500 %	14/10/2027 01/09/2028	30.571.222 44.639.692	0,1
	BPCE S.A.	GBP	1,000 %	22/12/2025	55.586.193	0,2
	Capgemini S.E.	EUR	1,000 %	18/10/2024	10.512.848	0,0
	Electricite de France S.A.	GBP	5,125 %	22/09/2050	34.761.774	0,20
4.000.000	EssilorLuxottica S.A.	USD	2,500 %	30/06/2022	36.836.095	0,2
6.900.000	PSA Banque France S.A.	EUR	0,141 %	22/01/2025	70.441.187	0,4
	Société Générale S.A.	EUR	0,875 %	01/07/2026	47.980.744	0,28
	Société Générale S.A.(c)	EUR	0,875 %	22/09/2028	22.740.865	0,13
	Terega SASU	EUR	0,625 %	27/02/2028	11.154.395	0,0
	TotalEnergies Capital International S.A.	EUR	0,250 %	12/07/2023	10.340.141	0,0
	TotalEnergies Capital International S.A. Valeo S.A.	EUR EUR	2,500 % 1,000 %	25/03/2026 03/08/2028	2.259.728 13.845.593	0,0
	Veolia Environnement S.A.	EUR	0,314 %	04/10/2023	10.334.398	0,0
1.000.000	Voola Environment o. A.		0,014 70	0-11 10/2020	556.681.925	3,2
Alemania					330.001.323	5,2
	Astria office REIT-AG	EUR	0,500 %	26/09/2025	36.447.697	0,2
975.000	Deutsche Bank AG	EUR	1,125 %	30/08/2023	10.219.229	0,0
3.300.000	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	USD	2,222 %	18/09/2024	30.497.720	0,18
9.025.000	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	USD	2,129 %	24/11/2026	82.261.181	0,48
4.200.000	Deutsche Bank AG <sup>(c)</sup>	EUR	1,750 %	19/11/2030	44.835.823	0,20
	Deutsche Bank AG – Serie E	USD	0,962 %	08/11/2023	26.573.145	0,1
	Volkswagen Bank GmbH	EUR	1,875 %	31/01/2024	14.867.741	0,0
	Volkswagen Leasing GmbH	EUR	1,625 %	15/08/2025	62.168.346	0,30
	Volkswagen Leasing GmbH Vonovia S.E.	EUR EUR	0,375 %	20/07/2026	67.265.585	0,39
2.700.000	vonovia S.E.	EUR _	0,625 %	14/12/2029	27.375.093	0,10
Hann Kann					402.511.560	2,3
Hong Kong 420.000	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	USD	5,125 %	14/03/2028	4.362.361	0,0
	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	USD	3,875 %	19/06/2029	9.938.086	0,0
	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	USD	3,000 %	22/09/2030	1.830.744	0,0
		=			16.131.191	0,0
Indonesia						
650.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	USD	5,450 %	15/05/2030	6.709.906	0,0
2.380.000	Pertamina Persero PT	USD	6,000 %	03/05/2042	26.371.686	0,1
	Pertamina Persero PT	USD	5,625 %	20/05/2043	31.314.708	0,18
1.490.000	Pertamina Persero PT	USD _	4,175 %	21/01/2050	13.756.641	0,0
					78.152.941	0,4
1 000 000	Abbott Ireland Financing DAC	EUR	0,100 %	19/11/2024	10.306.605	0.00
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	6,500 %	15/07/2025	38.340.092	0,00 0,2
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	3,000 %	29/10/2028	47.936.719	0,2
	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust	USD	3,300 %	30/01/2032	28.438.665	0,1
	AIB Group Plc.	EUR	1,500 %	29/03/2023	10.207.129	0,00
2.750.000	AIB Group Plc.	EUR	1,250 %	28/05/2024	28.956.302	0,1
	AIB Group Plc.(c)	EUR	0,500 %	17/11/2027	55.470.088	0,3
	Bank of Ireland Group Plc.(c)	EUR	0,375 %	10/05/2027	37.970.966	0,2
	Dell Bank International DAC	EUR	1,625 %	24/06/2024	17.552.308	0,10
	Eaton Capital Unlimited Co.	EUR	0,750 %	20/09/2024	10.189.130	0,00
	GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.	USD	4,418 %	15/11/2035	33.051.513	0,19
	Perrigo Finance Unlimited Co. STERIS Irish FinCo Unlimited Co.	USD USD	4,375 %	15/03/2026	47.277.201	0,28
4.525.000	OTEINO IIISH FINOU UHIIIHIIRU OU.	บอบ	2,700 %	15/03/2031	41.694.745	0,2
		_			407.391.463	2,3

					Valor de	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	mercado en NOK	% del patrimonio
Bonos - (cont	tinuación)					
Israel	Israel Electric Corp., Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,250 %	14/08/2028	89.563.631	0,52
	islael Electric Corp., Etc. 144A	03D	4,230 %	14/06/2026	09.303.031	
Italia 1.275.000	Aeroporti di Roma SpA	EUR	1,625 %	02/02/2029	13.478.937	0,08
3.800.000	Aeroporti di Roma SpA	EUR	1,750 %	30/07/2031	39.866.591	0,23
975.000	•	EUR	0,625 %	19/09/2024	10.159.032	0,06
	FCA Bank SpA FCA Bank SpA	EUR EUR	0,125 % 0,500 %	16/11/2023 13/09/2024	84.939.799 10.347.935	0,49 0,06
	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	EUR	1,625 %	21/10/2028	36.964.904	0,00
	Intesa Sanpaolo SpA	EUR	0,625 %	24/02/2026	54.705.636	0,32
	Intesa Sanpaolo SpA	EUR	1,350 %	24/02/2031	25.707.018	0,15
	Terna - Rete Elettrica Nazionale	EUR	1,000 %	23/07/2023	10.197.730	0,06
	UniCredit SpA <sup>(c)</sup> UniCredit SpA <sup>(c)</sup>	EUR EUR	1,200 % 2,200 %	20/01/2026 22/07/2027	42.565.716 36.397.762	0,25 0,21
3.373.000	Officient Oparo	-	2,200 /0	22/01/2021	365.331.060	2,13
 Japón					300.001.000	2,10
4.175.000	East Japan Railway Co.	GBP	1,162 %	15/09/2028	49.670.502	0,29
	Mizuho Financial Group, Inc.	EUR	0,956 %	16/10/2024	10.244.227	0,06
	Nidec Corp.	EUR	0,046 %	30/03/2026	35.091.094 27.886.189	0,21
	Nomura Holdings, Inc. Norinchukin Bank 144A <sup>(d)</sup>	USD USD	2,608 % 1,284 %	14/07/2031 22/09/2026	51.517.140	0,16 0,30
	ORIX Corp.	USD	2,900 %	18/07/2022	41.111.928	0,24
	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	USD	2,784 %	12/07/2022	66.986.713	0,39
	Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	EUR	3,000 %	21/11/2030	55.508.219	0,32
2.550.000	Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	EUR _	1,375 %	09/07/2032	27.343.880	0,16
					365.359.892	2,13
Jersey 360.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,160 %	31/03/2034	3.178.403	0,02
	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,625 %	31/03/2036	4.613.532	0,03
9.470.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	2,940 %	30/09/2040	84.774.506	0,49
	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.	USD	3,250 %	30/09/2040	8.545.399	0,05
	Gatwick Funding Ltd.	GBP	2,500 %	15/04/2030	16.506.560	0,09
	Heathrow Funding Ltd. Heathrow Funding Ltd.	GBP EUR	5,225 % 1,500 %	15/02/2023 12/10/2025	13.894.490 18.626.314	0,08 0,11
	Heathrow Funding Ltd.	GBP	6,750 %	03/12/2026	25.533.407	0,15
	Heathrow Funding Ltd.	GBP	2,750 %	13/10/2029	61.815.145	0,36
750.000	Porterbrook Rail Finance Ltd.	GBP _	7,125 %	20/10/2026	11.447.561	0,07
					248.935.317	1,45
Kazajistán 5.300.000	KazMunayGas National Co., JSC	USD	6.375 %	24/10/2048	61.171.554	0,36
Luxemburgo						
	Aroundtown S.A.	EUR	1,000 %	07/01/2025	10.437.160	0,06
	Aroundtown S.A.	GBP	3,000 %	16/10/2029	36.793.480	0,21
	Becton Dickinson Euro Finance SARL	EUR	1,208 %	04/06/2026	12.754.608	0,07
	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR EUR	2,000 % 2,200 %	15/02/2024 24/07/2025	24.395.382 5.403.953	0,14 0,03
	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR	1,250 %	26/04/2027	3.232.773	0,02
3.325.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR	1,000 %	04/05/2028	33.273.390	0,19
	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	GBP	2,625 %	20/10/2028	35.839.583	0,21
	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	EUR	1,750 %	12/03/2029	27.645.701	0,16
	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL Fondo Europeo de Estabilidad Financiera	EUR EUR	1,625 %	20/04/2030 20/01/2031	46.520.904 181.927.910	0,27 1,06
	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.	USD	(0,065 %) 5,150 %	11/02/2026	54.174.265	0,32
	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.	USD	8,625 %	28/04/2034	8.782.704	0,05
920.000	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.	USD	7,288 %	16/08/2037	11.096.258	0,07
	Highland Holdings SARL	EUR	(0,081 %)	12/11/2023	15.406.065	0,09
	Logicor Financing SARL	EUR	1,500 %	14/11/2022	16.602.642	0,10
	Logicor Financing SARL Logicor Financing SARL	EUR EUR	0,750 % 2,250 %	15/07/2024 13/05/2025	18.943.004 20.634.398	0,11
	Logicor Financing SARL Logicor Financing SARL	EUR	2,250 % 3,250 %	13/05/2025	20.634.398	0,12 0,13
1.000.000	Logico. I manority of the		0,200 /0	10/11/2020		3,41
					585.520.849	-,,,,
México					585.520.849	
6.270.000	America Movil SAB de CV	USD	6,125 %	30/03/2040	80.313.630	0,47
6.270.000 150.000	Fomento Economico Mexicano SAB de CV	USD	3,500 %	16/01/2050	80.313.630 1.456.331	0,01
6.270.000 150.000 610.000					80.313.630	

					Valor de	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	mercado en NOK	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
México – (cont						
	Mexico City Airport Trust	USD	5,500 %	31/10/2046	1.754.299	0,01
	Mexico City Airport Trust Mexico City Airport Trust 144A <sup>(d)</sup>	USD USD	5,500 % 4,250 %	31/07/2047 31/10/2026	31.576.295 3.627.422	0,18 0,02
	Mexico City Airport Trust 144A(d)	USD	3,875 %	30/04/2028	25.371.465	0,02
	Mexico City Airport Trust 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,500 %	31/10/2046	4.473.463	0,13
	Mexico City Airport Trust 144A <sup>(d)</sup>	USD	5,500 %	31/07/2047	11.283.496	0,07
	Trust Fibra Uno	USD	5,250 %	15/12/2024	5.126.706	0,03
					174.537.172	1,02
Países Bajos 2 300 000	Akelius Residential Property Financing BV	EUR	1,000 %	17/01/2028	23.480.867	0,14
	Akelius Residential Property Financing BV	EUR	0,750 %	22/02/2030	23.495.318	0,14
	Allianz Finance II BV	EUR	0,250 %	06/06/2023	10.339.423	0,06
1.050.000	E.ON International Finance BV	GBP	6,250 %	03/06/2030	17.017.757	0,10
3.725.000	easyJet FinCo BV	EUR	1,875 %	03/03/2028	38.270.236	0,22
	Evonik Finance BV	EUR	0,375 %	07/09/2024	10.366.909	0,06
	Heimstaden Bostad Treasury BV	EUR	1,625 %	13/10/2031	114.497.799	0,67
	ING Groep NV ING Groep NV	EUR GBP	1,000 %	20/09/2023 18/02/2026	26.157.256 117.519.296	0,15 0,68
	JAB Holdings BV	EUR	3,000 % 1,000 %	20/12/2027	77.173.513	0,66
	JAB Holdings BV	EUR	3,375 %	17/04/2035	81.808.901	0,48
	Koninklijke Ahold Delhaize NV	EUR	0,875 %	19/09/2024	10.236.127	0,06
	LeasePlan Corp. NV	EUR	3,500 %	09/04/2025	50.370.890	0,29
3.230.000	Lukoil International Finance BV	USD	4,750 %	02/11/2026	31.835.535	0,19
4.690.000	Lukoil Securities BV	USD	3,875 %	06/05/2030	43.672.341	0,25
	Mondelez International Holdings Netherlands BV	EUR	0,625 %	09/09/2032	32.999.862	0,19
	Nationale-Nederlanden Bank NV	EUR	0,375 %	31/05/2023	10.349.474	0,06
	Prosus NV	USD	3,680 %	21/01/2030	34.892.946	0,20
	Prosus NV Prosus NV	EUR USD	2,031 % 4,027 %	03/08/2032 03/08/2050	2.720.590 11.185.093	0,02 0,06
	Prosus NV	USD	3,832 %	08/02/2051	14.673.260	0,00
	Redexis Gas Finance BV	EUR	1,875 %	28/05/2025	20.483.577	0,12
	Roche Finance Europe BV	EUR	0,500 %	27/02/2023	10.340.551	0,06
1.000.000	Schlumberger Finance BV	EUR	0,008 %	15/10/2024	10.249.685	0,06
6.450.000	Technip Energies NV	EUR	1,125 %	28/05/2028	66.746.168	0,39
	Thermo Fisher Scientific Finance I BV	EUR	0,070 %	18/11/2025	29.394.427	0,17
	Upjohn Finance BV	EUR	1,908 %	23/06/2032	36.674.349	0,21
	Volkswagen Financial Services NV	GBP	4,250 %	09/10/2025	29.100.899	0,17
	Wintershall Dea Finance BV Wintershall Dea Finance BV	EUR EUR	0,840 % 1,332 %	25/09/2025 25/09/2028	17.711.267 46.235.321	0,10 0,27
	Wintershall Dea Finance BV	EUR	1,823 %	25/09/2031	18.209.901	0,11
	WPC Eurobond BV	EUR	1,350 %	15/04/2028	28.196.670	0,16
1.400.000	WPC Eurobond BV	EUR	0,950 %	01/06/2030	14.003.244	0,08
		-			1.110.409.452	6,46
Nueva Zelanda						
	ASB Finance Ltd.	EUR	0,750 %	13/03/2024	10.184.431	0,06
<b>Polonia</b> 3.700.000	mBank S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	0,966 %	21/09/2027	37.424.464	0,22
Portugal						
1.000.000	Brisa-Concessao Rodoviaria S.A.	EUR	2,000 %	22/03/2023	10.540.025	0,06
Catar	Octor Energy	LICD	2.250.0/	12/07/2021	12 102 770	0.00
	Qatar Energy Qatar Energy	USD USD	2,250 % 3,125 %	12/07/2031 12/07/2041	13.192.779 44.826.202	0,08 0,26
	Qatar Energy	USD	3,300 %	12/07/2051	42.948.398	0,26
4.010.000	Qual Energy	-	0,000 70	120772001	100.967.379	0,59
Arabia Saudí						
-	Saudi Arabian Oil Co.	USD	4,375 %	16/04/2049	22.819.230	0,13
España 1.300.000	Abertis Infraestructuras S.A.	EUR	2,375 %	27/09/2027	14.478.382	0,08
	Banco Santander S.A.	USD	2,706 %	27/06/2024	37.811.009	0,22
	Banco Santander S.A.	EUR	1,375 %	05/01/2026	51.174.483	0,30
	Banco Santander S.A.	GBP	1,500 %	14/04/2026	52.526.097	0,31
	Banco Santander S.A.	USD	3,490 %	28/05/2030	48.163.507	0,28
1.100.000	Bankinter S.A.	EUR	0,625 %	06/10/2027	11.222.873	0,07
	CaixaBank S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	0,375 %	18/11/2026	59.057.370	0,34
7.400.000	CaixaBank S.A. <sup>(c)</sup>	EUR	0,750 %	26/05/2028	75.661.736	0,44

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en NOK	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
España - (con	tinuación)					
1.300.000	Cellnex Finance Co., S.A.	EUR	0,750 %	15/11/2026	13.106.472	0,08
	Cellnex Finance Co., S.A.	EUR	1,500 %	08/06/2028	33.246.585	0,19
	Cellnex Finance Co., S.A.	EUR	1,250 %	15/01/2029	15.723.603	0,09
	Cellnex Finance Co., S.A.	EUR	2,000 %	15/02/2033	16.623.687	0,10
	Cellnex Finance Co., S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,875 %	07/07/2041	5.094.953	0,03
	FCC Aqualia S.A. FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU	EUR EUR	2,629 % 1,661 %	08/06/2027 04/12/2026	50.579.654 10.285.534	0,29 0,06
	Telefonica Emisiones S.A.	USD	4,103 %	08/03/2027	26.633.228	0,00
	Telefonica Emisiones S.A.	EUR	1,788 %	12/03/2029	21.234.953	0,12
	Telefonica Emisiones S.A.	USD	5,520 %	01/03/2049	35.081.527	0,20
					577.705.653	3,36
Supranacional	es					-,
1.620.000	African Export-Import Bank	USD	2,634 %	17/05/2026	14.779.280	0,08
2.450.000	African Export-Import Bank	USD	3,798 %	17/05/2031	22.666.579	0,13
37.310.000	Unión Europea	EUR	(0,104 %)	04/10/2030	386.131.213	2,25
					423.577.072	2,46
<b>Suecia</b> 975.000	Akelius Residential Property AB	EUR	1,125 %	14/03/2024	10.227.028	0,06
	Heimstaden Bostad AB	EUR	1,125 %	21/01/2026	17.756.946	0,10
3.200.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	EUR	1,750 %	14/01/2025	33.910.879	0,20
2.750.000	Scania CV AB	EUR	0,500 %	06/10/2023	28.472.334	0,17
					90.367.187	0,53
Suiza	0 ( ); 0 ; 0 ; 10 (5)	000	0.405.0/	10/00/0005	05 550 770	0.45
	Crédit Suisse Group AG(c)	GBP	2,125 %	12/09/2025	25.552.772	0,15
	Crédit Suisse Group AG <sup>(c)</sup> Credit Suisse Group AG	EUR USD	3,250 % 4,550 %	02/04/2026 17/04/2026	30.719.571 20.550.887	0,18 0,12
	Credit Suisse Group AG  Credit Suisse Group AG 144A(c)(d)	USD	2,593 %	11/09/2025	37.265.421	0,12
7.250.000		GBP	0,625 %	18/12/2023	86.667.538	0,50
	UBS Group AG <sup>(c)</sup>	EUR	0,250 %	03/11/2026	21.196.807	0,12
	·	-			221.952.996	1,29
Tailandia	Theiril Transpur, Contar Co. Ltd.	USD	4.625.0/	20/44/2020	2 207 577	0.00
Emiratos Árab	Thaioil Treasury Center Co., Ltd.	050	4,625 %	20/11/2028	3.397.577	0,02
	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC	USD	3,650 %	02/11/2029	2.499.927	0,02
	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC	USD	4,600 %	02/11/2047	86.297.696	0,50
	DP World Plc.	USD	5,625 %	25/09/2048	7.121.431	0,04
	DP World Plc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	6,850 %	02/07/2037	1.671.659	0,01
		-			97.590.713	0,57
Reino Unido						
	Annington Funding Plc.	GBP	2,646 %	12/07/2025	34.326.496	0,20
3.750.000	Annington Funding Plc.	GBP	3,184 %	12/07/2029	48.479.138	0,28
	Assura Financing Plc.	GBP	1,500 %	15/09/2030	19.104.642	0,11
	AstraZeneca Plc.	EUR	0,750 %	12/05/2024	10.211.929	0,06
	Barclays Plc.	USD	3,684 %	10/01/2023	59.410.922	0,35
	Barclays Plc.(c)	EUR	3,375 %	02/04/2025	46.746.056	0,27
	Barclays Plc. <sup>(c)</sup> Barclays Plc. <sup>(c)</sup>	USD GBP	2,852 %	07/05/2026	98.862.612	0,58
	Barclays Pic. (c)	USD	1,700 % 2,279 %	03/11/2026 24/11/2027	21.033.031 53.134.648	0,12 0,31
	Barclays Pic. <sup>(c)</sup>	EUR	0,577 %	09/08/2029	42.494.156	0,31
	Barclays Pic. <sup>(c)</sup>	EUR	1,106 %	12/05/2032	33.697.047	0,20
	BP Capital Markets Plc.	USD	3,506 %	17/03/2025	111.081.042	0,65
	Cadent Finance Plc.	EUR	0,625 %	22/09/2024	10.392.035	0,06
	Gazprom PJSC Via Gaz Finance Plc.	USD	3,250 %	25/02/2030	19.127.821	0,11
	GlaxoSmithKline Capital Plc.	EUR	(0,277 %)	23/09/2023	10.304.759	0,06
9.850.000	HSBC Holdings Plc.(c)	USD	3,803 %	11/03/2025	94.527.609	0,55
	HSBC Holdings Plc. <sup>(c)</sup>	USD	1,645 %	18/04/2026	60.291.160	0,35
	HSBC Holdings Plc.(c)	GBP	1,750 %	24/07/2027	41.737.401	0,24
	HSBC Holdings Plc. <sup>(c)</sup>	USD	4,583 %	19/06/2029	26.817.026	0,16
	InterContinental Hotels Group Plc.	EUR	1,625 %	08/10/2024	79.547.080	0,46
	Lloyds Banking Group Plc.	EUR	1,000 %	09/11/2023	10.198.430	0,06
	Lloyds Banking Group Plc.	USD	3,750 %	11/01/2027	44.114.662	0,26
	London Stock Exchange Group Plc.	EUR	0,875 %	19/09/2024	10.252.726	0,06
	Nationwide Building Society 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	3,622 %	26/04/2023	11.977.772	0,07
0.0∠5.000	Nationwide Building Society 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	4,302 %	08/03/2029	67.072.007	0,39

Bonos - (continuación)	Tonomico	December 1 for delication	Divisor	Tin - do into nó - (a)	Fhdii(b)	Valor de mercado en	% del
Reno Unido - (continuación)   1.000.001 Nativest Group Ptc.	Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	NOK	patrimonio
1300.000 Nationwide Building Soziety H4A/WGI 48.600 Dis Nativest Group Pickin 400.000 Reywish Statement Pickin 400.000 Reyw	•	•					
8.490.00 NatWest Group Pic. 1 9.000 NatWest Group Pic. 1 12.500 Natwest Pic. 1 13.500 Nature Nat. 1 14.500 National Nat. 1 14.500 Nat. 1 14.50			USD	3 960 %	18/07/2030	13 090 349	0,08
##   ##   ##   ##   ##   ##   ##   #							0,46
1.825.000 NatiVest Group Pic. 19 4.675.000 NatiVest Group Pic. 19 1.125.000 Presevod Franco Cc, Ltd.		•					0,03
4.675.00   Nativest Group Pic.	11.125.000	NatWest Group Plc.(c)	USD	1,642 %	14/06/2027	99.721.676	0,58
1.125.000 Pinewood Finance Co., Ltd. 1.000.000 Royally Pharma Pic. 1.000.000 Royally Pic. 1.000 Royally Pic. 1.000.000 Royally Pic. 1.00000 Royally Pic. 1.000.000 Royally Pic. 1.000.000 Royally Pic. 1.0	1.825.000	NatWest Group Plc.(c)	USD	3,073 %	22/05/2028	17.312.797	0,10
1.000.000 Royaly Pharmar Pic. 1.450.000 Royaly Pharmar Pic. 1.450.000 Santander U. Group Holdings Pic. 100 USD 1.700 % 02002022 12.917.767 9.400.000 Santander U. Group Holdings Pic. 100 USD 1.532 % 2.0002022 12.917.767 1.452 1.000.000 Sentine Group Holdings Pic. 100 USD 1.532 % 2.000202 17.757.842 1.000.000 Sentine Group Holdings Pic. 100 USD 1.532 % 2.000202 17.757.842 1.000.000 Sentine Group Holdings Pic. 100 USD 1.532 % 2.000202 17.757.842 1.000.000 Sentine Group Holdings Pic. 100 USD 1.450 % 2.000.000 Sentine Group Holdings Pic. 100 USD 1.450 % 2.000.000 Sentine Group Holdings Pic. 100 USD 1.450 % 2.000.000 Sentine Group Holdings Pic. 100 USD 1.450 % 2.000.000 Sentine Group Holdings Pic. 100 USD 1.450 % 2.000.000 Sentine Group Holdings Pic. 100 USD 1.450 % 2.000.000 Sentine Group Holdings Pic. 100 USD 1.450 % 2.000.000 Sentine Group Sentine Pic. 100 USD 1.450 % 2.000.000 Sentine Group Sentine Pic. 100 USD 1.450 % 2.000.000 Sentine Group Sentine Pic. 100 USD 1.450 % 2.000.000 Sentine Group Sentine Pic. 100 USD 1.450 % 2.000.000 Sentine Group Sentine Pic. 100 USD 1.450 % 2.000.000 Sentine Group Sentine Pic. 100 USD 1.450 % 2.000.000 Sentine Group Pic. 100 USD 1.450 % 2.000 % 2.000 Sentine Group Pic. 100 USD 1.450 % 2.000 % 2.000 Sentine Group Pic. 100 USD 1.450 % 2.000 % 2.000 Sentine Group Pic. 100 USD 1.450 % 2.000 % 2.000 Sentine Group Pic. 100 USD 1.450 % 2.000 % 2.000 Sentine Group Pic. 100 USD 1.450 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 % 2.000 %							0,27
1.450.00 Royalty Pharma Pic. 9.400.00 Standarder UK Group Holdings Pic.(*) 8.625.000 Santander UK Group Pic. 9.600 Santander UK Pic.(*) 9.600 Santander							0,08
9.400.000 Santander UK Group Holdings Pic. (**) 4.005.000 Simits Group Pic. 4.005.000 Simits Simits Pic. 4.005.000 Simits Pic. 4.005.000 Simit							0,05
8 825000 Shahader UK Group Holdings Ptc. (G) 1,000.000 Stagecoach Torop Ptc. 2,000.000 Stagecoach Torop Ptc. 4,000 W 2000/2022 10.410.906 4,000 W 2000/2022 10.410.906 4,000 W 2000/2022 10.410.906 4,000 W 2000/2022 10.410.906 4,000 W 2000/2022 12.4313.438 4,000 W 2000/2022 12.4313.438 4,000 W 2000 Stage Comporter Treasury Services Ptc. 4,000 W 2000/2022 12.4313.438 4,000 W 2000/2022 12.4313.4388 4,000 W 2000/2022 12.4313.43							0,08 0,49
1.000.000 Smiths Group Pic.   EUR   1.250 %   28043/2023   10.410.906   2.300.000   Standard Chartered Pic. 144A(N°)   USD   1.456 %   1401/2027   124.913.438   975.000   Testo Corporate Treasury, Services Pic.   EUR   1.375 %   2.4704/2023   10.233.728   2.430.000   Testo Corporate Treasury, Services Pic.   EUR   1.375 %   2.7704/2023   10.233.728   2.300.000   Testo Corporate Treasury, Services Pic.   GBP   2.750 %   2.704/2030   2.303.209   3.430.800   Tratac EuroBox Pic.   EUR   0.900 %   0.9000, 2000   0.4000							0,45
2,300,000   Slagecoach Group Pic.   GBP		. •					0,06
## 1,000 Testo Corporate Treasury Services Pic. ## 1,000 Testo Corporate Treas							0,17
4.300.000   Tesco Corporate Treasury Services Pic.   GBP   2.750 %   27/04/2030   5.4 306.531	14.150.000	Standard Chartered Plc. 144A(c)(d)	USD	1,456 %	14/01/2027	124.913.438	0,73
1.850.000 Thames Water Uillities Finance Pic.   GBP 5,750 % 1300/2030 2.031.289   3.359.000 Trins Euroldox Pic.   EUR 0,375 % 2705/2024 13.907.825   4.309.000 Virgin Money UK Pic.   GBP 4,000 % 2705/2024 13.907.825   2.575.000 Voladrone Group Pic.   USD 4,375 % 3005/2028 25.534.720   2.575.000 Voladrone Group Pic.   USD 4,375 % 3005/2028 25.502.131   1.159.000 Voladrone Group Pic.   USD 5,000 % 3005/2028 15.002.837   2.505.000 Yorkshire Building Society   GBP 1,500 % 1500/2020 25.575.074    Estatos Uridos	975.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc.	EUR	1,375 %	24/10/2023	10.233.728	0,06
3.350.000 Triax EuroBox Pile.  1.350.000 Virgim Money UK Pic (6)  2.575.000 Vordatine Group Pile.  1.150.000 Vordatine Group Vordatine Vordat		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					0,32
1.350.000 Virgin Money UK Pic. (□ GPP 4.000 % 27/05/2024 13.907 825 5.43,720 0.257 5.000 Volations Group Pic. USD 4.375 % 30/05/2028 25.534,720 11.590.000 Volations Group Pic. USD 5.000 % 15/06/2029 25.975 074 11.590.000 Volations Group Pic. USD 5.000 % 15/06/2029 25.975 074 11.590.000 Volations Group Pic. USD 5.000 % 15/06/2029 25.975 074 11.590.000 Volations Group Pic. USD 1.500 % 15/06/2029 25.975 074 11.590.000 Volations Group Pic. USD 1.500 % 15/06/2029 25.975 074 11.590.000 Volations Group Pic. USD 1.500 % 15/06/2029 25.975 074 11.500.000 Volations Group Pic. USD 1.500 % 15/06/2029 25.975 074 11.500.000 Volations Group Pic. USD 1.500 % 11.005/2025 59.2729.122 11.500 % 11.005/2025 45.975 074 11.500 % 11.500 % 11.005/2025 45.975 074 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11.500 % 11							0,13
4.300.000 Virgin Money UK Pip. (**)							0,20
2.575.000 Voldsfore Group PIc.							0,08
1.150.000 Vodafone Group Pic.   USD   5,000 %   3005/2038   13.082.887   1,946.171.367   1		•					0,32 0,15
Estados Unidos		•					0,13
Estados Unidos		·					0,15
Estados Unidos	2.200.000	Tomorino Dananig Gooloty	-	1,000 /0	10/00/2020		11,33
6.100.000 AbbVe, Inc. 5.0000 AbbVe, Inc. 5.0000 AbbVe, Inc. 5.750.000 Alr Lease Corp. 5.750.000 Ally Financial, Inc. 5.750.000 American International Group, Inc. 5.750.000 Americ	Estados Unido	es				1.540.17 1.507	11,00
5.750.000 AbbVe, Inc. 2.450.000 AbbVe, Inc. 2.450.000 AbbVe, Inc. 3.400.000 American International Group, Inc. 3.575.000 American International Gro			USD	3,600 %	14/05/2025	59.229.123	0,34
2.450.000 AbDVe, Inc.  1.000.000 Aprel P.  1.000.000 Art Lease Corp.  1.0000.000 Art Lease Corp.  1.000.000 Art Lease Corp.  1.000.000 Art Lease Corp.  1.000.000 Art Lease Corp.  1.000.000 Art Lease Corp.  1.00000 Art Lease Corp.  1.00000 Art Lease Corp.  1.00000 A	50.000	AbbVie, Inc.	USD	3,200 %	14/05/2026	481.863	0,00
8.100.000 AbbVe, Inc. 1.000.000 Agre LP 1.000.000 Ar Lease Corp. 1.0000.000 Ar Lease Corp. 1.0000 Ar Lease	5.750.000	AbbVie, Inc.	USD	4,050 %	21/11/2039	59.992.089	0,35
1,000,000   Agree   P	2.450.000	AbbVie, Inc.		4,875 %	14/11/2048	29.044.428	0,17
4,800,000   Air Lease Corp.   USD   3,000 %   15/09/2023   45,030,333   3375 000   Air Lease Corp.   USD   2,875 %   15/01/2026   81,946,229   60,000.000   Air Lease Corp.   USD   2,875 %   01/08/2026   53,112.737   3250,000   Aily Financial, Inc.   USD   1,450 %   02/10/2023   29,745,733   300,000   American Homes 4 Rent LP   USD   1,450 %   02/10/2023   29,745,733   71,70,195   5,375,000   American Indemational Group, Inc.   USD   2,375 %   15/07/2021   7,170,195   5,375,000   American International Group, Inc.   USD   3,900 %   01/04/2026   51,159,702   2,625,000   American International Group, Inc.   USD   4,200 %   01/04/2026   51,159,702   2,625,000   American International Group, Inc.   USD   4,200 %   01/04/2026   51,159,702   3,400,000   American International Group, Inc.   USD   4,375 %   30/06/2050   39,029,306   1,225,000   American International Group, Inc.   USD   4,375 %   30/06/2050   39,029,306   1,225,000   American International Group, Inc.   USD   4,400 %   01/06/2025   11,939,321   4,425,000   American Tower Corp.   USD   4,400 %   15/02/2026   44,197,901   1,000,000   American Tower Corp.   USD   4,400 %   15/02/2026   33,150,000   American Tower Corp.   USD   4,400 %   10/01/2026   33,150,000   Art Capital Finance LLC   USD   4,100 %   10/11/2022   13,928,855   1,000,000   Art Tinc.   USD   4,400 %   10/11/2022   31,762,549   1,000,000   Art Tinc.   USD   4,100 %   15/02/2028   4,197,901   1,000,000   Art Tinc.   USD   4,100 %   15/02/2023   31,765,674   2,260,000   Art Tinc.   USD   4,100 %   15/02/2023   31,765,674   2,260,000   Art Tinc.   USD   4,100 %   15/02/2023   31,765,674   2,260,000   Art Tinc.   USD   4,900 %   15/03/2021   34,808,389   34,975   3,250,000   Art Tinc.   USD   4,900 %   15/03/2021   34,808,389   34,975   3,250,000   Art Tinc.   USD   4,900 %   15/06/2045   2,251,738   3,255,000   3,255,000   3,255,000   3,255,000   3,255,000   3,255,000   3,255,000   3,255,000   3,255,000   3,255,000   3,255,000   3,255,000   3,255,000   3,255,000   3,255,000   3,255,000   3,2							0,52
8,750,000 Air Lease Corp. 6,000,000 Air Lease Corp. 1,000,000 Air Lease Corp. 1,000,000 Air Lease Corp. 1,000,000 Air Lease Corp. 1,000 American Hormational Group, Inc. 1,000 American Hormational Group, Inc. 1,000 American International Group, Inc. 1,000 American Tower Corp. 1,000 American		-					0,05
6.000.000 Air Lease Corp. 3.250.000 Ally Financial, Inc. BO0.000 American Homes 4 Rent LP USD 1,450 % 02/10/2023 29.745.733 90.000 American Homes 4 Rent LP USD 2,375 % 15/07/2031 7.170.195 5.375.000 American Homes 4 Rent LP USD 2,375 % 15/07/2031 7.170.195 5.375.000 American International Group, Inc. USD 3,500 % 08/06/2023 56.255.534 05.150.000 American International Group, Inc. USD 4,000 % 01/04/2026 51.595.002 26.265.000 American International Group, Inc. USD 4,200 % 01/04/2026 51.595.002 29.293.66 01/04/2028 26.990.427 03.400.000 American International Group, Inc. USD 4,000 % 01/04/2028 26.990.427 03.400.000 American International Group, Inc. USD 4,000 % 01/06/2025 11.993.821 04.250.000 American Tower Corp. USD 4,000 % 01/06/2025 11.993.821 04.250.000 American Tower Corp. USD 4,400 % 01/06/2025 11.993.821 04.250.000 American Tower Corp. USD 4,400 % 01/06/2025 11.993.821 04.250.000 American Tower Corp. USD 4,400 % 01/06/2025 11.993.821 04.250.000 American Tower Corp. USD 4,400 % 01/06/2025 11.993.821 04.250.000 American Tower Corp. USD 4,400 % 01/06/2025 11.993.821 04.250.000 American Tower Corp. USD 4,400 % 01/06/2025 11.993.821 04.250.000 Aric Capital Finance LLC USD 4,000 % 10/06/2025 10.392.855 03.150.000 Aric Capital Finance LLC USD 4,000 % 15/06/2026 10.250.000 Aric Capital Finance LLC USD 4,000 % 15/06/2026 10.250.000 Aric Capital Finance LLC USD 4,000 % 15/06/2027 37.508.542 04.250.000 Aric Tinc. USD 4,100 % 15/06/2026 26.281.738 07.150.000 Aric Tinc. USD 4,100 % 15/06/2027 37.508.542 07.250.000 Aric Tinc. USD 4,900 % 15/06/2027 37.598.542 07.250.000 Aric Tinc. USD 4,900 % 15/06/2027 37.599.460 07.050.000 Aric Tinc. USD 4,900 % 15/06/2026 26.281.738 07.250.000 Aric Tinc. USD 4,900 % 15/06/2026 50.344.075 07.250.000 Aric Tinc. USD 4,900 % 15/06/2026 50.344.075 07.250.000 Aric Tinc. USD 4,500 Aric Tinc. USD 4,500 Aric Tinc. USD 4,500 Aric		•					0,26
3.25.000 Ally Financial, Inc.  800.000 American Homes 4 Rent L P  S.375.000 American International Group, Inc.  5.375.000 American International Group, Inc.  5.165.000 American Tower Corp.  5.165.000 American Tower Corp.  5.165.000 American Tower Corp.  5.175.000 Artican Tower Corp.  5.175		•					0,48
800.000 American Homes 4 Rent LP USD 2,375 % 15/07/2031 7,170.195 5.375.000 American International Group, Inc. EUR 1,500 % 08/08/2023 56.253.534 5.150.000 American International Group, Inc. USD 3,900 % 01/04/2026 51.159.702 2.625.000 American International Group, Inc. USD 4,200 % 01/04/2028 26.990.427 3.400.000 American International Group, Inc. USD 4,000 % 01/06/2025 26.990.427 3.400.000 American Tower Corp. USD 4,000 % 01/06/2025 11.993.821 4.425.000 American Tower Corp. USD 4,000 % 01/06/2025 11.993.821 4.425.000 American Tower Corp. USD 4,000 % 01/06/2025 41.997.901 3.757.000 Amgen, Inc. USD 4,000 % 01/06/2021 41.997.901 3.758.000 Arta, Inc. USD 4,000 % 05/09/2023 10.457.467 3.758.000 Arta, Inc. USD 4,000 % 15/09/2023 10.457.467 3.758.000 Arta, Inc. USD 4,000 % 15/09/2023 26.994.075 5.200.000 Arta, Inc. USD 4,000 % 15/09/2023 26.994.075 5.200.000 Arta, Inc. USD 4,900 % 15/09/2021 48.986.399 1.758.000 Arta, Inc. USD 4,900 % 15/09/2021 14.808.399 1.758.000 Arta, Inc. USD 4,900 % 15/09/2021 14.993.780 1.758.000 Arta, Inc. USD 4,900 % 15/09/2021 14.993.780 1.758.000 Arta, Inc. USD 4,900 % 15/09/2021 14.993.780 1.758.000 Arta, Inc. USD 4,900 % 15/09/2021 15.198.213 1.259.000 Arta, Inc. USD 4,900 % 15/09/2021 15.198.213 1.259.000 Arta, Inc. USD 4,900 % 15/09/2024 12.719.937 1.259.000 Arta, Inc. USD 4,900 % 15/09/2025 15.999.110 3.250.000 Arta, Inc. USD 4,950 % 15/06/2045 20.999.2025 1.159.000 Arta, Inc. USD 4,950 % 15/06/2045 20.999.2025 1.159.000 Arta, Inc. USD 4,950 % 15/06/2045 20.999.2025 1.159.000 Arta, Inc. USD 3,950 % 15/06/2045 20.999.2025 1.159.000 Arta, Inc. USD 3,950 % 15/06/2045 20.999.2025 1.159.000 Arta, Inc. USD 3		•					0,34 0,17
5.375.000 American International Group, Inc. 5.150.000 AT&T. Inc. 5.150.							0,04
5.150.000 American International Group, Inc.							0,33
3.400.000 American International Group, Inc. 1.255.000 American Tower Corp. 1.255.000 Armore American Corp. 1.255.		• •					0,30
1.225.000       American Tower Corp.       USD       4,000 %       01/06/2025       11.993.821         4.425.000       American Tower Corp.       USD       4,400 %       15/02/2026       44.197.901         3.575.000       Ameline.       USD       4,400 %       01/05/2045       39.112.121         1.000.000       Apple, Inc.       EUR       1,000 %       10/11/2022       10.392.855         3.150.000       Arch Capital Finance LLC       USD       4,011 %       15/12/2026       31.762.549         1.000.000       AT&T, Inc.       EUR       1,050 %       05/09/2023       10.457.467         2.650.000       AT&T, Inc.       GBP       5,500 %       15/03/2027       37.508.542         2.650.000       AT&T, Inc.       USD       4,100 %       15/02/2028       89.34.075         5.200.000       AT&T, Inc.       USD       2,750 %       01/06/2031       48.086.389         7.150.000       AT&T, Inc.       USD       4,900 %       15/08/2042       62.821.738         1.250.000       AT&T, Inc.       USD       4,900 %       15/08/2043       19.435.352         2.000.000       AT&T, Inc.       USD       4,900 %       15/08/2046       20.722.125         1.150.000	2.625.000	American International Group, Inc.	USD	4,200 %	01/04/2028	26.990.427	0,16
4.425.000       American Tower Corp.       USD       4,400 %       15/02/2026       44.197.901       3.575.000       American Tower Corp.       39.112.121       1.000 %       10/11/2022       392.152.121       1.0392.855       3.150.000       Arch Capital Finance LLC       USD       4,011 %       15/12/2026       31.762.549       1.000.000       AT&T, Inc.       EUR       1,050 %       05/09/2023       10.457.467       2.600.000       AT&T, Inc.       EUR       1,050 %       05/09/2023       10.457.467       2.600.000       AT&T, Inc.       EUR       1,050 %       05/09/2023       10.457.467       4.600 %       15/03/2027       37.508.542       2.650.000       AT&T, Inc.       USD       4,100 %       15/03/2027       37.508.542       2.650.000 AT&T, Inc.       USD       4,100 %       15/03/2023       3.508.542       2.650.000 AT&T, Inc.       USD       2,750 %       01/06/2031       48.086.389       7.150.000 AT&T, Inc.       USD       2,750 %       01/06/2031       48.086.389       1.250.000 AT&T, Inc.       USD       4,900 %       15/06/2042       19.435.352       2.200.000 AT&T, Inc.       USD       4,900 %       15/06/2043       19.435.352       2.000.000 AT&T, Inc.       USD       4,350 %       15/06/2045       20.722.125       1.150.000 AT&T, Inc.       USD       4,750 %				4,375 %		39.029.306	0,23
3.575.000 Amgen, Inc. 1.000.000 Apple, Inc. 1.000.000 Apple, Inc. 1.000.000 Apple, Inc. 1.000.000 Apple, Inc. 1.000.000 Arbording Finance LLC 1.000.000 Arbording Finance LLC 1.000.000 Arbording Finance LLC 1.000.000 AT&T, Inc. 1.000.000 AT&		•					0,07
1.000.000 Apple, Inc. 3.150.000 Arch Capital Finance LLC 3.150.000 Arch Capital Finance LCC 3.150.000 Arch Capital Finance LCCC 3.150.000 Arch Capital Finance LCCC 3.150.000 Arch Capital Finance LCCC 3.150.000 Arch Capital Finance LCCCC 3.150.000 Arch Capital Finance LCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCC		·					0,26
3.150.000 Arch Capital Finance LLC 1.000.000 Arch Capital Finance 1.000.000 Arch Capital Finance 1.000.000 Arch Capital Finance 1.000.000 Arch Capital Finance 1.000.000 Arch Finance							0,23
1.000.000 AT&T, Inc. 2.600.000 AT&T, Inc. 2.600.000 AT&T, Inc. 2.600.000 AT&T, Inc. 3.500.000							0,06 0,19
2.600.000 AT&T, Inc. 2.600.000 AT&T, Inc. 3.7508.542 2.650.000 AT&T, Inc. 3.7508.542 3.7508.542 3.7508.542 3.7508.542 3.7508.000 AT&T, Inc. 3.7508.542 3.7508.000 AT&T, Inc. 3.750.000 AT&T, Inc. 3.75		·					0,19
2.650.000 AT&T, Inc. 5.200.000							0,22
5.200.000       AT&T, Inc.       USD       2,750 %       01/06/2031       48.086.389         7.150.000       AT&T, Inc.       USD       2,250 %       01/02/2032       62.821.738         1.250.000       AT&T, Inc.       USD       4,900 %       15/08/2037       13.739.460         1.750.000       AT&T, Inc.       USD       4,900 %       15/06/2042       19.435.352         2.000.000       AT&T, Inc.       USD       4,350 %       15/06/2045       20.722.125         1.150.000       AT&T, Inc.       USD       4,850 %       15/07/2045       12.719.937         800.000       AT&T, Inc.       USD       4,750 %       15/05/2046       8.865.271         1.250.000       AT&T, Inc.       USD       5,450 %       01/06/2047       15.108.213         5.325.000       AT&T, Inc.       USD       5,450 %       01/06/2051       50.346.095         4.875.000       AT&T, Inc.       USD       3,650 %       01/06/2051       50.346.095         4.875.000       Attene Global Funding       EUR       1,125 %       02/09/2025       51.590.110         325.000       Attene Global Funding       EUR       1,950 %       01/08/2035       51.590.110         4.775.000       AutoN							0,16
1.250.000       AT&T, Inc.       USD       4,900 %       15/08/2037       13.739.460         1.750.000       AT&T, Inc.       USD       4,900 %       15/06/2042       19.435.352         2.000.000       AT&T, Inc.       USD       4,350 %       15/06/2045       20.722.125       15/06/2045       20.722.125       15/06/2045       20.722.125       15/05/2046       15/06/2045       20.722.125       15/05/2046       15/07/2045       12.719.937       80.000       AT&T, Inc.       USD       4,850 %       15/05/2046       8.865.271       1.250.000       AT&T, Inc.       USD       5,450 %       01/03/2047       15.108.213       0.000       15/05/2046       8.865.271       1.250.000       AT&T, Inc.       USD       3,650 %       01/06/2051       50.346.095       0.000       1.250.000       0.000/2025       51.590.110       0.000       1.000       0.000       1.000/2026       51.590.110       0.000       1.000       0.000       0.000/2025       51.590.110       0.000       0.000       0.000       0.000/2025       51.590.110       0.000       0.000       0.000/2025       51.590.110       0.000       0.000       0.000       0.000       0.000       0.000       0.000       0.000       0.000       0.000       0.000       0.000				2,750 %	01/06/2031	48.086.389	0,28
1.750.000       AT&T, Inc.       USD       4,900 %       15/06/2042       19.435.352         2.000.000       AT&T, Inc.       USD       4,350 %       15/06/2045       20.722.125         1.150.000       AT&T, Inc.       USD       4,850 %       15/07/2045       12.719.937         800.000       AT&T, Inc.       USD       4,750 %       15/05/2046       8.865.271         1.250.000       AT&T, Inc.       USD       5,450 %       01/03/2047       15.108.213         5.325.000       AT&T, Inc.       USD       3,650 %       01/06/2051       50.346.095         4.875.000       Athene Global Funding       EUR       1,125 %       02/09/2025       51.590.110         325.000       AutoNation, Inc.       USD       1,950 %       01/08/2028       2.894.355         4.725.000       AutoNation, Inc.       USD       4,750 %       01/06/2030       49.911.757         4.700.000       Bank of America Corp. (c)       USD       3,366 %       23/01/2026       45.204.751         6.050.000       Bank of America Corp.       USD       3,648 %       31/03/2029       36.392.070         3.250.000       Bank of America Corp.       USD       5,875 %       07/02/2042       42.463.743							0,37
2.000.000       AT&T, Inc.       USD       4,350 %       15/06/2045       20.722.125       1.150.000       AT&T, Inc.       USD       4,850 %       15/07/2045       12.719.937       800.000       AT&T, Inc.       USD       4,750 %       15/05/2046       8.865.271       1.250.000       AT&T, Inc.       USD       5,450 %       01/03/2047       15.108.213       15.108.213       15.2325.000       AT&T, Inc.       USD       3,650 %       01/06/2051       50.346.095       15.09.211       15.09.211       10.209/2025       51.590.110       10.209/2025       51.590.110       10.209/2025       15.590.110       10.209/2025       15.590.110       10.209/2025       15.590.110       10.209/2025       15.590.110       10.209/2025       15.590.110       10.209/2025       15.590.110       10.209/2025       15.590.110       10.209/2025       15.590.110       10.209/2025       15.590.110       10.209/2025       15.590.110       10.209/2025       15.590.110       10.209/2025       15.590.110       10.209/2025       15.590.110       10.209/2025       15.590.110       10.209/2025       15.590.110       10.209/2025       15.590.110       10.209/2025       15.590.110       10.209/2025       15.590.110       10.209/2025       15.590.110       10.209/2025       10.209/2025       10.209/2025       10.209/2025							0,08
1.150.000       AT&T, Inc.       USD       4,850 %       15/07/2045       12.719.937         800.000       AT&T, Inc.       USD       4,750 %       15/05/2046       8.865.271         1.250.000       AT&T, Inc.       USD       5,450 %       01/03/2047       15.108.213         5.325.000       AT&T, Inc.       USD       3,650 %       01/06/2051       50.346.095         4.875.000       Athene Global Funding       EUR       1,125 %       02/09/2025       51.590.110         325.000       AutoNation, Inc.       USD       1,950 %       01/08/2028       2.894.355         4.725.000       AutoNation, Inc.       USD       4,750 %       01/06/2030       49.911.757         4.700.000       Bank of America Corp. (c)       USD       3,366 %       23/01/2026       45.204.751         6.050.000       Bank of America Corp.       USD       3,650 %       01/06/2030       49.911.757         4.700.000       Bank of America Corp.       USD       3,666 %       23/01/2026       45.204.751         6.050.000       Bank of America Corp. (c)       USD       3,648 %       31/03/2029       36.392.070         3.250.000       Bank of America Corp.       USD       5,875 %       07/02/2042       42.463.743 </td <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td>0,11</td>							0,11
800.000       AT&T, Inc.       USD       4,750 %       15/05/2046       8.865.271         1.250.000       AT&T, Inc.       USD       5,450 %       01/03/2047       15.108.213         5.325.000       AT&T, Inc.       USD       3,650 %       01/06/2051       50.346.095         4.875.000       Athene Global Funding       EUR       1,125 %       02/09/2025       51.590.110         325.000       AutoNation, Inc.       USD       1,950 %       01/08/2028       2.894.355         4.725.000       AutoNation, Inc.       USD       4,750 %       01/06/2030       49.911.757         4.700.000       Bank of America Corp. (c)       USD       3,366 %       23/01/2026       45.204.751         6.050.000       Bank of America Corp.       USD       3,500 %       19/04/2026       59.349.448         3.000.000       Bank of America Corp.       EUR       3,648 %       31/03/2029       36.392.070         3.250.000       Bank of America Corp.       USD       5,875 %       07/02/2042       42.463.743         1.800.000       Baxer International, Inc.       EUR       0,400 %       15/05/2024       48.25.545         5.165.000       Becton Dickinson and Co.       USD       3,363 %       06/06/2024 <td< td=""><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td>0,12</td></td<>							0,12
1.250.000       AT&T, Inc.       USD       5,450 %       01/03/2047       15.108.213         5.325.000       AT&T, Inc.       USD       3,650 %       01/06/2051       50.346.095         4.875.000       Athene Global Funding       EUR       1,125 %       02/09/2025       51.590.110         325.000       AutoNation, Inc.       USD       1,950 %       01/08/2028       2.894.355         4.725.000       AutoNation, Inc.       USD       4,750 %       01/06/2030       49.911.757         4.700.000       Bank of America Corp. (c)       USD       3,366 %       23/01/2026       45.204.751         6.050.000       Bank of America Corp.       USD       3,500 %       19/04/2026       59.349.448         3.000.000       Bank of America Corp.       USD       3,648 %       31/03/2029       36.392.070         3.250.000       Bank of America Corp.       USD       5,875 %       07/02/2042       42.463.743         1.800.000       Baxter International, Inc.       EUR       0,400 %       15/05/2024       48.625.545         5.165.000       Becton Dickinson and Co.       USD       3,363 %       06/06/2024       49.355.715         1.196.000       Berkshire Hathaway Energy Co.       USD       6,125 %       0							0,07 0,05
5.325.000       AT&T, Inc.       USD       3,650 %       01/06/2051       50.346.095         4.875.000       Athene Global Funding       EUR       1,125 %       02/09/2025       51.590.110         325.000       AutoNation, Inc.       USD       1,950 %       01/08/2028       2.894.355         4.725.000       AutoNation, Inc.       USD       4,750 %       01/06/2030       49.911.757         4.700.000       Bank of America Corp. (c)       USD       3,366 %       23/01/2026       45.204.751         6.050.000       Bank of America Corp.       USD       3,500 %       19/04/2026       59.349.448         3.000.000       Bank of America Corp.       EUR       3,648 %       31/03/2029       36.392.070         3.250.000       Bank of America Corp.       USD       5,875 %       07/02/2042       42.463.743         1.800.000       Baxter International, Inc.       EUR       0,400 %       15/05/2024       18.625.545         5.165.000       Becton Dickinson and Co.       USD       3,363 %       06/06/2024       49.355.715         1.196.000       Berkshire Hathaway Energy Co.       USD       6,125 %       01/04/2036       14.893.495         1.850.000       Biogen, Inc.       USD       2,250 % <td< td=""><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td>0,05</td></td<>							0,05
4.875.000 Athene Global Funding       EUR       1,125 %       02/09/2025       51.590.110         325.000 AutoNation, Inc.       USD       1,950 %       01/08/2028       2.894.355         4.725.000 AutoNation, Inc.       USD       4,750 %       01/06/2030       49.911.757         4.700.000 Bank of America Corp. (c)       USD       3,366 %       23/01/2026       45.204.751         6.050.000 Bank of America Corp.       USD       3,600 %       19/04/2026       59.349.448         3.000.000 Bank of America Corp.       EUR       3,648 %       31/03/2029       36.392.070         3.250.000 Bank of America Corp.       USD       5,875 %       07/02/2042       42.463.743         1.800.000 Baxter International, Inc.       EUR       0,400 %       15/05/2024       18.625.545         5.165.000 Becton Dickinson and Co.       USD       3,363 %       06/06/2024       49.355.715         1.196.000 Berkshire Hathaway Energy Co.       USD       6,125 %       01/04/2036       14.893.495         1.850.000 Biogen, Inc.       USD       2,250 %       01/05/2030       16.559.669							0,29
325.000 AutoNation, Inc.  4.725.000 AutoNation, Inc.  USD 1,950 % 01/08/2028 2.894.355 4.725.000 AutoNation, Inc.  USD 4,750 % 01/06/2030 49.911.757 4.700.000 Bank of America Corp. (c)  6.050.000 Bank of America Corp.  USD 3,360 % 23/01/2026 45.204.751 6.050.000 Bank of America Corp.  USD 3,500 % 19/04/2026 59.349.448 3.000.000 Bank of America Corp. (c)  3.250.000 Bank of America Corp.  USD 5,875 % 07/02/2042 42.463.743 6.050.000 Bank of America Corp.  USD 5,875 % 07/02/2042 42.463.743 6.050.000 Baxter International, Inc.  EUR 0,400 % 15/05/2024 18.625.545 6.165.000 Becton Dickinson and Co.  USD 3,363 % 06/06/204 49.355.715 6.165.000 Berkshire Hathaway Energy Co.  USD 6,125 % 01/04/2036 14.893.495 6.125 % 01/05/2030 16.559.669							0,30
4.700.000       Bank of America Corp. (c)       USD       3,366 %       23/01/2026       45.204.751       6.050.001       6.050.000       Bank of America Corp.       USD       3,500 %       19/04/2026       59.349.448       3.000.000       Bank of America Corp. (c)       EUR       3,648 %       31/03/2029       36.392.070       3.250.000       Bank of America Corp.       USD       5,875 %       07/02/2042       42.463.743       42.463.743       42.463.743       42.463.743       43.250.000       45.25.45       45.25.45       45.25.45       45.25.45       45.25.45       45.25.45       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715       49.355.715		•					0,02
6.050.000 Bank of America Corp.  19/04/2026 59.349.448 3.000.000 Bank of America Corp. EUR 3,648 % 31/03/2029 36.392.070 3.250.000 Bank of America Corp.  1800.000 Bank of America Corp.  18625.545 5.165.000 Becton Dickinson and Co.  1980 3,363 % 06/06/2024 49.355.715 1.196.000 Berkshire Hathaway Energy Co.  1800.000 Biogen, Inc.  1800.000 Biogen, Inc.							0,29
3.000.000 Bank of America Corp. (c) 3.250.000 Bank of America Corp. 3.250.000 Bank of America Corp. 4.2 463.743 1.800.000 Baxter International, Inc. 5.165.000 Becton Dickinson and Co. 1.196.000 Berkshire Hathaway Energy Co. 1.196.000 Biogen, Inc. USD 2,250 % 01/05/2030 16.559.669		·					0,26
3.250.000     Bank of America Corp.     USD     5,875 %     07/02/2042     42.463.743       1.800.000     Baxter International, Inc.     EUR     0,400 %     15/05/2024     18.625.545       5.165.000     Becton Dickinson and Co.     USD     3,363 %     06/06/2024     49.355.715       1.860.000     Berkshire Hathaway Energy Co.     USD     6,125 %     01/04/2036     14.893.495       1.850.000     Biogen, Inc.     USD     2,250 %     01/05/2030     16.559.669							0,35
1.800.000     Baxter International, Inc.     EUR     0,400 %     15/05/2024     18.625.545       5.165.000     Becton Dickinson and Co.     USD     3,363 %     06/06/2024     49.355.715       1.196.000     Berkshire Hathaway Energy Co.     USD     6,125 %     01/04/2036     14.893.495       1.850.000     Biogen, Inc.     USD     2,250 %     01/05/2030     16.559.669		·					0,21
5.165.000 Becton Dickinson and Co.       USD       3,363 %       06/06/2024       49.355.715       0.000 Berkshire Hathaway Energy Co.       USD       6,125 %       01/04/2036       14.893.495       0.000 Biogen, Inc.       USD       2,250 %       01/05/2030       16.559.669       0.000 Biogen, Inc.		•					0,25
1.196.000     Berkshire Hathaway Energy Co.     USD     6,125 %     01/04/2036     14.893.495       1.850.000     Biogen, Inc.     USD     2,250 %     01/05/2030     16.559.669							0,11 0,29
1.850.000 Biogen, Inc. USD 2,250 % 01/05/2030 16.559.669							0,29
		,					0,10
7.766.000 Capital One Financial Corp. EUR 0,800 % 12/06/2024 81.133.836			EUR	0,800 %	12/06/2024	81.133.836	0,47

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en NOK	% del
Bonos - (cor						
•	os – (continuación)					
9.350.000	Carrier Global Corp. – Serie WI	USD	2,722 %	15/02/2030	86.940.948	0,51
	Centene Corp.	USD	3,000 %	15/10/2030	15.204.281	0,09
1.200.000	Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications Operating Capital	USD	4,500 %	01/02/2024	11.637.636	0,07
6 225 000	Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications	030	4,500 /6	01/02/2024	11.037.030	0,07
0.220.000	Operating Capital	USD	4,800 %	01/03/2050	63.916.822	0,37
1.000.000	Citigroup, Inc.	EUR	0,750 %	26/10/2023	10.401.675	0,06
	Citigroup, Inc.	GBP	2,750 %	24/01/2024	21.130.671	0,12
	Citigroup, Inc. <sup>(c)</sup>	USD	0,776 %	30/10/2024	40.531.098	0,24
	Citigroup, Inc. Citigroup, Inc. <sup>(c)</sup>	USD USD	3,200 %	21/10/2026 24/07/2028	38.140.585 17.435.406	0,22 0,10
	Citigroup, Inc.(c)	USD	3,668 % 3,520 %	27/10/2028	26.572.378	0,10
	Citigroup, Inc. (c)	USD	4,412 %	31/03/2031	47.535.669	0,28
	Citizens Bank NA	USD	2,250 %	28/04/2025	29.048.478	0,17
7.375.000	Citrix Systems, Inc.	USD	3,300 %	01/03/2030	68.168.535	0,40
	Crown Castle International Corp.	USD	3,650 %	01/09/2027	26.723.086	0,16
	CVS Health Corp.	USD	3,875 %	20/07/2025	157.164	0,00
	CVS Health Corp.	USD	4,780 %	25/03/2038	22.821.481	0,13
	CVS Health Corp.  Dell International LLC Via EMC Corp.	USD USD	5,050 % 6,020 %	25/03/2048 15/06/2026	40.673.784 38.285.820	0,24 0,22
	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	5,300 %	01/10/2029	12.737.269	0,22
	Dell International LLC Via EMC Corp.	USD	6,200 %	15/07/2030	52.369.309	0,30
	Dentsply Sirona, Inc.	USD	3,250 %	01/06/2030	43.308.615	0,25
1.100.000	Devon Energy Corp.	USD	5,850 %	15/12/2025	11.492.282	0,07
	Devon Energy Corp.	USD	5,600 %	15/07/2041	16.035.429	0,09
	Devon Energy Corp.	USD	4,750 %	15/05/2042	4.692.696	0,03
	Devon Energy Corp.	USD	5,000 %	15/06/2045	1.654.995	0,01
	Diamondback Energy, Inc. Diamondback Energy, Inc.	USD USD	4,750 % 3,500 %	31/05/2025 01/12/2029	61.437.118 42.586.568	0,36 0,25
	Dollar Tree, Inc.	USD	4,000 %	15/05/2025	38.293.856	0,23
	DuPont de Nemours, Inc.	USD	4,493 %	15/11/2025	42.837.969	0,25
	DuPont de Nemours, Inc.	USD	5,419 %	15/11/2048	8.332.430	0,05
975.000	Eastman Chemical Co.	EUR	1,500 %	26/05/2023	10.190.930	0,06
	Ecolab, Inc.	EUR	1,000 %	15/01/2024	10.211.029	0,06
	Elanco Animal Health, Inc.	USD	5,272 %	28/08/2023	15.932.369	0,09
	Enterprise Products Operating LLC	USD	4,850 %	15/03/2044	24.217.330	0,14
	Expedia Group, Inc. Expedia Group, Inc.	USD USD	4,500 % 3,800 %	15/08/2024 15/02/2028	26.161.407 52.051.657	0,15 0,30
	Expedia Group, Inc.	USD	2,950 %	15/03/2031	3.902.412	0,02
	Fidelity National Information Services, Inc.	EUR	0,750 %	21/05/2023	28.528.741	0,17
	Fidelity National Information Services, Inc.	EUR	1,100 %	15/07/2024	10.226.228	0,06
	Fidelity National Information Services, Inc.	EUR	0,625 %	03/12/2025	22.305.832	0,13
	Fiserv, Inc.	EUR	0,375 %	01/07/2023	10.320.040	0,06
	Fisery, Inc.	GBP	2,250 %	01/07/2025	26.161.069	0,15
	Ford Motor Credit Co., LLC	USD USD	3,219 %	09/01/2022	84.855.032	0,49
	Fox Corp. GE Capital Funding LLC	USD	4,709 % 4,050 %	25/01/2029 15/05/2027	26.085.112 45.245.543	0,15 0,26
	General Electric Co.	EUR	1,250 %	26/05/2023	10.445.980	0,26
	General Motors Co.	USD	5,000 %	01/04/2035	16.758.151	0,10
2.204.000	General Motors Co.	USD	6,600 %	01/04/2036	27.133.406	0,16
1.000.000	General Motors Financial Co., Inc.	EUR	0,955 %	07/09/2023	10.414.905	0,06
	General Motors Financial Co., Inc.	EUR	2,200 %	01/04/2024	51.004.828	0,30
	General Motors Financial Co., Inc.	EUR	0,600 %	20/05/2027	43.947.097	0,26
	General Motors Financial Co., Inc.	USD	5,650 %	17/01/2029	11.940.989	0,07
	General Motors Financial Co., Inc. Gilead Sciences, Inc.	USD USD	2,350 % 3,650 %	08/01/2031 01/03/2026	35.056.842 42.707.225	0,20 0,25
	Halliburton Co.	USD	2,920 %	01/03/2030	78.098.494	0,45
	Healthcare Realty Trust, Inc.	USD	2,050 %	15/03/2031	16.306.492	0,10
	Hewlett Packard Enterprise Co.	USD	4,450 %	02/10/2023	21.680.138	0,13
4.255.000	Hewlett Packard Enterprise Co.	USD	4,900 %	15/10/2025	43.129.508	0,25
	Hewlett Packard Enterprise Co.	USD	6,350 %	15/10/2045	43.237.445	0,25
	Hubbell, Inc.	USD	3,500 %	15/02/2028	55.508.021	0,32
	JPMorgan Chase & Co.	EUR	0,625 %	25/01/2024	10.398.599	0,06
	JPMorgan Chase & Co.	USD	3,900 %	15/07/2025	17.243.890	0,10
	JPMorgan Chase & Co. <sup>(c)</sup> JPMorgan Chase & Co. <sup>(c)</sup>	EUR USD	1,001 % 3,882 %	25/07/2031 24/07/2038	28.893.963 42.673.864	0,17 0,25
	Keurig Dr Pepper, Inc.	USD	3,002 % 4,417 %	25/05/2025	21.922.181	0,25
	Keurig Dr Pepper, Inc.	USD	4,597 %	25/05/2028	73.376.945	0,13
	Keurig Dr Pepper, Inc.	USD	4,500 %	15/11/2045	17.199.764	0,10
	Keurig Dr Pepper, Inc.	USD	5,085 %	25/05/2048	21.397.543	0,12
6 150 000	Kinder Morgan, Inc.	USD	2,000 %	15/02/2031	52.864.914	0,31

Teach   Peach   Peac						Valor de	
	Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	mercado en	
4285.000   Lower Sca., Inc.   USD   1,700 %   1000/2026   42,291 R89   0.25   1285.000   Marroll International, Inc.   USD   3,750 %   01/10/2025   1,851 33   0.01   1390.000   Lower Marroll International, Inc.   Serie EE   USD   5,750 %   01/10/2025   1,851 33   0.01   1390.000   Lower Marroll International, Inc.   Serie EE   USD   5,750 %   01/10/2025   1,851 33   0.01   1390.000   Lower Marroll International, Inc.   Serie EE   USD   3,750 %   01/10/2025   1,851 33   0.01   1390.000   Lower Marroll International Inc.   USD   1,750 %   3001/2025   1,202 305   0.01   1390.000   Lower Marroll International Inc.   USD   1,750 %   3001/2025   1,202 305   0.00   1390.000   Longrafia Fathership I, P Vis MPT Finance Corp.   CRIP   2,205 %   00/10/2025   1,207 005   0.00   1312.000   Lower Marroll International Inc.   USD   1,900 %   1,000/2028   1,207 005   0.00   1312.000   Lower Marroll International Inc.   USD   1,900 %   1,000/2028   2,139 268   0.10   1312.000   Lower Marroll International Inc.   USD   1,900 %   1,900/2028   2,139 268   0.10   1312.000   Lower Marroll International Corp.   USD   3,200 %   1,900/2028   2,139 268   0.10   1312.000   Lower Marroll International Corp.   USD   3,200 %   1,900/2028   2,139 268   0.10   1312.000   Lower Marroll International Corp.   USD   3,200 %   1,900/2028   1,212 207   0.00   1312.000   Condential Performance Corp.   USD   3,200 %   1,900/2028   1,212 207   0.00   1312.000   Condential Performance Corp.   USD   3,200 %   1,900/2028   1,212 207   0.00   1312.000   Condential Performance Corp.   USD   3,200 %   1,900/2028   1,212 207   0.00   1312.000   Condential Performance Corp.   USD   3,000 %   0,000 %   0,000 %   0,000 %   1312.000   Condential Performance Corp.   USD   3,000 %   0,000 %   0,000 %   0,000 %   132.000   Condential Performance Corp.   USD   3,000 %   0,000 %   0,000 %   0,000 %   0,000 %   132.000   Condential Performance Corp.   USD   3,000 %   0,000 %   0,000 %   0,000 %   0,000 %   132.000   Condential Performance Corp.   USD   3,000 %   0,0	Bonos - (con	tinuación)					
2825000   Marrion Infernational, Inc.		•					
1800   Marmot Informational, Inc Serie EE   USD   5,750 %   01101620225   1,8811.33   0,01							
110000   Micro Technology Inc.							
1,990.00   Moonly's Corp.     1,922.05   0,11		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·					
7,025.000 Morgan Stanlery 2,000 Morgan Stanl		•					
250.000   Morgan Stanley				•			
1.050.00 Morgan Stanlery   USD   4.000 %   230772625   10.379.035   0.05   3.100.00 Mind Toperating Farmership L Via MPT Finance Corp.   GPP   2.550 %   05122023   38.015.90   0.22   3.100.00 Minds Inc.   EUR   0.875 %   13002/2030   32.08 2.08   0.16   3.1250.00 Morgan Stanler Energy Capital Holdings, Inc.   USD   1,900 %   15002/2025   28.139.206   0.16   3.1250.00 Morgan Stanler Energy Capital Holdings, Inc.   USD   1,900 %   15002/2025   28.139.206   0.16   3.1250.00 Morgan Stanler Corp.   USD   3,550 %   15002/2025   8.072.406   0.08   3.000.00 Cocchestral Petroleum Corp.   USD   3,550 %   15002/2025   8.072.406   0.08   3.000.00 Cocchestral Petroleum Corp.   USD   1,000 %   15002/2025   8.072.406   0.08   3.000.00 Cocchestral Petroleum Corp.   USD   1,000 %   15002/2025   8.072.406   0.08   3.000.00 Cocchestral Petroleum Corp.   USD   1,000 %   15002/2025   8.072.406   0.08   3.075.00 O Pocchestral Petroleum Corp.   USD   1,000 %   15002/2025   4.350.00 %   3.075.00 O Pocche Corp.   USD   3,000 %   0.0807/2034   4.080 %   3.075.00 O Pocche Corp.   USD   3,000 %   0.0807/2034   4.080 %   3.080.00 Pocches Corp.   USD   3,000 %   0.0807/2034   4.080 %   3.080.00 Pocches Corp.   USD   3,000 %   10002/2031   4.080 %   3.080.00 Pocches Corp.   USD   3,000 %   10002/2031   4.080 %   3.080.00 Pocches Corp.   USD   3,000 %   10002/2031   4.080 %   3.080.00 Pocches Corp.   USD   3,000 %   10002/2031   4.080 %   3.080.00 Pocches Corp.   USD   3,000 %   10002/2031   3.080 %   3.080.00 Pocches Corp.   USD   3,000 %   10002/2031   3.080 %   3.080.00 Pocches Corp.   USD   3,000 %   10002/2031   3.080 %   3.080.00 Pocches Corp.   USD   3,000 %   10002/2031   3.080 %   3.080.00 Pocches Corp.   USD   3,000 %   10002/2031   3.080 %   3.080.00 Pocches Corp.   USD   3,000 %   10002/2031   3.080 %   3.080.00 Pocches Corp.   USD   3,000 %   10002/2031   3.080 %   3.080.00 Pocches Corp.   USD   3,000 %   10002/2031   3.080 %   3.080.00 Pocches Corp.   USD   3,000 %   10002/2031   3.080 %   3.080.00 Pocches Corp.   USD   3,000							
3.100.000 MPT Operating Parthenship LP Visi MPT Finance Corp. 3.125.000 Neelfire Energy Capital Holdings, Inc. 4.100.000 Codential Parthenship LP Visi MPT Finance Corp. 4.100.000 Codential Parthenship Codential Codential C		9					
3.125.000 NetEria Energy Capital Holdings, Inc. 1.400.000 Cocidental Perfoleum Corp. 1.500 5.55 % 150.002 13.725 22 1.02 6.06 1.400.000 Cocidental Perfoleum Corp. 1.500 5.55 % 150.002 1.02 1.02 1.02 1.02 1.02 1.02 1.02						38.015.969	
1,400,000   Cocidental Percloim Corp.   USD   3,500 %   1503,202 8   13,712,582   0,08   300,000   Cocidental Percloim Corp.   USD   3,500 %   1508,202 8   07,246 %   0,05   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000			EUR		13/02/2030	32.066.201	0,19
900.000   Cocidental Petroleum Corp.   USD   3.000 %   15082029   8.072.456   0.05   3.000 %   15082029   3.12.707   0.02   1.277.000   Cocidental Petroleum Corp.   USD   8.460 %   15082029   13.12.207   0.02   0.02   1.277.000   Cocidental Petroleum Corp.   USD   1.000 %   15082029   14.456.728   0.08   0.375.000   Cocidental Petroleum Corp.   USD   4.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0.000 %   0	3.125.000	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	USD	1,900 %	15/06/2028	28.139.266	0,16
350,000   Coidental Petroleum Corp.   USD   3,500 %   150(862028   3,121,207   0,02   0,375,000   0,000   0,375,000   0,000   0,375,000   0,000   0,375,000   0,000   0,375,000   0,000   0,375,000   0,000   0,375,000   0,000   0,375,000   0,000   0,375,000   0,000   0,375,000   0,000   0,375,000   0,000   0,375,000   0,000   0,375,000   0,000   0,375,000   0,000   0,375,000   0,000   0,375,000   0,000   0,375,000   0,000   0,375,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000   0,000	1.400.000	Occidental Petroleum Corp.	USD	5,550 %	15/03/2026	13.712.582	0,08
1277 000 Condental Petroleum Corp.		·					
9.375.000 ONE Gas. Inc. 4.375.000 Oracle Corp. USD 4.300 % 0907/2034 4 5.088.056 0.082 1.525.000 Oracle Corp. USD 3.600 % 01/04/2040 14.421.005 0.08 2.075.000 PACCAR Financial Corp. USD 3.600 % 01/04/2040 14.421.005 0.08 2.075.000 PACCAR Financial Corp. USD 3.000 % 15095/2028 35.133.009 0.20 1.150.000 Pacific Gas and Electric Co. USD 3.000 % 15095/2028 35.133.009 0.20 1.150.000 Pacific Gas and Electric Co. USD 3.000 % 01/08/2028 35.133.009 0.20 2.750.000 Pacific Gas and Electric Co. USD 3.000 % 01/08/2024 3.861.12 0.02 2.750.000 Pacific Gas and Electric Co. USD 3.750 % 01/08/2040 3.861.12 0.02 2.750.000 Pacific Gas and Electric Co. USD 3.750 % 01/08/2040 3.861.12 0.02 2.750.000 Pacific Gas and Electric Co. USD 3.750 % 01/08/2040 3.861.12 0.02 2.750.000 Pacific Gas and Electric Co. USD 3.750 % 01/08/2040 3.861.12 0.02 2.750.000 Pacific Gas and Electric Co. USD 3.750 % 01/08/2040 3.861.12 0.02 2.750.000 Pacific Gas and Electric Co. USD 3.500 % 01/08/2040 3.861.12 0.02 2.750.000 Pacific Gas and Electric Co. USD 3.500 % 01/08/2040 3.861.12 0.02 2.750.000 Pacific Gas and Electric Co. USD 3.500 % 01/08/2040 3.861.12 0.02 2.750.000 Pacific Gas and Electric Co. USD 3.500 % 01/08/2040 3.861.12 0.02 2.7500.000 Pacific Gas and Electric Co. USD 3.500 % 01/08/2040 3.874.14 0.04 2.7500.000 Pacific Gas and Electric Co. USD 3.500 % 01/11/2024 12.415.791 0.07 2.700.000 Really Innome Corp. USD 3.600 % 01/11/2024 12.415.791 0.07 2.700.000 Really Innome Corp. USD 4.600 % 00/08/2024 2.000 8.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.000 6.000.2024 3.0000 6.000.2024 3.0000 6.0000.2024 3.0000 6.0000.2024 3.0000 6.0000.2024 3.0000 6.0000.2024 3.0000		·					
1,525,000 Oracle Corp.		·					
1,525,000   Charle Corp.   USD   3,600 %   01/04/2040   14,421.005   0.08   2,075.000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   3,000 %   1500/2028   35,133.069   0.20   1,500.000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   3,000 %   01/08/2034   35,133.069   0.20   450.000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   3,000 %   01/08/2040   3,861.412   0.02   875.000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   3,500 %   01/08/2040   3,861.412   0.02   875.000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   3,500 %   01/08/2060   8,222.716   0.05   1275.000   Pinorer Natural Resources Co.   USD   3,500 %   01/08/2060   8,222.716   0.05   1275.000   Pinorer Natural Resources Co.   USD   3,500 %   01/08/2060   8,222.716   0.05   13,000.000   Pinira Mal American Pipeline LP Via PAA Finance Corp.   USD   3,600 %   01/11/12024   12.415.791   0.07   0.000   Realty Income Corp.   USD   4,600 %   06/02/2024   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.54   0.05   4,800.							
2075:000   PACCAR Financial Corp.   USD   0,000 %   08111/2024   18788.865   0,11   3.850.000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   2,500 %   010/22031   9.995.770   0,06   450.000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   3,500 %   010/22031   9.995.770   0,06   450.000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   3,500 %   010/82040   3.861.412   0.02   875.000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   3,500 %   150/82042   7.534.824   0,04   095.0000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   3,500 %   150/82042   7.534.824   0,04   095.0000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   1,125 %   150/12026   11.319.461   0.07   1.300.000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   1,125 %   150/12026   11.319.461   0.07   70.000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   3,600 %   060/22024   24.15.791   0.07   70.000   Pacify Income Corp.   USD   4,600 %   060/22024   6.806.543   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.04   0.		•					
3.850.000   Pacific Gas and Ellectric Co.   USD   3.000 %   10.002.028   35.13.080   0.20		•					
1.150.000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   3,500 %   0.10/22031   9.995,570   0.06   450.000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   3,750 %   1508/2042   7,534.824   0.04   950.000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   3,500 %   1508/2042   7,534.824   0.04   950.000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   3,500 %   1508/2056   8.222.716   0.05   1.275.000   Pioneer Natural Resources Co.   USD   1,25 %   1501/2026   11.319.461   0.07   70.0000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   1,25 %   1501/2026   11.319.461   0.07   70.0000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   3,600 %   6002/2024   8.80.65.43   0.04   70.0000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   4,600 %   6002/2024   8.80.65.43   0.04   70.0000   Pacific Gas and Electric Co.   USD   4,625 %   1501/2028   38.502.908   0.22   3.450.000   Really Income Corp.   USD   3,400 %   1501/2028   33.570.468   0.02   3.450.000   Really Income Corp.   USD   3,400 %   1501/2028   33.774.548   0.20   3.750.000   Sabine Pass Liquefaction LLC   USD   5,750 %   1505/2024   38.801.892   0.21   2.255.000   Sabine Pass Liquefaction LLC   USD   5,750 %   1005/2024   38.801.892   0.21   2.255.000   Sabine Pass Liquefaction LLC   USD   5,750 %   1005/2024   38.801.892   0.21   2.255.000   Sabine Pass Liquefaction LLC   USD   5,875 %   3008/2028   22.838.624   0.13   2.255.000   Sabine Pass Liquefaction LLC   USD   5,875 %   3008/2028   22.838.624   0.13   2.255.000   Sabine Pass Liquefaction LLC   USD   3,800 %   0.109/2023   21.758.343   0.07   2.000.000   Sempla Energy   USD   3,800 %   0.109/2023   21.758.355   0.12   2.000.000   Sempla Energy   USD   3,800 %   0.109/2023   21.758.355   0.12   2.000.000   Sempla Energy   USD   3,800 %   0.109/2023   22.5399.489   0.16   2.000.000   Signific Ready U.P   USD   3,000 %   1501/2020   3.834.410   0.17   2.000.000   Signific Ready U.P   USD   3,000 %   1501/2020   3.834.42   0.12   2.000.000   Signific Ready U.P   USD   3,000 %   1501/2020   3.834.42   0.12   2.000.000   Signific Ready U.P   USD   3,000 %   1501/2020   3		•		•			
## 10000 Pacific Gas and Electric Co. ## 150000 Pacific Gas and Electric Co. ## 1500000 Pacific Gas and Electric Co. ## 15000000 Plans All American Pipeline LP Via PAA Finance Corp. ## 15000000 Plans All American Pipeline LP Via PAA Finance Corp. ## 1500000000000000000000000000000000000							
875 000 Pacific Gas and Electric Co. 950 007 Pacific Gas and Electric Co. 950 1275 000 Pioneer Natural Resources Co. 1275 000 Pioneer Research Co. 127							
980.000 Pacific Sas and Electric Co. 1275 000 Pielones Natural Resources Co. 1275 000 Really Income Corp. 1275 00							
1275.000   Pioneer Natural Resources Co.   USD   1.125 %   1501/12026   11.319.461   0.07							
200.000   Really Income Corp.	1.275.000	Pioneer Natural Resources Co.	USD		15/01/2026	11.319.461	0,07
3.800.000 Realty Income Corp.	1.300.000	Plains All American Pipeline LP Via PAA Finance Corp.	USD	3,600 %	01/11/2024	12.415.791	0,07
3.450.000   Realty Income Corp.   USD   3.400 %   15/01/2028   33.794.548   0.20	700.000	Realty Income Corp.	USD	4,600 %	06/02/2024	6.806.543	0,04
1.375.000   Realfy Income Corp.   USD   2.850 %   15/12/2032   13.073.831   0.08   3.700.000   Sabine Pass Liquefaction LLC   USD   5.750 %   15/05/2025   36.805.062   0.21   2.250.000   Sabine Pass Liquefaction LLC   USD   5.875 %   30/06/2025   22.838.624   0.13   2.255.000   Sabine Pass Liquefaction LLC   USD   5.875 %   30/06/2026   22.838.624   0.13   2.255.000   Sabine Pass Liquefaction LLC   USD   5.875 %   30/06/2026   22.838.624   0.15   2.255.000   Sabine Pass Liquefaction LLC   USD   5.875 %   30/06/2026   22.838.624   0.15   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2.255.000   2	3.800.000	Realty Income Corp.	USD	4,625 %	01/11/2025	38.502.998	0,22
3700,000   Sabine Pass Liquefaction LLC	3.450.000	Realty Income Corp.		3,400 %	15/01/2028	33.794.548	0,20
2250 000   Sabine Pass Liquefaction LLC		·					
2.825.000         Sabine Pass Liquefaction LLC         USD         5,875 %         3006/2028         28,486,300         0,15           1.200.000         Sempra Energy         USD         3,400 %         01/02/2038         20,135,355         0,12           2.600.000         Sempra Energy         USD         4,000 %         01/02/2048         27,328,692         0,16           1.175.000         Skyworks Solutions, Inc.         USD         3,000 %         01/06/2031         16,884,754         0,6           2.600.000         Southern California Edison Co. – Serie E         USD         3,700 %         01/08/2025         25,399,469         0,15           2.820.000         Southern Copper Corp.         USD         3,700 %         01/08/2025         25,399,469         0,15           2.820.000         Spirit Reality LP         USD         3,200 %         1501/2027         14.818.977         0,09           1.800.000         Spirit Reality LP         USD         2,100 %         15/03/2028         16.103.254         0,09           2.000.00         Spirit Reality LP         USD         3,400 %         15/01/2029         20/03.442         0,12           2.025.000         Spirit Reality LP         USD         3,400 %         15/01/2039         19.394.410							
1.20.000   Sempra Energy		•					
2,000,000   Sempra Energy		•					
260.000   Sempra Energy		. •					
1.175.000   Skyworks Solutions, Inc.   USD   3,000 %   0.1106/2031   10.854.754   0.06   2.600.000   Southern California Edison Co. – Serie E   USD   3,700 %   0.1108/2025   25.389.469   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.15   0.							
2,600,000   Southern California Edison Co Serie E							
2.820.000         Southern Copper Corp.         USD         5,875 %         23/04/2045         34,429,455         0,20           1.550.000         Spirit Realty LP         USD         3,200 %         15/01/2027         14,818,977         0,09           2.000.000         Spirit Realty LP         USD         2,100 %         15/03/2028         16,103,254         0,09           2.005.000         Spirit Realty LP         USD         4,000 %         15/07/2039         20,093,442         0,12           2.025.000         Spirit Realty LP         USD         3,400 %         15/07/2030         19,394,410         0,11           2.025.000         Spirit Realty LP         USD         3,400 %         15/07/2030         19,394,410         0,11           2.325.000         Sysoc Corp.         USD         0,600 %         01/04/2050         33,399,790         0,19           6.775.000         Teledyne Technologies, Inc.         USD         0,950 %         01/04/2024         10,469,363         0,06           2.800.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         3,750 %         15/04/2027         27,431,797         0,16           5.175.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         3,875 %         15/04/2030         51,241,134         0,30							
1.550.000         Spirit Realty LP         USD         3,200 %         15/01/2027         14.818.977         0,09           1.800.000         Spirit Realty LP         USD         2,100 %         15/03/2028         16.103.254         0,09           2.000.000         Spirit Realty LP         USD         4,000 %         15/07/2029         20.093.442         0,12           2.025.000         Spirit Realty LP         USD         3,400 %         15/01/2030         19.394.410         0,11           2.325.000         Spirit Realty LP         USD         6,600 %         01/04/2024         0,939.4410         0,11           2.325.000         Spirit Realty LP         USD         0,950 %         01/04/2024         0,14         0,11           2.325.000         Spirit Realty LP         USD         0,950 %         01/04/2024         0,14         0,11           6.775.000         Teldeyne Technologies, Inc.         USD         0,950 %         01/04/2024         10.489.363         0,06           2.800.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         3,750 %         15/04/2027         27.431.797         0,16           5.175.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         3,875 %         15/04/2030         15.241.134         0,30							
2.000.000         Spirit Realfy LP         USD         4,000 %         15/07/2029         20.093.442         0,12           2.025.000         Spirit Realty LP         USD         3,400 %         15/01/2030         19.994.410         0,11           2.325.000         Sysco Corp.         USD         6,600 %         01/04/2050         33.399.790         0,19           6.775.000         Teledyne Technologies, Inc.         USD         0,950 %         01/04/2024         61.306.550         0,36           1.000.000         Themro Fisher Scientific, Inc.         EUR         0,750 %         12/09/2024         10.489.363         0,06           2.800.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         3,750 %         15/04/2027         27.431.797         0,16           5.175.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         3,875 %         15/04/2020         51.241.134         0,30           975.000         US Bancorp         EUR         0,850 %         07/06/2024         10.224.128         0,06           4.625.000         Valero Energy Corp.         USD         3,400 %         15/09/2026         44.684.407         0,26           3.475.000         Verizon Communications, Inc.         USD         4,125 %         16/03/2027         34.711.786							
2.025.000         Spirit Realty LP         USD         3,400 %         15/01/2030         19.394.410         0,11           2.325.000         Sysco Corp.         USD         6,600 %         01/04/2050         33.399.790         0,19           6.775.000         Teledyne Technologies, Inc.         USD         0,950 %         01/04/2024         61.306.550         0,36           1.000.000         Therme Fisher Scientific, Inc.         EUR         0,750 %         12/09/2024         10.469.363         0,06           2.800.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         3,750 %         15/04/2027         27.431.797         0,16           5.175.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         3,875 %         15/04/2020         51.241.134         0,30           975.000         USB Bancorp         EUR         0,850 %         07/06/2024         10.224.128         0,06           4.625.000         Valero Energy Corp.         USD         3,400 %         15/09/2026         44.684.407         0,26           3.475.000         Valero Energy Partners LP         USD         4,375 %         15/12/2026         36.042.487         0,20           3.425.000         Verizon Communications, Inc.         USD         4,125 %         16/03/2027         34.711.786<	1.800.000	Spirit Realty LP	USD	2,100 %	15/03/2028	16.103.254	0,09
2.325.000         Sysco Corp.         USD         6,600 %         01/04/2050         33.399.790         0,19           6.775.000         Teledyne Technologies, Inc.         USD         0,950 %         01/04/2024         61.306.550         0,36           1.000.000         Themo Fisher Scientific, Inc.         USD         0,750 %         12/09/2024         10.469.363         0,06           2.800.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         3,750 %         15/04/2030         51.241.134         0,30           975.000         US Bancorp         EUR         0,850 %         07/06/2024         10.24.128         0,06           4.625.000         Valero Energy Corp.         USD         3,400 %         15/09/2026         44.684.407         0,26           3.475.000         Verizon Communications, Inc.         USD         4,375 %         15/12/2026         35.042.487         0,20           3.425.000         Verizon Communications, Inc.         USD         4,125 %         16/03/2027         34.711.786         0,20           7.725.000         Verizon Communications, Inc.         USD         2,550 %         21/08/2046         47.366.373         0,28           1.000.000         Ver Corp.         EUR         0,625 %         20/09/2023         10.381.8	2.000.000	Spirit Realty LP	USD	4,000 %	15/07/2029	20.093.442	0,12
6.775.000         Teledyne Technologies, Inc.         USD         0,950 %         01/04/2024         61.306.550         0,36           1.000.000         Thermo Fisher Scientific, Inc.         EUR         0,750 %         12/09/2024         10.469.363         0,06           2.800.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         3,750 %         15/04/2027         27.431.797         0,16           5.175.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         3,875 %         15/04/2030         51.241.134         0,30           975.000         US Bancorp         EUR         0,850 %         07/06/2024         10.224.128         0,06           4.625.000         Valero Energy Corp.         USD         3,400 %         15/09/2026         44.684.407         0,26           3.475.000         Valero Energy Partners LP         USD         4,375 %         15/12/2026         35.042.487         0,20           3.425.000         Verizon Communications, Inc.         USD         4,125 %         16/03/2027         34.711.786         0,20           7.725.000         Verizon Communications, Inc.         USD         4,862 %         21/03/2031         71.146.746         0,41           3.950.000         Verizon Communications, Inc.         USD         0,625 %         21/09/2023<	2.025.000	Spirit Realty LP	USD	3,400 %	15/01/2030	19.394.410	0,11
1.000.000       Thermo Fisher Scientific, Inc.       EUR       0,750 %       12/09/2024       10.469.363       0,06         2.800.000       T-Mobile USA, Inc.       USD       3,750 %       15/04/2027       27.431.797       0,16         5.175.000       T-Mobile USA, Inc.       USD       3,875 %       15/04/2030       51.241.134       0,30         975.000       US Bancorp       EUR       0,850 %       07/06/2024       10.224.128       0,06         4.625.000       Valero Energy Corp.       USD       3,400 %       15/09/2026       44.684.407       0,26         3.475.000       Valero Energy Partners LP       USD       4,375 %       15/12/2026       35.042.487       0,20         3.425.000       Verizon Communications, Inc.       USD       4,125 %       16/03/2027       34.711.786       0,20         7.725.000       Verizon Communications, Inc.       USD       2,550 %       21/03/2031       71.146.746       0,41         3.950.000       Verizon Communications, Inc.       USD       4,862 %       21/08/2046       47.386.373       0,28         1.000.000       VF Corp.       USD       0,625 %       20/09/2023       10.381.832       0,06         4.125.000       Walgreens Boots Alliance, Inc.	2.325.000	Sysco Corp.	USD	6,600 %	01/04/2050	33.399.790	0,19
2.800.000       T-Mobile USA, Inc.       USD       3,750 %       15/04/2027       27.431.797       0,16         5.175.000       T-Mobile USA, Inc.       USD       3,875 %       15/04/2030       51.241.134       0,30         975.000       US Bancorp       EUR       0,850 %       07/06/2024       10.224.128       0,06         4.625.000       Valero Energy Corp.       USD       3,400 %       15/09/2026       44.684.407       0,26         3.475.000       Valero Energy Partners LP       USD       4,375 %       15/12/2026       35.042.487       0,20         3.425.000       Verizon Communications, Inc.       USD       4,125 %       16/03/2027       34.711.786       0,20         7.725.000       Verizon Communications, Inc.       USD       4,862 %       21/03/2031       71.146.746       0,41         3.950.000       Verizon Communications, Inc.       USD       4,862 %       21/08/2046       47.386.373       0,28         1.000.000       VF Corp.       EUR       0,625 %       20/09/2023       10.381.882       0,66         4.125.000       Walgreens Boots Alliance, Inc.       USD       0,950 %       17/11/2023       37.477.579       0,22         2.000.000       Valor Energy Co.       USD							
5.175.000         T-Mobile USA, Inc.         USD         3,875 %         15/04/2030         51.241.134         0,30           975.000         US Bancorp         EUR         0,850 %         07/06/2024         10.224.128         0,06           4.625.000         Valero Energy Corp.         USD         3,400 %         15/09/2026         44.684.407         0,26           3.475.000         Valero Energy Partners LP         USD         4,375 %         15/12/2026         35.042.487         0,20           3.425.000         Verizon Communications, Inc.         USD         4,125 %         16/03/2027         34.711.786         0,20           7.725.000         Verizon Communications, Inc.         USD         2,550 %         21/03/2031         71.146.746         0,41           3.950.000         Verizon Communications, Inc.         USD         4,862 %         21/08/2046         47.386.373         0,28           1.000.000         Verizon Communications, Inc.         USD         0,625 %         20/09/2033         10.381.882         0,66           4.125.000         Valgreens Boots Alliance, Inc.         USD         0,950 %         17/11/2023         37.477.579         0,22           2.000.000         Walz Disney Co.         USD         3,600 %         20/01/2024 <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>							
975.000 US Bancorp 4.625.000 Valero Energy Corp. 4.625.000 Valero Energy Corp. 3.475.000 Valero Energy Partners LP USD 3.400 Werizon Communications, Inc. 3.475.000 Verizon Communications, Inc. 3.7725.000 Verizon Communications, Inc. USD 4.125 W 16/03/2027 34.711.786 0,20 0.7725.000 Verizon Communications, Inc. USD 4.125 W 16/03/2027 34.711.786 0,20 0.7725.000 Verizon Communications, Inc. USD 4.862 W 21/08/2046 47.386.373 0,28 1.000.000 VF Corp. EUR 0,625 W 20/09/2023 10.381.882 0,06 4.125.000 Walgreens Boots Alliance, Inc. USD 0,950 W 17/11/2023 37.477.579 0,22 2.000.000 Walgreens Boots Alliance, Inc. USD 3,700 W 15/10/2025 25.832.637 0,15 750.000 Walgreens Boots Alliance, Inc. USD 3,700 W 15/10/2025 25.832.637 0,15 750.000 Wells Fargo & Co. EUR 0,500 W 26/04/2024 10.360.652 0,06 5.500.000 Wells Fargo & Co. EUR 1,500 W 10/07/2022 64.158.118 0,37 2.900.000 Williams Cos., Inc. USD 3,600 W 15/03/2022 64.158.118 0,37 2.900.000 Williams Cos., Inc. USD 3,600 W 15/03/2022 64.16.802 0,38 2.150.000 Williams Cos., Inc. USD 4,800 W 15/03/2024 20.781.222 0,781.222 0,782.200.700 Williams Cos., Inc. USD 4,800 W 15/03/2023 58.705.567 0,34							
4.625.000       Valero Energy Corp.       J\$0       3,400 %       15/09/2026       44.684.407       0,26         3.475.000       Valero Energy Partners LP       USD       4,375 %       15/12/2026       35.042.487       0,20         3.425.000       Verizon Communications, Inc.       USD       4,125 %       16/03/2027       34.711.786       0,20         7.725.000       Verizon Communications, Inc.       USD       2,550 %       21/03/2031       71.146.746       0,41         3.950.000       Verizon Communications, Inc.       USD       4,862 %       21/08/2046       47.386.373       0,28         1.000.000       VF Corp.       EUR       0,625 %       20/09/2023       10.381.882       0,06         4.125.000       Walgreens Boots Alliance, Inc.       USD       0,950 %       17/11/2023       37.477.579       0,22         2.000.000       Walgreens Boots Alliance, Inc.       USD       3,600 %       20/11/2025       25.832.637       0,15         750.000       Walt Disney Co.       USD       3,700 %       15/10/2025       7.365.433       0,04         1.000.000       Wells Fargo & Co.       EUR       0,500 %       26/04/2024       10.360.652       0,06         5.500.000       Wells Fargo & Co.							
3.475.000       Valero Energy Partners LP       USD       4,375 %       15/12/2026       35.042.487       0,20         3.425.000       Verizon Communications, Inc.       USD       4,125 %       16/03/2027       34.711.786       0,20         7.725.000       Verizon Communications, Inc.       USD       2,550 %       21/03/2031       71.146.746       0,41         3.950.000       Verizon Communications, Inc.       USD       4,862 %       21/08/2046       47.386.373       0,28         1.000.000       VF Corp.       EUR       0,625 %       20/09/2023       10.381.882       0,06         4.125.000       Walgreens Boots Alliance, Inc.       USD       0,950 %       17/11/2023       37.477.579       0,22         2.000.000       Walgreens Boots Alliance, Inc.       USD       3,600 %       20/11/2025       25.832.637       0,15         750.000       Walt Disney Co.       USD       3,700 %       15/10/2025       7.365.433       0,04         1.000.000       Wells Fargo & Co.       EUR       0,500 %       26/04/2024       10.360.652       0,06         5.500.000       Wells Fargo & Co.       EUR       1,500 %       24/05/2027       58.962.895       0,34         7.024.000       Western Midstream Operating							
3.425.000       Verizon Communications, Inc.       USD       4,125 %       16/03/2027       34.711.786       0,20         7.725.000       Verizon Communications, Inc.       USD       2,550 %       21/03/2031       71.146.746       0,41         3.950.000       Verizon Communications, Inc.       USD       4,862 %       21/08/2046       47.386.373       0,28         1.000.000       VF Corp.       EUR       0,625 %       20/09/2023       10.381.882       0,06         4.125.000       Walgreens Boots Alliance, Inc.       USD       0,950 %       17/11/2023       37.477.579       0,22         2.000.000       Walgreens Boots Alliance, Inc.       GBP       3,600 %       20/11/2025       25.832.637       0,15         750.000       Walt Disney Co.       USD       3,700 %       15/10/2025       7.365.433       0,04         1.000.000       Wells Fargo & Co.       EUR       0,500 %       26/04/2024       10.360.652       0,06         5.500.000       Wells Fargo & Co.       EUR       1,500 %       24/05/2027       58.962.895       0,34         7.024.000       Western Midstream Operating LP       USD       4,600 %       15/05/2050       33.001.428       0,19         7.050.000       Williams Cos., Inc. <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>							
7.725.000         Verizon Communications, Inc.         USD         2,550 %         21/03/2031         71.146.746         0,41           3.950.000         Verizon Communications, Inc.         USD         4,862 %         21/08/2046         47.386.373         0,28           1.000.000         VF Corp.         EUR         0,625 %         20/09/2023         10.381.882         0,06           4.125.000         Walgreens Boots Alliance, Inc.         USD         0,950 %         17/11/2023         37.477.579         0,22           2.000.000         Walgreens Boots Alliance, Inc.         GBP         3,600 %         20/11/2025         25.832.637         0,15           750.000         Walt Disney Co.         USD         3,700 %         15/10/2025         7.365.433         0,04           1.000.000         Wells Fargo & Co.         EUR         0,500 %         26/04/2024         10.360.652         0,06           5.500.000         Wells Fargo & Co.         EUR         1,500 %         24/05/2027         58.962.895         0,34           7.024.000         Western Midstream Operating LP         USD         4,000 %         01/07/2022         64.158.118         0,37           2.900.000         Williams Cos., Inc.         USD         3,600 %         15/03/2022							
3.950.000         Verizon Communications, Inc.         USD         4,862 %         21/08/2046         47.386.373         0,28           1.000.000         VF Corp.         EUR         0,625 %         20/09/2023         10.381.882         0,06           4.125.000         Walgreens Boots Alliance, Inc.         USD         0,950 %         17/11/2023         37.477.579         0,22           2.000.000         Walgreens Boots Alliance, Inc.         GBP         3,600 %         20/11/2025         25.832.637         0,15           750.000         Walt Disney Co.         USD         3,700 %         15/10/2025         7.365.433         0,04           1.000.000         Wells Fargo & Co.         EUR         0,500 %         26/04/2024         10.360.652         0,06           5.500.000         Wells Fargo & Co.         EUR         1,500 %         24/05/2027         58.962.895         0,34           7.024.000         Western Midstream Operating LP         USD         4,000 %         01/07/2022         64.158.118         0,37           2.900.000         Williams Cos., Inc.         USD         3,600 %         15/03/2022         64.416.802         0,38           2.150.000         Williams Cos., Inc.         USD         4,300 %         04/03/2024         20							
1.000.000       VF Corp.       EUR       0,625 %       20/09/2023       10.381.882       0,06         4.125.000       Walgreens Boots Alliance, Inc.       USD       0,950 %       17/11/2023       37.477.579       0,22         2.000.000       Walgreens Boots Alliance, Inc.       GBP       3,600 %       20/11/2025       25.832.637       0,15         750.000       Walt Disney Co.       USD       3,700 %       15/10/2025       7.365.433       0,04         1.000.000       Wells Fargo & Co.       EUR       0,500 %       26/04/2024       10.360.652       0,06         5.500.000       Wells Fargo & Co.       EUR       1,500 %       24/05/2027       58.962.895       0,34         7.024.000       Western Midstream Operating LP       USD       4,000 %       01/07/2022       64.158.118       0,37         2.900.000       Whirlpool Corp.       USD       4,600 %       15/03/2022       64.416.802       0,38         2.150.000       Williams Cos., Inc.       USD       4,300 %       04/03/2024       20.781.222       0,12         6.500.000       Williams Cos., Inc.       USD       2,600 %       15/03/2031       58.705.567       0,34							
4.125.000       Walgreens Boots Alliance, Inc.       USD       0,950 %       17/11/2023       37.477.579       0,22         2.000.000       Walgreens Boots Alliance, Inc.       GBP       3,600 %       20/11/2025       25.832.637       0,15         750.000       Walt Disney Co.       USD       3,700 %       15/10/2025       7.365.433       0,04         1.000.000       Wells Fargo & Co.       EUR       0,500 %       26/04/2024       10.360.652       0,06         5.500.000       Wells Fargo & Co.       EUR       1,500 %       24/05/2027       58.962.895       0,34         7.024.000       Western Midstream Operating LP       USD       4,000 %       01/07/2022       64.158.118       0,37         2.900.000       Whirlpool Corp.       USD       4,600 %       15/05/2050       33.001.428       0,19         7.050.000       Williams Cos., Inc.       USD       3,600 %       15/03/2022       64.416.802       0,38         2.150.000       Williams Cos., Inc.       USD       4,300 %       04/03/2024       20.781.222       0,12         6.500.000       Williams Cos., Inc.       USD       2,600 %       15/03/2031       58.705.567       0,34							
2.000.000       Walgreens Boots Alliance, Inc.       GBP       3,600 %       20/11/2025       25.832.637       0,15         750.000       Walt Disney Co.       USD       3,700 %       15/10/2025       7.365.433       0,04         1.000.000       Wells Fargo & Co.       EUR       0,500 %       26/04/2024       10.360.652       0,06         5.500.000       Wells Fargo & Co.       EUR       1,500 %       24/05/2027       58.962.895       0,34         7.024.000       Western Midstream Operating LP       USD       4,000 %       01/07/2022       64.158.118       0,37         2.900.000       Williams Cos., Inc.       USD       4,600 %       15/05/2050       33.001.428       0,19         7.050.000       Williams Cos., Inc.       USD       3,600 %       15/03/2022       64.416.802       0,38         2.150.000       Williams Cos., Inc.       USD       4,300 %       04/03/2024       20.781.222       0,12         6.500.000       Williams Cos., Inc.       USD       2,600 %       15/03/2031       58.705.567       0,34		•					
750.000         Walt Disney Co.         USD         3,700 %         15/10/2025         7.365.433         0,04           1.000.000         Wells Fargo & Co.         EUR         0,500 %         26/04/2024         10.360.652         0,06           5.500.000         Wells Fargo & Co.         EUR         1,500 %         24/05/2027         58.962.895         0,34           7.024.000         Western Midstream Operating LP         USD         4,000 %         01/07/2022         64.158.118         0,37           2.900.000         Williams Cos., Inc.         USD         4,600 %         15/05/2050         33.001.428         0,19           7.050.000         Williams Cos., Inc.         USD         3,600 %         15/03/2022         64.416.802         0,38           2.150.000         Williams Cos., Inc.         USD         4,300 %         04/03/2024         20.781.222         0,12           6.500.000         Williams Cos., Inc.         USD         2,600 %         15/03/2031         58.705.567         0,34		•					
5.500.000         Wells Fargo & Co.         EUR         1,500 %         24/05/2027         58.962.895         0,34           7.024.000         Western Midstream Operating LP         USD         4,000 %         01/07/2022         64.158.118         0,37           2.900.000         Whirlpool Corp.         USD         4,600 %         15/05/2050         33.001.428         0,19           7.050.000         Williams Cos., Inc.         USD         3,600 %         15/03/2022         64.416.802         0,38           2.150.000         Williams Cos., Inc.         USD         4,300 %         04/03/2024         20.781.222         0,12           6.500.000         Williams Cos., Inc.         USD         2,600 %         15/03/2031         58.705.567         0,34		•					
7.024.000       Western Midstream Operating LP       USD       4,000 %       01/07/2022       64.158.118       0,37         2.900.000       Whirlpool Corp.       USD       4,600 %       15/05/2050       33.001.428       0,19         7.050.000       Williams Cos., Inc.       USD       3,600 %       15/03/2022       64.416.802       0,38         2.150.000       Williams Cos., Inc.       USD       4,300 %       04/03/2024       20.781.222       0,12         6.500.000       Williams Cos., Inc.       USD       2,600 %       15/03/2031       58.705.567       0,34	1.000.000	Wells Fargo & Co.	EUR	0,500 %	26/04/2024	10.360.652	0,06
2.900.000       Whirlpool Corp.       USD       4,600 %       15/05/2050       33.001.428       0,19         7.050.000       Williams Cos., Inc.       USD       3,600 %       15/03/2022       64.416.802       0,38         2.150.000       Williams Cos., Inc.       USD       4,300 %       04/03/2024       20.781.222       0,12         6.500.000       Williams Cos., Inc.       USD       2,600 %       15/03/2031       58.705.567       0,34	5.500.000	Wells Fargo & Co.	EUR	1,500 %	24/05/2027	58.962.895	0,34
7.050.000       Williams Cos., Inc.       USD       3,600 %       15/03/2022       64.416.802       0,38         2.150.000       Williams Cos., Inc.       USD       4,300 %       04/03/2024       20.781.222       0,12         6.500.000       Williams Cos., Inc.       USD       2,600 %       15/03/2031       58.705.567       0,34	7.024.000	Western Midstream Operating LP	USD			64.158.118	
2.150.000     Williams Cos., Inc.     USD     4,300 %     04/03/2024     20.781.222     0,12       6.500.000     Williams Cos., Inc.     USD     2,600 %     15/03/2031     58.705.567     0,34			USD	4,600 %	15/05/2050	33.001.428	0,19
6.500.000 Williams Cos., Inc. USD 2,600 % 15/03/2031 58.705.567 0,34							
3.150.000 WP Carey, Inc. USD 3,850 % 15/07/2029 31.815.645 0,19							
	3.150.000	WP Carey, Inc.	USD	3,850 %	15/07/2029	31.815.645	0,19

					Valor de	
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	mercado en NOK	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
	os – (continuación)					
	WP Carey, Inc.	USD	2,400 %	01/02/2031	5.865.286	0,03
1.000.000	Zimmer Biomet Holdings, Inc.	EUR _	1,414 %	13/12/2022	10.420.443 5.527.563.638	0,06 32,17
TOTAL DE BOI	NOS				0.027.000.000	02,11
(coste NOK 13					14.375.024.254	83,67
Tenencias	Descripción del valor				Valor de mercado en NOK	% del patrimonio
Fondos de in	versión – 1,74 %					
Irlanda						
	' Goldman Sachs Euro Liquid Reserves Fund (Clase de acciones de	acumulación X) <sup>(e)(f)</sup>			298.163.799	1,74
TOTAL DE FOR (coste NOK 29	NDOS DE INVERSIÓN 8.857.723)				298.163.799	1,74
TOTAL DE VAL	ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLS .771.712.775)	A DE VALORES OFI	CIAL		14.673.188.053	85,41
·	*		Tipo de		Valor de mercado en	% del
Tenencias	Descripción del valor	Divis		Fecha de vencimiento(b)		patrimonio
	liarios negociados en otro mercado regulado					
Bonos – 10,68 Australia	5 %					
	APT Pipelines Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USI	4,200 %	23/03/2025	63.732.481	0,37
4.000.000	Macquarie Group Ltd. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USI		12/01/2027	35.679.318	0,21
10.380.000	Macquarie Group Ltd. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USI	3,763 %	28/11/2028	102.741.488	0,60
					202.153.287	1,18
Islas Caimán						
	Avolon Holdings Funding Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USI		01/07/2024	43.536.522	0,25
2.650.000	Avolon Holdings Funding Ltd. 144A <sup>(d)</sup>	USI	4,250 %	15/04/2026	25.766.178 69.302.700	0,15 0,40
Francia					00.302.700	
	BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USI	3,500 %	01/03/2023	67.770.513	0,39
2.850.000	BNP Paribas S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USI		09/01/2025	27.376.076	0,16
6.650.000	BNP Paribas S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USI	2,219 %	09/06/2026	61.538.113	0,36
5.250.000	BNP Paribas S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USI	1,323 %	13/01/2027	46.607.630	0,27
6.775.000	BPCE S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USI	1,652 %	06/10/2026	61.039.879	0,36
	Crédit Agricole S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USI	3,250 %	04/10/2024	44.181.337	0,26
2.300.000	Crédit Agricole S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USI	1,907 %	16/06/2026	21.075.345	0,12
	Crédit Agricole S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USI		26/01/2027	60.738.838	0,35
	Electricité de France S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USI		21/09/2028	111.780.841	0,65
	Electricité de France S.A. 144A <sup>(d)</sup>	USI		26/01/2039	11.472.998	0,07
10.700.000	Société Générale S.A. 144A <sup>(c)(d)</sup>	USI	1,488 %	14/12/2026	95.241.342	0,55
 Italia					608.822.912	3,54
	UniCredit SpA 144A <sup>(c)(d)</sup>	USI	1,982 %	03/06/2027	17.356.712	0,10
Países Bajos	ADMANADO Desta NIVA 444A (C)(d)		4.540.0/	40/00/0007	74.047.000	0.40
	ABN AMRO Bank NV 144A <sup>(c)(d)</sup> Prosus NV 144A <sup>(d)</sup>	USI		16/06/2027 21/01/2030	74.347.668 2.313.856	0,43
250.000	Prosus INV 144A(4)	USI	3,680 %	21/01/2030	76.661.524	0,02
Supranacional	es .				70.001.324	
- · • · · · · · ·	NXP BV Via NXP Funding LLC Via NXP USA, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USI	2,500 %	11/05/2031	57.693.257	0,34
	NXP BV Via NXP Funding LLC Via NXP USA, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USI		30/11/2051	17.103.651	0,10
	•		-,,		74.796.908	0,44
Suiza						
Guiza	( ) ( ))					
4.525.000	Credit Suisse Group AG 144A <sup>(c)(d)</sup>	USI		12/01/2029	44.186.617	
4.525.000 9.700.000	Credit Suisse Group AG 144A(c)(d)	USI	4,194 %	01/04/2031	97.218.988	0,26 0,56
4.525.000 9.700.000	•		4,194 %			

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en NOK	% del patrimonio
Bonos - (con	tinuación)					
Estados Unido		HOD	0.050.0/	40/00/0000	00 504 547	0.44
	7-Eleven, Inc. 144A <sup>(d)</sup> Aviation Capital Group LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	0,950 % 1,950 %	10/02/2026 30/01/2026	23.521.517 26.835.204	0,14 0,16
	Bayer US Finance II LLC 144A <sup>(d)</sup>	USD	4,250 %	15/12/2025	43.933.417	0,10
	Boston Gas Co. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,001 %	01/08/2029	27.333.185	0,16
4.500.000	Broadcom, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,419 %	15/04/2033	42.302.859	0,25
4.100.000	Broadcom, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,500 %	15/02/2041	37.320.299	0,22
	CoStar Group, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,800 %	15/07/2030	49.905.803	0,29
	Duquesne Light Holdings, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,532 %	01/10/2030	22.972.096	0,13
	EMD Finance LLC 144A(d)	USD	3,250 %	19/03/2025	69.845.673	0,41
	Hyundai Capital America 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,650 %	17/09/2026	90.992.889	0,53
	International Flavors & Fragrances, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,230 %	01/10/2025	27.306.356	0,16 0,24
	International Flavors & Fragrances, Inc. 144A <sup>(d)</sup> International Flavors & Fragrances, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,832 % 3,268 %	15/10/2027 15/11/2040	41.244.129 7.036.741	0,24
	KeySpan Gas East Corp. 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,742 %	15/08/2026	937.585	0,04
	Penske Truck Leasing Co., LP Via PTL Finance Corp. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,400 %	15/11/2026	13.073.152	0,00
	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	1,711 %	29/01/2027	24.366.123	0,14
	Stellantis Finance US, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	2,691 %	15/09/2031	25.799.585	0,15
			,,,,		574.726.613	3,35
TOTAL DE BOI					1.833.824.413	10,68
·	con garantía de activos no emitidos ni garantizados por agencias – 0,2:	5 %				
Islas Caimán			0.004.0/	45/07/0007	1 000 110	2.24
	OCP CLO Ltd. 2015-9A "A1R" 144A <sup>(c)(d)</sup>	USD	0,924 %	15/07/2027	1.208.413	0,01
Reino Unido	Eurohome UK Mortgages Plc. 2007-2 "A2"(c)	GBP	0.260 %	15/09/2044	5.978.125	0,03
		ОБІ	-,=,-		3.370.123	
Estados Unido		USD	0,471 %	20/12/2046	3.226.874	0,02
	Banc of America Funding 2006-I Trust "6A1"(c) Banc of America Funding 2007-A Trust "2A1"(c)	USD	0,471 %	20/02/2047	8.712.199	0,02
	Lehman XS Trust Series 2007-7N "1A2"(c)	USD	0,332 %	25/06/2047	12.031.189	0,03
	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2007-15AR "2A1"(c)	USD	2,792 %	25/11/2037	11.960.529	0,07
		•			35.930.791	0,21
	LIGACIONES CON GARANTÍA DE ACTIVOS NO EMITIDOS NI DS POR AGENCIAS .615.027)				43.117.329	0,25
·	ORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO				1.876.941.742	10,93
Otros valores	mobiliarios					
Bonos - 0,23	%					
Estados Unido						
	Broadcom, Inc. 144A <sup>(d)</sup>	USD	3,187 %	15/11/2036	40.217.551	0,23
TOTAL DE BOI					40.217.551	0,23
TOTAL DE OTI	ROS VALORES MOBILIARIOS					<u> </u>
	RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS				40.217.551	0,23
(coste NOK 15	.585.857.001)				16.590.347.346	96,57
Contratos de	futuros – 0,47 %					
Número de contratos	Descripción del valor			Compromiso Valor de mercado en NOK	Plusvalía latente NOK	% del
	CAD CAD			NOR	NOR	Patrinonio
339	Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2022		Larga	339.261.417	4.633.822	0,03
(0.50)	EUR		Corto	(005.000.500)	446 116	2.22
, ,	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 años 08/12/2021		Corta	(295.089.532)	118.146	0,00
67	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/2021		Larga	150.166.337	7.093.688	0,04
				(144.923.195)	7.211.834	0,04
	GBP	-				
97	Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/03/2022		Larga	147.783.846	1.566.579	0,01

NIĆ						
Número de contratos	Descripción del valor			Compromiso Valor de mercado en NOK	Plusvalía latente NOK	% del patrimoni
	USD					
456	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a	10 años 22/03/2022	Larga	543.366.746	7.124.126	0,0
	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a		Larga	798.808.068	1.294.974	0,0
	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a m		Larga	1.522.622.753	59.123.417	0,3
260	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a	muy largo plazo a 10 años 22/03/202	22 Larga	348.124.752	6.727.532	0,0
DI HOVALÍA I A	ATENTE CORRE CONTRATOS DE FUTUROS			3.212.922.319	74.270.049	0,4
PLUSVALIA LA	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS			Compromise	87.682.284 Plusvalía	0,5
Número de contratos	Descripción del valor			Compromiso Valor de mercado en NOK	latente	% del patrimoni
(17)	<b>EUR</b> Futuros sobre bonos de la República Federal de	Alemania a 10 años 08/12/2021	Corta	(30.047.051)	(266.752)	(0,00
, ,	Futuros sobre bonos de la República Federal de		Corta	(570.936.329)	(1.471.595)	(0,01
				(600.983.380)	(1.738.347)	(0,01
	USD			//-/		
, ,	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a la Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a	• .	Corta Corta	(131.468.808) (252.126.715)	(3.268.982) (1.455.541)	(0,02 (0,01
				(383.595.523)	(4.724.523)	(0,03
MINUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS				(6.462.870)	(0,04
Contratos de	divisas a plazo – (5,14 %)					
Divisa	Compra Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en NOK	% de patrimonio
EUR	147.781.008 GBP	124.901.946		21/01/2022	11.507.737	0,00
EUR	14.904.556 NOK	148.258.206		25/01/2022	4.963.206	0,03
EUR	2.261.043 AUD	3.559.343		31/01/2022	227.862	0,00
EUR	3.197.792 CAD	4.611.993		31/01/2022	90.111	0,00
EUR	973.686.618 USD	1.096.703.992		10/02/2022	15.988.514	0,10
PLUSVALÍA LA	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A P	PLAZO			32.777.430	0,19
Divisa	Compra Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	Minusvalía latente NOK	% de patrimoni
GBP	4.935.627 EUR	5.796.217		21/01/2022	(7.630)	(0,00
NOK	17.277.375.578 EUR	1.769.831.259		25/01/2022	(916.796.424)	(5,33
	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A				(916.804.054)	(5,33
				Plusvalía/	(916.804.054)	(5,33
MINUSVALÍA L Opciones - (0				Plusvalia/ (minusvalia) latente NOK	<u>, , , , , , , , , , , , , , , , , , , </u>	(5,33 % de patrimoni
MINUSVALÍA L Opciones - (0	0,17 %)			(minusvalía) latente	Valor de mercado	% de
MINUSVALÍA L Opciones - (0 Tenencias	Descripción del valor  Opciones adquiridas  GBP	PLAZO		(minusvalía) latente NOK	Valor de mercado en NOK	% de patrimoni
MINUSVALÍA L Opciones - (0 Tenencias	Descripción del valor  Opciones adquiridas GBP  .000 Call Swaption del SONIA a 12 meses	PLAZO  Vence 08/09/2022 F	Precio de ejercicio 0,28	(minusvalía) latente NOK (333.911)	Valor de mercado en NOK	% de patrimonio 0,00
MINUSVALÍA L Opciones - (0 Tenencias 23.310. 30.450.	Descripción del valor  Opciones adquiridas GBP  .000 Call Swaption del SONIA a 12 meses .000 Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022 F Vence 08/09/2022 F	Precio de ejercicio 0,30	(minusvalia) latente NOK (333.911) (441.373)	Valor de mercado en NOK 57.349 79.321	% de patrimonio
MINUSVALÍA L  Opciones - (0  Tenencias  23.310. 30.450. 27.480.	Descripción del valor  Opciones adquiridas  GBP  .000 Call Swaption del SONIA a 12 meses .000 Call Swaption del SONIA a 12 meses .000 Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022 F Vence 08/09/2022 F Vence 10/10/2022 F	Precio de ejercicio 0,30 Precio de ejercicio 0,42	(minusvalia) latente NOK (333.911) (441.373) (420.379)	Valor de mercado en NOK 57.349 79.321 108.220	% de patrimonio 0,01 0,01 0,01
MINUSVALÍA L  Opciones - (0  Tenencias  23.310. 30.450. 27.480. 25.090.	Descripción del valor  Opciones adquiridas GBP  .000 Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022 F Vence 08/09/2022 F Vence 10/10/2022 F Vence 10/10/2022 F	Precio de ejercicio 0,30 Precio de ejercicio 0,42 Precio de ejercicio 0,46	(minusvalia) latente NOK (333.911) (441.373) (420.379) (378.794)	Valor de mercado en NOK  57.349 79.321 108.220 111.450	% de patrimonio
MINUSVALÍA L Opciones – (C Tenencias  23.310. 30.450. 27.480. 25.090. 30.990.	Descripción del valor  Opciones adquiridas GBP  .000 Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022 F Vence 08/09/2022 F Vence 10/10/2022 F Vence 10/10/2022 F Vence 11/10/2022 F	Precio de ejercicio 0,30 Precio de ejercicio 0,42 Precio de ejercicio 0,46 Precio de ejercicio 0,92	(minusvalia) latente NOK (333.911) (441.373) (420.379) (378.794) (162.759)	Valor de mercado en NOK  57.349 79.321 108.220 111.450 559.112	% de patrimonio 0,01 0,01 0,00 0,00 0,00
MINUSVALÍA L  Opciones - (0  Tenencias  23.310. 30.450. 27.480. 25.090. 30.990. 24.440.	Descripción del valor  Opciones adquiridas GBP  .000 Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022 F Vence 08/09/2022 F Vence 10/10/2022 F Vence 10/10/2022 F Vence 11/10/2022 F Vence 11/10/2022 F Vence 13/10/2022 F	Precio de ejercicio 0,30 Precio de ejercicio 0,42 Precio de ejercicio 0,46	(minusvalia) latente NOK (333.911) (441.373) (420.379) (378.794) (162.759) (134.666)	Valor de mercado en NOK  57.349 79.321 108.220 111.450	% de patrimonio 0,00 0,00 0,00 0,00
MINUSVALÍA L  Opciones - (0  Tenencias  23.310. 30.450. 27.480. 25.090. 30.990. 24.440. 28.740.	Descripción del valor  Opciones adquiridas GBP  .000 Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022 F Vence 08/09/2022 F Vence 10/10/2022 F Vence 10/10/2022 F Vence 11/10/2022 F Vence 13/10/2022 F Vence 15/11/2022 F Vence 15/11/2022 F	Precio de ejercicio 0,30 Precio de ejercicio 0,42 Precio de ejercicio 0,46 Precio de ejercicio 0,92 Precio de ejercicio 0,93	(minusvalia) latente NOK (333.911) (441.373) (420.379) (378.794) (162.759)	Valor de mercado en NOK  57.349 79.321 108.220 111.450 559.112 453.077	% de patrimonio
MINUSVALÍA L Opciones – (C Tenencias  23.310. 30.450. 27.480. 25.090. 30.990. 24.440. 28.740.	Descripción del valor  Opciones adquiridas GBP  .000 Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022 F Vence 08/09/2022 F Vence 10/10/2022 F Vence 10/10/2022 F Vence 11/10/2022 F Vence 13/10/2022 F Vence 13/10/2022 F Vence 15/11/2022 F	Precio de ejercicio 0,30 Precio de ejercicio 0,42 Precio de ejercicio 0,46 Precio de ejercicio 0,92 Precio de ejercicio 0,93 Precio de ejercicio 0,52	(minusvalia) latente NOK (333.911) (441.373) (420.379) (378.794) (162.759) (134.666) (417.302)	Valor de mercado en NOK  57.349 79.321 108.220 111.450 559.112 453.077 161.338	% de patrimonio
23.310. 30.450. 27.480. 25.090. 30.990. 24.440. 26.150.	Descripción del valor  Opciones adquiridas GBP  .000 Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022 F Vence 08/09/2022 F Vence 10/10/2022 F Vence 10/10/2022 Vence 11/10/2022 F Vence 13/10/2022 F Vence 15/11/2022 F Vence 16/11/2022 F	Precio de ejercicio 0,30 Precio de ejercicio 0,42 Precio de ejercicio 0,46 Precio de ejercicio 0,92 Precio de ejercicio 0,93 Precio de ejercicio 0,52 Precio de ejercicio 0,54	(minusvalia) latente NOK (333.911) (441.373) (420.379) (378.794) (162.759) (134.666) (417.302) (371.222) (2.660.406)	Valor de mercado en NOK  57.349 79.321 108.220 111.450 559.112 453.077 161.338 160.384 1.690.251	% de patrimonio  0,01 0,01 0,01 0,00 0,00 0,00 0,00 0,
23.310. 30.450. 27.480. 25.090. 30.990. 24.440. 26.150.	Descripción del valor  Opciones adquiridas GBP  .000 Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022 F Vence 08/09/2022 F Vence 10/10/2022 F Vence 10/10/2022 Vence 11/10/2022 F Vence 13/10/2022 F Vence 15/11/2022 F Vence 16/11/2022 F	Precio de ejercicio 0,30 Precio de ejercicio 0,42 Precio de ejercicio 0,46 Precio de ejercicio 0,92 Precio de ejercicio 0,93 Precio de ejercicio 0,52	(minusvalia) latente NOK (333.911) (441.373) (420.379) (378.794) (162.759) (134.666) (417.302) (371.222)	Valor de mercado en NOK 57.349 79.321 108.220 111.450 559.112 453.077 161.338 160.384	% de patrimonio
MINUSVALÍA L Opciones - (0 Tenencias  23.310. 30.450. 27.480. 25.090. 30.990. 24.440. 28.740. 26.150.	Descripción del valor  Opciones adquiridas GBP  .000 Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022 F Vence 08/09/2022 F Vence 10/10/2022 F Vence 10/10/2022 F Vence 11/10/2022 F Vence 13/10/2022 F Vence 15/11/2022 F Vence 16/11/2022 F Vence 16/11/2022 F	Precio de ejercicio 0,30 Precio de ejercicio 0,42 Precio de ejercicio 0,46 Precio de ejercicio 0,92 Precio de ejercicio 0,93 Precio de ejercicio 0,52 Precio de ejercicio 0,54	(minusvalia) latente NOK (333.911) (441.373) (420.379) (378.794) (162.759) (134.666) (417.302) (371.222) (2.660.406)	Valor de mercado en NOK  57.349 79.321 108.220 111.450 559.112 453.077 161.338 160.384 1.690.251	% de patrimonio  0,01 0,01 0,01 0,00 0,00 0,00 0,00 0,

Opciones	- (continuación)	

enencias	Descripción del valor			Plusvalía/ (minusvalía) latente NOK	Valor de mercado en NOK	% de
	Opciones suscritas					
(7.030.000	<b>EUR</b> O) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 0,20	(232.750)	(751.666)	(0,00
	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses     Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 0,19	(270.970)	(772.103)	(0,00
(7.930.000		Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 0,73	(549.617)	(1.083.330)	(0,01
	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 06/01/2022	Precio de ejercicio 0,18	(197.795)	(809.148)	(0,00
,	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(168.232)	(949.712)	(0,00
	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(240.679)	(951.297)	(0,01
,	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(163.287)	(1.174.852)	(0,0
,	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(74.859)	(881.536)	(0,0
,	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses     Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	3.982	(883.121)	
,	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses     Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(74.994)	. ,	(0,01
	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses     Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022	•	, ,	(883.121)	(0,0° (0,0°
,	D) Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022 Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(74.859) (327.834)	(881.536)	(0,0
			Precio de ejercicio 0,22	, ,	(1.160.823)	
	Call Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	(263.530)	(959.277)	(0,0
	)) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 0,20	332.886	(186.030)	(0,00
	D) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 20/12/2021	Precio de ejercicio 0,19	161.011	(340.122)	(0,00
•	)) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 0,23	222.300	(311.413)	(0,00
	)) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 06/01/2022	Precio de ejercicio 0,18	83.283	(528.071)	(0,00
	)) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 26/05/2022	Precio de ejercicio 0,11	(82.688)	(920.602)	(0,0
•	)) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	123.043	(545.447)	(0,00
(6.000.000	)) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	162.683	(546.358)	(0,00
(7.410.000	)) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	89.252	(674.752)	(0,00
(5.560.000	) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(62.619)	(506.292)	(0,00
(5.570.000	) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(60.895)	(507.202)	(0,00
(5.570.000	) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(66.405)	(507.202)	(0,00
	Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,13	(66.286)	(506.292)	(0,00
	) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	327.088	(467.048)	(0,00
,	D) Put Swaption del EURIBOR a 6 meses	Vence 01/11/2022	Precio de ejercicio 0,22	309.789	(385.958)	(0,00
(4.950.000	) Fut Swaption del EURIBUR à 0 meses	Verice 0 1/11/2022	riecio de ejercicio 0,22	(1.162.982)	(19.074.311)	(0,0
	GBP			(1.102.902)	(19.074.311)	(0,1
(2 400 000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,36	109.014	(281.336)	(0,00
	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 08/09/2022	Precio de ejercicio 0,40	116.743	(405.235)	(0,00
•	O) Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,38	145.623	(382.497)	(0,00
	O) Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 10/10/2022	Precio de ejercicio 0,42	105.403	(385.470)	(0,00
	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 11/10/2022	Precio de ejercicio 1,04	(862.583)	(1.584.764)	(0,0
(2.570.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 13/10/2022	Precio de ejercicio 0,99	(564.452)	(1.152.128)	(0,0
(2.970.000	Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 15/11/2022	Precio de ejercicio 0,55	(63.458)	(642.265)	(0,0
(2.700.000	0) Call Swaption del SONIA a 12 meses	Vence 16/11/2022	Precio de ejercicio 0,60	(110.423)	(641.696)	(0,00
				(1.124.133)	(5.475.391)	(0,03
	USD					
	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 06/12/2021	Precio de ejercicio 1,58	(92.751)	(683.844)	(0,00
(9.130.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,64	(469.376)	(1.154.755)	(0,01
(9.130.000	Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 1,67	(770.567)	(1.465.807)	(0,01
(9.130.000	) Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 1,60	(321.827)	(1.089.969)	(0,01
(3.100.000	) Call Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 14/11/2022	Precio de ejercicio 1,06	783.868	(691.646)	(0,0
(9.130.000	) Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 06/12/2021	Precio de ejercicio 1,58	435.501	(155.592)	(0,00
	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 13/12/2021	Precio de ejercicio 1,64	482.820	(202.559)	(0,0)
	Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Vence 22/12/2021	Precio de ejercicio 1,67	405.217	(290.022)	(0,00
`	,	Vence 29/12/2021 Vence 29/12/2021	Precio de ejercicio 1,60	228.036	, ,	
(9.130.000	)) Put Swaption del LIBOR a 3 meses	Velice 29/12/2021	riecio de ejercicio 1,00		(540.106)	(0,00
	ONES SUSCRITAS			680.921	(6.274.300)	(0,04
ste NOK (29.2					(30.824.002)	(0,18
OTAL DE OPCIO OSTE NOK (22.5					(28.492.260)	(0,1
ntratos de pe	ermutas financieras – 0,07 %					
porte teórico					Plusvalía	% d
al to	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimie	latente nto en NOK	patrimoni
	Permutas de tipos de interés					
13.590.00	0 Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 2,000 %	AUD	17/03/20	32 486.827	0,0
	0 Fijo 1,750 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)		15/12/20		0,0
	0 Fijo 1,680 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)		22/08/20		0,0
	0 Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,500 %	CAD	14/10/20		0,0
	,	•				
17.310.00	0 Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,250 %	CAD	15/12/20	051 886.437	0,0

Valor de

Cantuataa	de nermiitee	financiarea	- (continuación)

Importe teórico local					Plusvalía latente	% del patrimonio
neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	en NOK	patrinonio
	Permutas de tipos de interés - (con	tinuación)				
4.470.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,000 %	CHF	16/03/2027	137.535	0,00
18.810.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,000 %	CHF	16/03/2032	1.771.034	0,01
4.210.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,500 %	CHF	17/03/2032	284.620	0,00
138.060.000	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	03/11/2023	1.284.338	0,01
3.020.000	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2023	8.658	0,00
	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2024	1.881.573	0,01
	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2025	511.754	0,00
	Variable (LIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,000 %	EUR	15/12/2026	1.358.701	0,01
	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)		EUR	03/11/2027	193.439	0,00
	Fijo 0,000 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	15/12/2028	5.419.475	0,03
	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)		EUR	15/12/2030	513.166	0,00
	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)		EUR	26/11/2031	409.867	0,00
	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)		EUR	15/12/2031	921.154	0,01
	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)		EUR	17/03/2032	382.002	0,00
	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	•	EUR	15/12/2041	378.414	0,00
	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)		EUR	15/12/2051	1.576.757	0,01
	Fijo 0,500 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP GBP	15/12/2026	53.370	0,00
	Fijo 0,750 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)		15/12/2030	240.775	0,00
	Fijo 0,750 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	15/12/2031	1.343.138	0,01
	Variable (SONIA a 1 mes en GBP) Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	Fijo 1,000 %	GBP GBP	15/12/2041 15/12/2051	293.451	0,00
	,	Fijo 0,750 %			543.242	0,00
	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 3,000 %	NZD	16/09/2031	35.289 154.356	0,00
	Fijo 2,000 %	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	NZD SEK	15/12/2031		0,00 0,00
	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,500 %		16/03/2024	354.072	
	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,750 % Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	SEK USD	15/12/2031 25/07/2024	307.992 116.616	0,00
	Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  Variable (SOFR a 1 mes en USD)	,	USD	22/09/2031	397.091	0,00 0,00
	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	Fijo 1,530 % Fijo 1,750 %	USD	15/12/2031	555.483	0,00
			03D	13/12/2031		
PLUSVALIA LATEN	NTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE II	NTERES			27.948.721	0,16
299.275.000	Permutas de incumplimiento crediticio Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 34 Index)		USD	20/06/2025	15.939.190	0,09
28.400.000	Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 35 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2025	990.660	0,01
173.500.000	Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 36 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2026	2.458.014	0,01
PI USVAI ÍA I ATEN	NTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLIN	IIENTO CREDITICIO (CDS)			19.387.864	0,11
		(020)				•,
4 200 000	Permutas de inflación	Variable (LIBOR a 12 massa on ELIR)	EUR	15/10/2023	36.415	0,00
	Fijo 2,250 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	USD	07/10/2022		
-	Fijo 3,250 %	Variable (LIBOR a 12 meses en USD)	03D	07/10/2022	584.535	0,01
	NTE SOBRE PERMUTAS DE INFLACIÓN				620.950	0,01
TOTAL DE PLUSVA	ALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE	PERMUTAS FINANCIERAS			47.957.535	0,28
Importe teórico local					Minusvalía latente	% del patrimonio
neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	NOK	patimonio
	Permutas de tipos de interés					
132.820.000	Variable (BBSW a 3 meses en AUD)	Fijo 0,190 %	AUD	22/02/2023	(2.467.481)	(0,02)
	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 1,250 %	AUD	15/12/2026	(8.855.872)	(0,05)
	Variable (BBSW a 6 meses en AUD)	Fijo 2,000 %	AUD	15/12/2031	(2.144.146)	(0,01)
	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 1,560 %	CAD	22/08/2025	(3.075.742)	(0,02)
	Fijo 2,000 %	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	CAD	15/12/2031	(956.413)	(0,01)
2.510.000	Variable (CDOR a 3 meses en CAD)	Fijo 2,180 %	CAD	22/08/2052	(206.567)	(0,00)
3.620.000	Variable (LIBOR a 12 meses en CHF)	Fijo 0,000 %	CHF	09/06/2026	(291.528)	(0,00)
32.160.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	03/11/2027	(1.641.750)	(0,01)
	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	Fijo 0,250 %	EUR	15/12/2036	(66.945)	(0,00)
2.790.000	Fijo 0,750 %	Variable (EURIBOR a 6 meses en EUR)	EUR	26/11/2041	(483.314)	(0,00)
2.460.000	Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)	Fijo 4,060 %	GBP	15/12/2028	(2.332.349)	(0,01)
18.600.000	Fijo 1,000 %	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	17/03/2032	(1.340.610)	(0,01)
2.050.000	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	Fijo 1,000 %	GBP	15/12/2036	(113.090)	(0,00)
431.880.000	Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)	Fijo 0,000 %	JPY	09/06/2026	(74.326)	(0,00)
1.632.000.000	Fijo 0,000 %	Variable (LIBOR a 12 meses en JPY)	JPY	15/12/2031	(192.089)	(0,00)
91.080.000	Fijo 2,000 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	16/03/2027	(993.550)	(0,01)
	Fijo 2,130 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	11/05/2031	(797.436)	(0,01)
	Fijo 2,000 %	Variable (NIBOR a 6 meses en NOK)	NOK	16/03/2032	(422.112)	(0,00)
12.650.000	Variable (NZDBB a 3 meses en NZD)	Fijo 1,250 %	NZD	15/12/2022	(154.981)	(0,00)

#### Contratos de permutas financieras - (continuación)

Importe teórico local					Minusvalía latente	% de
neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	NOK	
	Permutas de tipos de interés - (contin	uación)				
83.150.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 0,250 %	SEK	15/12/2026	(187.740)	(0,00
29.370.000	Variable (STIBOR a 3 meses en SEK)	Fijo 1,000 %	SEK	17/03/2032	(6.579)	(0,00
14.550.000	Fijo 0,250 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2024	(154.629)	(0,00
22.180.000	Fijo 1,000 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2027	(263.646)	(0,00
6.280.000	Fijo 2,500 %	Variable (LIBOR a 3 meses en USD)	USD	17/09/2031	(326.353)	(0,00
22.790.000	Fijo 1,630 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	22/09/2036	(477.160)	(0,00
7.290.000	Fijo 1,750 %	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	USD	16/03/2052	(1.525.573)	(0,01
MINUSVALÍA LATE	NTE SOBRE PERMUTAS DE TIPOS DE	INTERÉS			(29.551.981)	(0,17
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)					
5.400.000	Variable (Unibail-Rodamco-Westfield S.E.)	Fijo 1,000 %	EUR	20/06/2024	(271.982)	(0,00
80.575.000	Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 28 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/06/2022	(138.694)	(0,00
	NTE SOBRE PERMUTAS DE CREDITICIO (CDS)	-			(410.676)	(0,00
	Permutas de inflación					
5.290.000	Fijo 1,920 %	Variable (LIBOR a 12 meses en EUR)	EUR	15/11/2031	(296.418)	(0,00
8.980.000	Variable (LIBOR a 12 meses en GBP)	Fijo 4,170 %	GBP	15/11/2028	(6.485.316)	(0,04
MINUSVALÍA LATE	NTE SOBRE PERMUTAS DE				(6.781.734)	(0,04
TOTAL DE MINUS\ DE PERMUTAS FIN	/ALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS				(36.744.391)	(0,21
	ADO DE LAS INVERSIONES					-
(coste NOK 15.563				1	5.770.261.020	91,80
OTROS ACTIVOS	Y PASIVOS				1.409.727.974	8,20
PATRIMONIO				1	7.179.988.994	100,00
TOTAL DE INVERS	SIONES				Valor de mercado NOK	% de patrimonio
Total inversiones ex	cluyendo derivados (coste NOK 15.585.85	7.001)		1	6.590.347.346	96,57
	bre contratos de futuros				87.682.284	0,5
Minusvalía latente s	obre contratos de futuros				(6.462.870)	(0,04
Plusvalía latente sol	bre contratos de divisas a plazo				32.777.430	0,19
Minusvalía latente s	obre contratos de divisas a plazo				(916.804.054)	(5,33
	e opciones compradas (coste NOK 6.618.6	661)			2.331.742	0,0
Valor de mercado de	e opciones suscritas (coste NOK (29.217.8	308))			(30.824.002)	(0,18
	bre contratos de permutas financieras	**			47.957.535	0,2
	obre contratos de permutas financieras				(36.744.391)	(0,21
Otros activos y pasi	•				1.409.727.974	8,20

El Comisionista de futuros fue Goldman Sachs & Co. LLC.

Las contrapartes de los contratos de divisas a plazo fueron Bank of America N.A., Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Deutsche Bank AG, JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc., Natwest Markets Plc. y State Street Bank & Trust.

Las contrapartes de los contratos de opciones fueron Barclays Bank Plc., BNP Paribas S.A., Citibank N.A., Deutsche Bank AG, JP Morgan Chase Bank N.A., Morgan Stanley & Co. International Plc. y UBS AG.

Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Barclays Bank Plc. y Credit Suisse.

 $La exposición \ m\'{a}xima\ a\ cada\ contraparte\ a\ 30\ de\ noviembre\ de\ 2021,\ medida\ como\ porcentaje\ del\ VL,\ es\ del\ 1,37\ \%.$ 

- (a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.
- (b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.
- (c) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.
- (d) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.
- (e) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.
- $^{(f)}$  El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del (0,627) %.

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Valores mobil	liarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial					
Bonos - 42,27						
Estados Unido	s					
14.300.000	Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	0,145 %	19/08/2022	14.306.435	1,21
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,350 %	07/01/2022	33.708.425	2,85
	Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,170 %	29/07/2022	2.901.595	0,25
	Letras de gestión de Tesorería de Estados Unidos	USD USD	0,044 %	01/03/2022	20.697.516	1,75
	Letras de gestión de Tesorería de Estados Unidos Letras de gestión de Tesorería de Estados Unidos	USD	0,053 % 0,067 %	08/03/2022 29/03/2022	92.486.790 24.994.428	7,83 2,12
	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,080 %	30/12/2021	33.797.617	2,86
	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,400 %	06/01/2022	76.996.779	6,52
	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,470 %	17/02/2022	999.896	0,08
16.800.000	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,045 %	24/02/2022	16.798.304	1,42
27.000.000	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,490 %	03/03/2022	26.996.654	2,28
	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,480 %	10/03/2022	29.596.011	2,51
	Letras del Tesoro de EE. UU.	USD	0,048 %	17/03/2022	699.897	0,06
	Pagaré de tipo variable del Tesoro de EE. UU.(c)	USD	0,204 %	31/01/2022	23.606.316	2,00
	Pagaré de tipo variable del Tesoro de EE. UU.(c)	USD	0,105 %	31/07/2022	37.815.592	3,20
	Pagaré de tipo variable del Tesoro de EE. UU.(c)	USD	0,053 %	31/10/2022	300.146	0,03
	Pagaré de tipo variable del Tesoro de EE. UU. <sup>(c)</sup> Pagaré de tipo variable del Tesoro de EE. UU. <sup>(c)</sup>	USD USD	0,099 % 0,071 %	31/01/2023 30/04/2023	16.406.743 11.602.093	1,39 0,98
	Pagaré de tipo variable del Tesoro de EE. UU.(c)	USD	0,071 %	31/10/2023	31.999.128	2,71
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	2,625 %	15/12/2021	800.766	0,07
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	2,000 %	31/12/2021	1.201.828	0,10
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	2,125 %	31/12/2021	500.811	0,04
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	2,500 %	15/01/2022	57.171	0,00
	Pagarés/Bonos del Tesoro de EE. UU.	USD	1,875 %	31/01/2022	100.303	0,01
					499.371.244	42,27
TOTAL DE BON (coste USD 499					499.371.244	42,27
Tenencias	Descripción del valor			Valor d	le mercado en USD	% del patrimonio
						patrimonio
Acciones orai	inarias – 35,24 %					
Austria						
288	Andritz AG				13.643	0,00
	BAWAG Group AG 144A <sup>(d)</sup>				2.479	0,00
	Erste Group Bank AG				3.479	0,00
	OMV AG				28.725	0,00
1.012	Raiffeisen Bank International AG				29.871	0,00
31	Verbund AG				3.218	0,00
2.449	voestalpine AG				82.028	0,01
2.688	Wienerberger AG				98.211	0,01
					261.654	0,02
Bélgica	Astronoma O con Harman NIV				F= =0-	2.22
	Ackermans & van Haaren NV				57.795	0,00
	Ageas S.A./NV				20.582	0,00
	Anheuser-Busch InBev S.A./NV				100.854	0,01
	Colruyt S.A. Elia Group S.A./NV				11.695	0,00
	KBC Group NV				62.442 242.352	0,01 0,02
	Proximus SADP				80.733	0,02
	Sofina S.A.				63.650	0,01
	Solvay S.A.				156.247	0,01
	UCB S.A.				222.378	0,02
	Umicore S.A.				37.467	0,00
	Warehouses De Pauw CVA				2.950	0,00
					1.059.145	0,09
Bermudas						
727	Everest Re Group Ltd.				186.388	0,02
Finlandia						
1.905	Elisa OYJ				113.532	0,01
					74 544	0,01
	Fortum OYJ				71.541	
1.180	Huhtamaki OYJ				50.253	0,00
1.180 1.024						

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% de patrimonio
Acciones ordi Finlandia – (co	narias – (continuación)		
	Nokia OYJ	692.777	0,06
	Nordea Bank Abp	5.134	0,00
	Orion OYJ "B"	92.374	0,01
	QT Group OYJ	3.760	0,00
	Sampo OYJ "A"	1.218	0,00
	Stora Enso OYJ "R"	30.732	0,00
2.719	Valmet OYJ	110.428	0,01
		1.462.218	0,12
Francia			
	Airbus S.E.	91.729	0,01
	Alten S.A.	77.103	0,01
	Arkema S.A.	152.522	0,01
	Atos S.E.	405.603	0,04
	BNP Paribas S.A.	103.937	0,01
	Bollore S.A.	1.704	0,00
	Bureau Veritas S.A.	166.752	0,01
	Capgemini S.E.	145.963	0,01
	Carrefour S.A.	83.773	0,01
	Compagnie de Saint-Gobain	621.421	0,05
	Compagnie Générale des Etablissements Michelin S.C.A.	100.621	0,01
	Crédit Agricole S.A.	92.062	0,01
	Dassault Systemes S.E.	4.966	0,00
	Eiffage S.A.	264.467	0,02
	Elis S.A.	98.656	0,01
	Engle S.A.	80.075	0,01
	EssilorLuxottica S.A.	93.287	0,01
	Eurazeo S.E. Faurecia S.E.	48.917 267.409	0,00 0,02
	Hermes International	5.587	0,02
	Ipsen S.A.	140.548	0,00
	La Francaise des Jeux SAEM 144A <sup>(d)</sup>	94.097	0,01
	Legrand S.A.	317.718	0,01
	L'Oreal S.A.	1.211.806	0,00
	Pernod Ricard S.A.	2.733	0,00
	Publicis Groupe S.A.	251.950	0,02
	Renault S.A.	121.092	0,01
	Rexel S.A.	76.947	0,01
	Rubis S.C.A.	49.758	0,00
13.777		1.299.857	0,11
6	Sartorius Stedim Biotech	3.516	0,00
	SCOR S.E.	83.990	0,01
341	SEB S.A.	50.161	0,01
4.506	Société Générale S.A.	139.164	0,01
493	Sodexo S.A.	41.169	0,00
385	Sopra Steria Group	67.892	0,01
1.965	SPIE S.A.	48.811	0,00
	Teleperformance	1.633	0,00
	Thales S.A.	41.123	0,00
	TotalEnergies S.E.	2.004.409	0,17
	Ubisoft Entertainment S.A.	149.259	0,01
	Valeo S.A.	286.688	0,03
	Veolia Environnement S.A.	39.595	0,00
	Vinci S.A.	100.476	0,01
2.313	Worldline S.A. 144A <sup>(d)</sup>	120.361	0,01
Georgia		9.651.307	0,82
-	TBC Bank Group Plc.	391	0,00
Alemania			
314	adidas AG	90.134	0,01
6.951	Allianz S.E.	1.497.249	0,13
	BASF S.E.	84.312	0,01
1.660	Bayerische Motoren Werke AG	157.924	0,01
	Beiersdorf AG	168.904	0,01
626	Carl Zeiss Meditec AG	124.479	0,01
	Continental AG	359.327	0,03
3.303			
	Covestro AG 144A(d)	73.163	0,01

Tenenci	ias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
		inarias – (continuación)		
Alemar		intinuación)  Deutsche Boerse AG	441.200	0,04
		Deutsche Post AG	977.645	0,04
		Deutsche Telekom AG	988.951	0,08
	2.097	Evonik Industries AG	62.579	0,00
		Evotec S.E.	3.806	0,00
		Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA	83.852	0,01
		Fresenius S.E. & Co. KGaA	79.038	0,01
		GEA Group AG Hannover Rueck S.E.	97.292 119.868	0,01 0,01
		HeidelbergCement AG	329.900	0,01
		HelloFresh S.E.	377.171	0,03
		Infineon Technologies AG	1.237.909	0,10
	1.501	Knorr-Bremse AG	148.191	0,01
		Merck KGaA	529.854	0,04
		Nemetschek S.E.	87.428	0,01
		ProSiebenSat,1 Media S.E.	98.043	0,01
		Rational AG Rheinmetall AG	47.542	0,00
		RWE AG	145.475 67.231	0,01 0,01
		SAP S.E.	1.778.889	0,15
		Siemens Energy AG	52.296	0,00
		Siemens Healthineers AG 144A <sup>(d)</sup>	2.307	0,00
	609	Sirius Real Estate Ltd.	1.098	0,00
	2.528	TAG Immobilien AG	69.540	0,01
		TeamViewer AG 144A <sup>(d)</sup>	134.421	0,01
		thyssenkrupp AG	14.158	0,00
	4.664	Zalando S.E. 144A <sup>(d)</sup>	420.981	0,04
Gibralt	ar .		11.165.666	0,94
Gibrait		888 Holdings Plc.	26.224	0,00
Guerns		oco i notalingo i ito.	20.224	
Outilit	•	Chrysalis Investments Ltd.	29.233	0,00
		Chrysans investments Ltd.	25.255	0,00
Irlanda		A	0.700.000	0.00
		Accenture Plc. "A"	3.766.996	0,32
		Allegion Plc. Aptiv Plc.	218.719 64.942	0,02 0,01
		Bank of Ireland Group Plc.	2.236	0,00
		C&C Group Plc.	285	0,00
		CRH Plc.	529.788	0,05
	1.644	DCC Plc.	120.457	0,01
	10.018	Experian Plc.	447.416	0,04
	2.787	Flutter Entertainment Plc.	376.625	0,03
		Glanbia Plc.	63.765	0,01
		Greencore Group Plc.	21.576	0,00
		Medtronic Plc.	2.525.482	0,21
		Smurfit Kappa Group Plc.	275.963 410.070	0,02 0,03
	2.197	Trane Technologies Plc.	8.824.320	0,03
Isla de		Dloytock Dlo	21121	
Israel	2.450	Playtech Plc.	24.181	0,00
	1.887	Plus500 Ltd.	31.703	0,00
Italia				
		A2A SpA	40.379	0,00
		Assicurazioni Generali SpA	91.180	0,01
		Atlantia SpA	68.312	0,01
		Davide Campari-Milano NV DiaSorin SpA	1.461 215.830	0,00 0,02
		Eni SpA	4.722	0,02
		FinecoBank Banca Fineco SpA	228.583	0,00
		Hera SpA	124.975	0,02
		Interpump Group SpA	2.872	0,00
		Intesa Sanpaolo SpA	2.610	0,00
		Italgas SpA	94.524	0,01
		Leonardo SpA	83.420	0,01
	42	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	461	0,00

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del
	inarias – (continuación)		
Italia - (contin	•	1 003	0.00
	Moncler SpA Poste Italiane SpA 144A <sup>(d)</sup>	1.003 24.451	0,00 0,00
	Prysmian SpA	159.073	0,01
310	Reply SpA	59.545	0,00
		1.203.401	0,10
Japón	ADOM A L	44.005	0.00
	ABC-Mart, Inc. ADEKA Corp.	14.025 4.707	0,00 0,00
	Aeon Co., Ltd.	57.280	0,00
	AEON Financial Service Co., Ltd.	5.356	0,00
	AGC, Inc.	9.696	0,00
200	Air Water, Inc.	2.929	0,00
	Aisin Corp.	14.612	0,00
	Alfresa Holdings Corp.	6.290	0,00
	Alps Alpine Co., Ltd. Amada Co., Ltd.	6.244 31.553	0,00 0,00
	Amano Corp.	8.240	0,00
	ANA Holdings, Inc.	72.482	0,01
	Aozora Bank Ltd.	12.988	0,00
449	Asahi Group Holdings Ltd.	16.485	0,00
	Asics Corp.	39.440	0,01
	Astellas Pharma, Inc.	99.045	0,01
	Autobacs Seven Co., Ltd.	2.541 13.963	0,00
	Benefit One, Inc. Benesse Holdings, Inc.	8.574	0,00
	Bridgestone Corp.	99.796	0,01
	Brother Industries Ltd.	29.131	0,00
700	Calbee, Inc.	15.657	0,00
	Canon Marketing Japan, Inc.	10.626	0,00
	Canon, Inc.	108.769	0,01
	Casio Computer Co., Ltd. Chubu Electric Power Co., Inc.	15.458 6.759	0,00
	Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	87.070	0,00
	Cosmo Energy Holdings Co., Ltd.	9.690	0,00
	Credit Saison Co., Ltd.	10.628	0,00
300	Dai Nippon Printing Co., Ltd.	7.009	0,00
	Daicel Corp.	4.100	0,00
	Dai-ichi Life Holdings, Inc.	105.706	0,01
	Daiichi Sankyo Co., Ltd.	133.620 32.347	0,01 0,01
	Daito Trust Construction Co., Ltd. Daiwa Securities Group, Inc.	552	0,01
	Daiwabo HoldingsCo. Ltd.	15.796	0,00
	DeNA Co., Ltd.	27.926	0,00
1.201	Dentsu Group, Inc.	37.864	0,01
	DIC Corp.	4.918	0,00
	DMG Mori Co., Ltd.	21.639	0,00
	Duskin Co., Ltd.	9.193 109.861	0,00 0,01
	East Japan Railway Co. Eisai Co., Ltd.	90.246	0,01
	Electric Power Development Co., Ltd.	11.352	0,01
	ENEOS Holdings, Inc.	370	0,00
	Fast Retailing Co., Ltd.	176.809	0,02
	FUJIFILM Holdings Corp.	119.498	0,01
	Fujitsu Ltd.	129.000	0,01
	Fukuoka Financial Group, Inc. Glory Ltd.	3.215	0,00
	GIOTY Ltd. GS Yuasa Corp.	14.531 8.326	0,00 0,00
	GungHo Online Entertainment, Inc.	13.319	0,00
	Gunma Bank Ltd.	3.657	0,00
	H.U. Group Holdings, Inc.	12.137	0,00
	Hachijuni Bank Ltd.	8.599	0,00
	Hakuhodo DY Holdings, Inc.	22.092	0,00
	Hino Motors Ltd. Hisamitsu Pharmaceutical Co, Inc.	29.576 3.492	0,00 0,00
	Hitachi Construction Machinery Co., Ltd.	20.651	0,00
	Hitachi Ltd.	27.116	0,00
	Hitachi Transport System Ltd.	8.119	0,00
1.346	Hokkaido Electric Power Co., Inc.	5.519	0,00
1.933	Hokuhoku Financial Group, Inc.	13.031	0,00

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ord	inarias – (continuación)		
Japón – (conti			
	Hokuriku Electric Power Co. Honda Motor Co., Ltd.	2.468 30.479	0,00 0,00
	Horiba Ltd.	17.713	0,00
	Hoshizaki Corp.	7.564	0,00
	Hoya Corp.	126.060	0,01
	Hulic Co., Ltd.	7.534	0,00
	IHI Corp.	11.159 24.258	0,00
	lida Group Holdings Co., Ltd. INFRONEER Holdings, Inc.	10.370	0,00 0,00
	Inpex Corp.	4.887	0,00
	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd.	27.223	0,00
	Isuzu Motors Ltd.	57.372	0,01
	Ito En Ltd.	11.716	0,00
	ITOCHU Corp.  Iwatani Corp.	32.797 10.049	0,01 0,00
	Izumi Co., Ltd.	8.267	0,00
	J Front Retailing Co., Ltd.	9.019	0,00
200	JAFCO Group Co., Ltd.	12.440	0,00
	Japan Airport Terminal Co., Ltd.	21.903	0,00
	Japan Exchange Group, Inc.	24.334	0,00
	Japan Post Holdings Co., Ltd. Japan Post Insurance Co., Ltd.	23.040 30.633	0,00 0,00
	JGC Holdings Corp.	10.039	0,00
	JTEKT Corp.	25.134	0,00
	Kakaku.com, Inc.	13.908	0,00
	Kaken Pharmaceutical Co., Ltd.	3.551	0,00
	Kamigumi Co., Ltd.	5.102	0,00
	Kaneka Corp. Kewpie Corp.	6.474 6.074	0,00 0,00
	Kikkoman Corp.	30.398	0,00
	Kinden Corp.	12.652	0,00
500	Kirin Holdings Co., Ltd.	7.931	0,00
	Kobayashi Pharmaceutical Co., Ltd.	15.676	0,00
	Kobe Steel Ltd.	35.142	0,01
	Koito Manufacturing Co., Ltd. Kokuyo Co., Ltd.	5.709 10.043	0,00 0,00
	Komatsu Ltd.	101.346	0,00
	Konami Holdings Corp.	25.446	0,00
10.432	Konica Minolta, Inc.	42.763	0,01
	Kose Corp.	23.959	0,00
	Kuraray Co., Ltd.	17.329	0,00
	Kyova Kirin Co., Ltd.	11.801 2.781	0,00 0,00
	Kyushu Financial Group, Inc.	1.331	0,00
	Kyushu Railway Co.	27.257	0,00
	Lawson, Inc.	8.834	0,00
	Lintec Corp.	2.187	0,00
	Lixil Corp. M3, Inc.	29.469 107.034	0,00 0,01
	Marubeni Corp.	26.974	0,00
	Maruha Nichiro Corp.	11.765	0,00
	Mazda Motor Corp.	54.613	0,01
	Mebuki Financial Group, Inc.	10.992	0,00
	Medipal Holdings Corp.	11.039	0,00
	Megmilk Snow Brand Co., Ltd. Mirait HoldingsCorp.	10.078 10.323	0,00 0,00
	MISUMI Group, Inc.	29.381	0,00
	Mitsubishi Chemical Holdings Corp.	9.883	0,00
	Mitsubishi Corp.	29.838	0,00
	Mitsubishi Electric Corp.	95.305	0,01
	Mitsubishi HC Capital, Inc. Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	7.477 42.427	0,00 0,01
	Mitsubishi Motors Corp.	320	0,01
	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	35.752	0,01
1.369	Mitsui & Co., Ltd.	30.642	0,00
	Mitsui Mining & Smelting Co., Ltd.	2.547	0,00
	Mitsui OSK Lines Ltd.	5.675	0,00
	Miura Co., Ltd. Mizuho Financial Group, Inc.	6.958 119.775	0,00 0,01
	Mochida Pharmaceutical Co., Ltd.	5.575	0,01
_50		0.0.0	-,

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ord	inarias – (continuación)		
Japón – (conti			
	MonotaRO Co., Ltd.	31.358	0,00
	Morinaga Milk Industry Co., Ltd.	9.473	0,00
	Murata Manufacturing Co., Ltd. Nabtesco Corp.	21.910 22.915	0,00 0,00
	NEC Corp.	15.900	0,00
	Nexon Co., Ltd.	51.464	0,01
600	NGK Insulators Ltd.	9.433	0,00
	NGK Spark Plug Co., Ltd.	9.087	0,00
	NHK Spring Co., Ltd.	11.854	0,00
	Nidec Corp.	170.990 2.732	0,02
	Nifco, Inc. Nihon Kohden Corp.	5.866	0,00 0,00
	Nihon Unisys Ltd.	7.744	0,00
	Nikon Corp.	30.917	0,00
600	Nintendo Co., Ltd.	263.422	0,02
	Nippon Electric Glass Co., Ltd.	19.254	0,00
	Nippon Express Co., Ltd.	5.667	0,00
	Nippon Kayaku Co., Ltd.	974	0,00
	Nippon Paper Industries Co., Ltd. Nippon Steel Corp.	7.426 11.742	0,00 0,00
	Nippon Suisan Kaisha Ltd.	12.617	0,00
	Nippon Telegraph & Telephone Corp.	188.021	0,02
	Nippon Television Holdings, Inc.	32.417	0,01
200	Nippon Yusen KK	12.896	0,00
	Nipro Corp.	2.829	0,00
	Nishimatsu Construction Co., Ltd.	17.767	0,00
	Nissan Motor Co., Ltd.	80.236	0,01
	Nisshin Seifun Group, Inc. Nisshinbo Holdings, Inc.	6.844 16.095	0,00 0,00
	Nitori Holdings Co., Ltd.	63.110	0,00
	NOK Corp.	10.318	0,00
	NSK Ltd.	2.016	0,00
	NTN Corp.	27.613	0,00
	NTT Data Corp.	63.258	0,01
	Oji Holdings Corp.	18.511	0,00
	OKUMA Corp. Olympus Corp.	8.279 86.747	0,00 0,01
	Omron Corp.	57.389	0,01
	Ono Pharmaceutical Co., Ltd.	8.783	0,00
100	Open House Co., Ltd.	5.643	0,00
200	Oracle Corp. Japan	19.531	0,00
	Osaka Gas Co., Ltd.	17.591	0,00
	OSG Corp.	1.435	0,00
	Otsuka Corp. Otsuka Holdings Co., Ltd.	22.747 48.677	0,00 0,01
	Outsourcing, Inc.	7.880	0,00
	PALTAC Corp.	3.882	0,00
	Panasonic Corp.	80.913	0,01
600	PeptiDream, Inc.	15.076	0,00
	Persol Holdings Co., Ltd.	13.042	0,00
	Pola Orbis Holdings, Inc.	12.417	0,00
	Rakuten Group, Inc.	11.176	0,00
	Relo Group, Inc. Renesas Electronics Corp.	9.160 132.919	0,00 0,01
	Rengo Co., Ltd.	5.226	0,00
	Resona Holdings, Inc.	8.518	0,00
200	Resorttrust, Inc.	3.247	0,00
	Ricoh Co., Ltd.	57.326	0,01
	Ryohin Keikaku Co., Ltd.	6.426	0,00
	Santen Pharmaceutical Co., Ltd.	4.850	0,00
	Sanwa Holdings Corp. Sapporo Holdings Ltd.	4.163 7.624	0,00 0,00
	Sawai Group Holdings Co., Ltd.	11.096	0,00
	SBI Holdings, Inc.	38.311	0,01
	SCREEN Holdings Co., Ltd.	66.310	0,01
	SCSK Corp.	5.656	0,00
	Seiko Epson Corp.	15.136	0,00
	Seino Holdings Co., Ltd.	11.048	0,00
	Sekisui Chemical Co., Ltd. Sekisui House Ltd.	8.086 11.705	0,00
005	Ochiour Floude LIU.	11.705	0,00

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ord	inarias – (continuación)		
Japón – (conti			
	Seven & i Holdings Co., Ltd.	14.274 9.804	0,00
	Seven Bank Ltd. SG Holdings Co., Ltd.	9.804 24.346	0,00 0,00
	Sharp Corp.	32.206	0,01
400	Shimamura Co., Ltd.	34.019	0,01
	Shimizu Corp.	21.324	0,00
	Ship Healthcare Holdings, Inc.	8.874	0,00
	Shiseido Co., Ltd. Showa Denko KK	108.418 45.785	0,01
	Skylark Holdings Co., Ltd.	34.807	0,01 0,01
	SoftBank Corp.	1.370	0,00
	SoftBank Group Corp.	31.390	0,00
100	Sohgo Security Services Co., Ltd.	4.243	0,00
	Sompo Holdings, Inc.	44.440	0,01
	Subaru Corp.	73.123	0,01
	Sugi Holdings Co., Ltd. SUMCO Corp.	12.551 73.370	0,00 0,01
	Sumitomo Chemical Co., Ltd.	53.085	0,01
	Sumitomo Corp.	67.201	0,01
893	Sumitomo Dainippon Pharma Co., Ltd.	10.835	0,00
400	Sumitomo Electric Industries Ltd.	5.212	0,00
	Sumitomo Heavy Industries Ltd.	15.379	0,00
	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	25.911	0,00
	Sumitomo Mitsui Trust Holdings, Inc. Sumitomo Rubber Industries Ltd.	48.477 24.395	0,01 0,00
	Suntory Beverage & Food Ltd.	2.845	0,00
	Suzuken Co., Ltd.	12.123	0,00
	Suzuki Motor Corp.	76.354	0,01
1.400	Tadano Ltd.	12.299	0,00
	Taiheiyo Cement Corp.	24.556	0,00
	Taisei Corp.	14.925	0,00
	Taisho Pharmaceutical Holdings Co., Ltd. Takara Holdings, Inc.	8.271 5.333	0,00 0,00
	Takashimaya Co., Ltd.	18.950	0,00
	Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	28.098	0,00
	TechnoPro Holdings, Inc.	10.877	0,00
1.958	Teijin Ltd.	22.263	0,00
	Toho Gas Co., Ltd.	5.615	0,00
	Toho Holdings Co., Ltd.	11.433	0,00
	Tohoku Electric Power Co., Inc. Tokai Carbon Co., Ltd.	2.756 19.838	0,00 0,00
	Tokuyama Corp.	10.466	0,00
	Tokyo Electric Power Co. Holdings, Inc.	5.047	0,00
	Tokyo Gas Co., Ltd.	25.308	0,00
1.600	Tokyu Corp.	22.016	0,00
	Topcon Corp.	9.372	0,00
	Toppan Printing Co., Ltd.	13.581	0,00
	Toray Industries, Inc. Tosoh Corp.	6.228 2.846	0,00 0,00
	TOTO Ltd.	17.615	0.00
600	Toyo Seikan Group Holdings Ltd.	7.265	0,00
	Toyo Suisan Kaisha Ltd.	16.113	0,00
	Toyo Tire Corp.	18.121	0,00
	Toyobo Co., Ltd.	1.034	0,00
	Toyoda Gosei Co., Ltd.	7.939	0,00
	Toyota Boshoku Corp. Toyota Motor Corp.	23.504 1.766	0,00 0,00
	Trend Micro, Inc.	34.442	0,00
	TS Tech Co., Ltd.	10.526	0,00
200	Tsuruha Holdings, Inc.	22.525	0,00
	TV Asahi Holdings Corp.	26.581	0,00
	Ube Industries Ltd.	1.492	0,00
	Ulvac, Inc.	21.757	0,00
	Ushio, Inc. Wacoal Holdings Corp.	14.754 7.063	0,00 0,00
	Welcia Holdings Co., Ltd.	17.699	0,00
	West Japan Railway Co.	55.769	0,00
	Yamada Holdings Co., Ltd.	20.830	0,00
	Yamaguchi Financial Group, Inc.	11.677	0,00
	Yamaha Corp.	11.077	0,00

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% de patrimoni
	inarias – (continuación)		
Japón – (conti		20.500	
	Yamaha Motor Co., Ltd.	62.589	0,01
	Yamato Holdings Co., Ltd.	4.703	0,00
	Yamazaki Baking Co., Ltd.	18.872	0,00
	Yaskawa Electric Corp.	71.094	0,01
	Yokogawa Electric Corp.	3.471	0,00
	Yokohama Rubber Co., Ltd.	9.894	0,00
	Yoshinoya Holdings Co., Ltd.	5.860	0,00
1.100	Zeon Corp.	11.566	0,00
Jersey		7.545.102	0,64
-	JTC Plc. 144A <sup>(d)</sup>	520	0,00
Luxemburgo			
3.948	ArcelorMittal S.A.	106.376	0,01
2.163	Eurofins Scientific S.E.	274.638	0,02
34.635	Tenaris S.A.	336.635	0,03
		717.649	0,06
Países Bajos	A allo arto NIV	CE 40E	0.01
	Adhers NV	65.185	0,01
	Adyen NV 144A <sup>(d)</sup>	909.943	0,08
	Aegon NV	98.308	0,01
	Akzo Nobel NV	341.720	0,03
	Arcadis NV	12.799	0,00
	ASM International NV	4.461	0,00
	ASML Holding NV	15.580	0,00
	ASR Nederland NV	232.610	0,02
	BE Semiconductor Industries NV	1.982	0,00
	EXOR NV	69.350	0,01
	Heineken Holding NV	109.027	0,01
	Heineken NV	34.872	0,00
	IMCD NV	4.630	0,00
	ING Groep NV	4.209 58.997	0,00
	JDE Peet's NV  Koninklijks Abald Delhaizs NV	690.093	0,00 0,06
	Koninklijke Ahold Delhaize NV	3.204	0,00
	Koninklijke DSM NV	81.914	0,00
	Koninklijke Philips NV NXP Semiconductors NV	549.689	0,01
	Randstad NV	23.172	0,00
	Royal Dutch Shell Plc. "A"	321.578	0,00
	Royal Dutch Shell Plc. "B"	2.814	0,00
	Signify NV 144A <sup>(d)</sup>	179.792	0,00
	Stellantis NV	149.679	0,01
	Wolters Kluwer NV	381.287	0,01
		4.346.895	0,37
Perú			
8.756	Hochschild Mining Plc.	15.268	0,00
Polonia			
	InPost S.A.	28.773	0,00
Portugal	Jeronimo Martins SGPS S.A.	404.007	0.04
	Jeronimo Martins 5GP5 5.A.	121.227	0,01
Singapur 3	XP Power Ltd.	192	0,00
Sudáfrica		· .	
	Investec Plc.	1.279	0,00
	Mediclinic International Plc.	43.684	0,00
		44.963	0,00
España _			
	Acciona S.A.	885	0,00
	ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.	185.438	0,02
	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	2.378	0,00
	Banco de Sabadell S.A.	200	0,00
	Banco Santander S.A.	117.189	0,01
20.106	Bankinter S.A. CaixaBank S.A.	98.161 275.932	0,01 0,02

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% de patrimoni
Acciones ord España – (con	inarias – (continuación)		
	Fluidra S.A.	87.152	0,01
	Grifols S.A.	34.229	0,00
8.571	Iberdrola S.A.	95.549	0,01
50.342	Repsol S.A.	552.108	0,05
60.246	Telefonica S.A.	271.290	0,02
		1.720.511	0,15
Suiza	Chubb Ltd.	213.390	0,02
	Coca-Cola HBC AG	160.371	0,02
	Ferrexpo Plc.	86.754	0,01
289	Garmin Ltd.	38.593	0,00
27.960	Glencore Plc.	132.054	0,01
959	TE Connectivity Ltd.	147.619	0,01
		778.781	0,07
Reino Unido			
	abrdn Plc.	39.377	0,00
	Admiral Group Plc.	149.161	0,01
	Airtel Africa Plc. 144A <sup>(d)</sup> AJ Bell Plc.	665 22.242	0,00 0,00
	Amoor Plc.	231.324	0,00
	Anglo American Plc.	127.575	0,01
	AO World Plc.	12.197	0,00
	Ascential Plc.	25.750	0,00
8.087	Ashmore Group Plc.	31.954	0,00
488	Ashtead Group Plc.	39.054	0,00
1.753	Associated British Foods Plc.	44.512	0,00
	AstraZeneca Plc.	680.764	0,06
	Auto Trader Group Plc. 144A <sup>(d)</sup>	166.665	0,02
	Aviva Plc.	108.947	0,01
	Avon Protection Plc.	10.722 162.774	0,00
	B&M European Value Retail S.A. BAE Systems Plc.	33.529	0,02 0,00
	Barclays Plc.	116.044	0,00
	Barratt Developments Plc.	18.738	0,00
	Bellway Plc.	12.415	0,00
	Berkeley Group Holdings Plc.	6.003	0,00
2.310	Biffa Plc. 144A <sup>(d)</sup>	10.662	0,00
	Big Yellow Group Plc.	885	0,00
	Bodycote Plc.	3.645	0,00
	BP PIc.	2.801	0,00
	Brewin Dolphin Holdings Plc.	308	0,00
	British American Tobacco Plc. Britvic Plc.	114.060 55.235	0,01 0,01
	Bunzl Plc.	22.786	0,00
	Burberry Group Plc.	8.668	0,00
	Bytes Technology Group Plc.	33.210	0,00
	Cairn Energy Plc.	23.807	0,00
	Capita Plc.	4.879	0,00
	Centrica Plc.	31.150	0,00
	Chemring Group Plc.	1.561	0,00
	Clarkson Plc.	1.004	0,00
	CMC Markets Plc. 144A <sup>(d)</sup>	8.415	0,00
	CNH Industrial NV	58.974	0,01
	Coats Group Plc. Computacenter Plc.	4.875 8.961	0,00
	ContourGlobal Plc. 144A <sup>(d)</sup>	5.531	0,00 0,00
	ConvaTec Group Plc. 144A <sup>(d)</sup>	114.591	0,00
	Cranswick Plc.	61.994	0,01
	Crest Nicholson Holdings Plc.	32.454	0,00
	Croda International Plc.	1.734	0,00
29.644	Currys Plc.	51.165	0,01
	Dechra Pharmaceuticals Plc.	1.335	0,00
	Diageo Plc.	3.514	0,00
	Diploma Plc.	46.328	0,01
	Direct Line Insurance Group Plc.	104.360	0,01
	DiscoverIE Group Plc.	19.074	0,00
	Domino's Pizza Group Plc.	30.231	0,00
× 477	Dr. Martens Plc.	44.547	0,01

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ord	inarias – (continuación)		_
Reino Unido -			
	Drax Group Plc. DS Smith Plc.	89.524 160.539	0,01 0,01
	Dunelm Group Pic.	34.495	0,00
	Electrocomponents Plc.	90.938	0,01
	Elementis Plc.	150	0,00
	Energean Plc. Entain Plc.	70	0,00
	Evraz Plc.	260.180 124.475	0,02 0,01
	FDM Group Holdings Plc.	88	0,00
	Ferguson Plc.	402.507	0,04
	Firstgroup Plc.	15.872	0,00
	Frasers Group Plc. Future Plc.	6.912 1.329	0,00 0,00
	Genuit Group Plc.	6.163	0,00
	Genus Plc.	574	0,00
	GlaxoSmithKline Plc.	854.434	0,07
	Grainger Plc.	30.661 72.893	0,00 0,01
	Greggs Pic. Halma Pic.	515	0,00
	Harbour Energy Plc.	56.005	0,01
6.543	Hargreaves Lansdown Plc.	115.526	0,01
	Hays Pic.	4.354	0,00
	HomeServe Plc. Howden Joinery Group Plc.	9.717 144.039	0,00 0,01
	HSBC Holdings Plc.	131.825	0,01
	IG Group Holdings Plc.	62.932	0,01
	IMI Pic.	120.780	0,01
	Imperial Brands Plc. Inchcape Plc.	61.661 59.116	0,01 0,01
	Indivior Plc.	18.497	0,01
	IntegraFin Holdings Plc.	18.392	0,00
	Intermediate Capital Group Plc.	117.115	0,01
	Intertek Group Plc.	191.821	0,02
	IP Group Plc.  J Sainsbury Plc.	19.724 54.641	0,00 0,01
	JD Sports Fashion Plc.	141.430	0,01
	Johnson Matthey Plc.	133.596	0,01
	Just Group Plc.	521	0,00
	Kainos Group Plc. Kingfisher Plc.	35.028 196.811	0,00 0,02
	Legal & General Group Plc.	365.063	0,02
	Linde Plc.	6.614	0,00
	Liontrust Asset Management Plc.	920	0,00
	Lloyds Banking Group Plc.	783.444	0,07
	LXI REIT Plc.  Man Group Plc.	688 1.342	0,00 0,00
	Marks & Spencer Group Plc.	17.166	0,00
10.482	Melrose Industries Plc.	20.033	0,00
	Micro Focus International Plc.	7.534	0,00
	Mitchells & Butlers Plc. Mitie Group Plc.	4.095 9.013	0,00 0,00
	Molten Ventures Plc.	892	0,00
	Moonpig Group Plc.	16.250	0,00
	Morgan Crucible Co. Plc.	23.210	0,00
	Morgan Sindall Group Plc.	29.868	0,00
	National Express Group Plc. (Transportes) Natwest Group Plc.	3.986 1.085	0,00 0,00
	NCC Group Plc.	5.762	0,00
2.099	Next Plc.	218.147	0,02
	Ninety One Plc.	11.678	0,00
	OSB Group Plc. Oxford Biomedica Plc.	418 1.029	0,00 0,00
	Oxford Instruments Pic.	2.331	0,00
	Pagegroup Plc.	8.016	0,00
	Paragon Banking Group Plc.	185	0,00
	Pearson Pic.	100.229	0,01
	Pentair Plc. Persimmon Plc.	322.541 216.073	0,03 0,02
	Pets at Home Group Plc.	4.170	0,00
19.174	Premier Foods Plc.	26.128	0,00

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ord	inarias – (continuación)		
Reino Unido -		0.040	0.00
	PZ Cussons Plc. QinetiQ Group Plc.	9.643 7.759	0,00 0,00
	Rathbone Brothers Plc.	661	0,00
	Redde Northgate Plc.	17.104	0,00
	Redrow Plc.	12.388	0,00
	RELX Plc. Renishaw Plc.	2.253 37.683	0,00 0,00
	Rightmove Plc.	137.739	0,01
	Rotork Plc.	48.335	0,01
	Royal Mail Plc.	179.132	0,02
	Safestore Holdings Plc. Sage Group Plc.	1.162 226.501	0,00 0,02
	Savills Plc.	24.675	0,00
	Schroders Plc.	272	0,00
	Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc.	924 1.934	0,00 0,00
	Segro Plc. Serco Group Plc.	15.915	0,00
	Smith & Nephew Plc.	318.053	0,03
	Smiths Group Plc.	136.169	0,01
	Softcat Plc. Spectris Plc.	1.076 95.958	0,00 0,01
	Spirax-Sarco Engineering Plc.	826	0,00
	Spire Healthcare Group Plc. 144A <sup>(d)</sup>	25.668	0,00
	SSE Plc.	399.396	0,04
	St James's Place Plc. Standard Chartered Plc.	1.147 63.503	0,00 0,01
	Tate & Lyle Pic.	9.293	0,00
	Taylor Wimpey Plc.	12.772	0,00
	TechnipFMC Plc.	139.794	0,01
	Telecom Plus Plc. Tesco Plc.	16.066 1.104	0,00 0,00
	TI Fluid Systems Plc. 144A <sup>(d)</sup>	8.776	0,00
	Travis Perkins Plc.	16.160	0,00
	Trinity Mirror Plc.	29.396 119.047	0,00 0,01
	Tritax Big Box REIT Plc.  Tritax EuroBox Plc. 144A <sup>(d)</sup>	746	0,00
	Tullow Oil Plc.	59.887	0,01
	Tyman Plc.	12.768	0,00
	Ultra Electronics Holdings Plc. Unilever Plc.	7.680 163.951	0,00 0,02
	United Utilities Group Plc.	10.830	0,00
	Vesuvius Plc.	10.881	0,00
	Victrex Plc. Vistry Group Plc.	31.105 14.714	0,00 0,00
	Vivo Energy Plc. 144A <sup>(d)</sup>	11.252	0,00
	Vodafone Group Plc.	143.109	0,01
	Volution Group Plc.	19.897	0,00
	Watches of Switzerland Group Plc. 144A <sup>(d)</sup> Weir Group Plc.	1.420 9.383	0,00 0,00
	Willis Towers Watson Plc.	1.922.350	0,00
		13.545.173	1,15
Estados Unido	s		
	3M Co.	778.613	0,07
	Abbott Laboratories ABIOMED, Inc.	1.969.684 237.659	0,17
	ABIOMED, Inc. Activision Blizzard, Inc.	490.951	0,02 0,04
	Adobe, Inc.	4.640.051	0,39
	Advance Auto Parts, Inc.	424.003	0,04
	Advanced Micro Devices, Inc.	3.577.262 1.600.758	0,30
	AES Corp. Aflac, Inc.	1.600.758 556.505	0,14 0,05
	Agilent Technologies, Inc.	394.905	0,03
	Air Products and Chemicals, Inc.	548.148	0,05
	Akamai Technologies, Inc.	571.614	0,05
	Alaska Air Group, Inc. Albemarle Corp.	180.972 393.872	0,02 0,03
	Alexandria Real Estate Equities, Inc.	6.202	0,00
	Align Technology, Inc.	1.293.386	0,11
5.656	Allstate Corp.	614.920	0,05

	Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
2.171   Appliabel Inc. "A"   5.18.1.89   5.52   5.18.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.215   5.48.	Acciones ord	inarias – (continuación)		
1807 Aphibeit, Inc. "C"   5.148, 215	Estados Unido	s – (continuación)		
62 Abita Coup, Inc.         1.254 Montano com, Inc.         1.00           3.57 American Administ Group, Inc.         9.00           4.585 American Express Co.         1.00           4.585 American Express Co.         1.00           5.141 American Town Corp.         2.138,850           5.181 American Town Corp.         2.208,850           5.181 American Town Corp.         2.208,600           3.184 American Town Corp.         2.208,600           3.184 American Town Corp.         7.252,600           3.184 American Town Corp.         7.252,600           3.185 American Town Corp.         2.200,000           3.185 American Town Corp.         2.200,000           3.185 American Corp.         2.200,000           3.185 American Corp.         2.200,000           3.185 American Corp.         3.200,000           3.185 APA Corp.         3.200,000 <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>				
3.579 Amazon.com. inc. 12.551.304 1.05				
38 American Alfrience Society, Inc. 4685 American Experses Co. 5117 American International Group, Inc. 6114 American International Group, Inc. 6115 American Inter				
### 558 ### 7 ### 509 ### 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ## 500 ##				
5.117 American Interactions         28.14 American Tower Corp.         213.8.55 O.07           5.181 American Vater Works Co. Inc.         87.365 O.07           9 American Vater Works Co. Inc.         87.365 O.07           19 American Vater Works Co. Inc.         87.365 O.07           19 American Vater Works Co. Inc.         87.266 O.07           19 American Vater Works Co. Inc.         19.26 O.07           2.28 Ambren Inc.         2.19.739 O.06           3.283 A.O. Shimb Corp.         60.26 O.07           3.090 A.O. Pil. C. Y.         60.26 O.07           1.390 A.P. Corp. Management, Inc.         19.21 O.07           1.222 Agole, Inc.         19.21 O.07           1.222 Agole, Inc.         19.22 O.07           2.270 Archer-Daniels-Midland Co.         17.22 O.07           2.24 Arch J. Galligher & Co.         18.22 O.07           2.24 Arch J. Galligher & Co.         19.22 O.07           2.24 Arch J. Galligher & Co.         19.22 O.07           3.0 Available Martiells, Inc.         19.40 O.07           1.24 Arch J. Galligher & Co.         19.24 O.07           2.24 Arch J. Galligher & Co.         19.24 O.07           3.0 Available Martiells, Inc.         19.24 O.07           1.24 Arch J. Galligher & Co.         19.24 O.07           3.0 Available Martiells, Inc. </td <td></td> <td>• •</td> <td></td> <td></td>		• •		
5   18		·	269.154	0,02
9 Amorpirose Financial, Inc.   156,084   0.00   1.314 Amyen, Inc.   72.262   0.04   1.315   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0.05   0	8.141	American Tower Corp.	2.136.850	0,18
1.345 AmerisaucaeBragen Corp. 3.784 Ampleand Corp. "A" 2.284 Corp. "Ampleand Corp. "Ampl				
3.744 Amgent, Inc.         172.598 (2) 0.06           3.245 Amthem, Inc.         13.4739 (1) 24.77         0.02           3.533 AO Smith Corp.         284.077 (0.02         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00         0.00				
5.248 Amphenol Cop. "A"         21,347,39         0.18           5.255 Ambrem, Inc.         213,739         0.18           3.533 AO Smith Cop.         680,200         0.02           1.3930 APA Cop.         31,940         0.03           1.7337 Applie, Inc.         1227,113         0.10           1.7227 Applie, Inc.         1227,113         0.10           1.7227 Applie, Inc.         1227,113         0.10           4.7227 Applie, Inc.         1227,123         0.10           4.7227 Applie, Inc.         1227,123         0.11           4.7227 Applie, Inc.         122,123         0.11           4.7227 Applie, Inc.         123,123         0.11           4.7227 Applie, Inc.         123,123         0.11           4.7227 Applie, Inc.         123,123         0.11           4.7227 Applie, Inc.         124,124         0.11           4.7227 Applie, Inc.         123,133         0.01           4.7227 Applie, Inc.         124,144 <td< td=""><td></td><td>· ·</td><td></td><td></td></td<>		· ·		
5.255 Anthen, Inc.         1.34.738         0.18           3.538 A Os min Corp.         284.027         0.02           2.000 Ann Pic. "A"         680.268         0.03           1.3900 APA Corp.         350.402         0.03           1.337 Apolio Global Management, Inc.         16.216.007         1.57           1.10222 APABLE, Inc.         16.216.007         1.57           1.277 Arches-Daniela-Miland Co.         17.22.22         0.01           4.2 Arthur, Callaigher & Co.         18.2         0.00           7.3 Assurant, Inc.         108.447         0.01           1.806 Autodesk, Inc.         354.900         0.05           1.808 Autodesk, Inc.         354.900         0.05           3.0 Availonilago, Communities, Inc.         757.864.50         0.01           3.10 Availonilago, Communities, Inc.         259.20         0.00           3.14 Agrae, Pharmiston Corp.         259.20         0.00           1.54 Agrae, Pharmiston Corp.         185.90         0.00           1.54 Agrae, Pharmiston Corp.         185.90         0.00           1.57 Agrae, Pharmiston Corp.         185.90         0.00           1.57 Bank of America Corp.         185.90         0.00           1.58 Agrae, Pharmiston Corp.         185.90 <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>				
\$3,533 AO Smith Corp.		·		
2,060 Aon Pic. "A"   \$60,286   0.05   13,950 APA Corp.   369,492   0.03   17,337   Apolio Global Management, Inc.   1227.113   0.10   11,0222   0.01   11,0222   0.02   17,274   17,274   18,275   18,275   17,274   17,274   18,275   18,275   17,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,275   18,2				
113237 Apollo Global Management, Inc. 110222 Apple, Inc. 18.11967 1,544 1.272 Applied Materials, Inc. 18.12967 1,544 1.273 Applied Materials, Inc. 18.12967 1,544 1.274 Arthur J Gallagher & Co. 18.1296 1,544 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545 1.275 1,545		·		
10.222 Applie Materials, Inc.	13.950	APA Corp.	359.492	0,03
1.272 Applied Materials, Inc.         187.266         0.02           2.270 Arche-Daniels-Midland Co.         172.322         0.01           42 Arthur J Gallagher & Co.         6.842         0.00           713 Assurant, Inc.         534.930         0.05           1.808 Autodesk, Inc.         481.944         0.05           3.19 Autozane, Inc.         579.645         0.05           3.0 Avaiofiasy Communities, Inc.         7.166         0.05           1.248 Avery Dennison Corp.         255.927         0.02           7.2103 Basker Hughes Co.         1.682.884         0.14           1.8148 Ball Corp.         1.685.931         0.14           7.365 Banic of America Corp.         3.244.777         2.02           1.573 Banic of New York Mellon Corp.         48.685.00         0.01           4.648 Banic of America Corp.         3.084.777         3.08           4.574 Basker International, Inc.         4.685.340         0.01           4.649 Basker International, Inc.         4.685.340         0.01           4.649 Basker International, Inc.         4.685.00         1.02           2.648 Bigon, Inc.         4.685.00         1.02           2.658 Basker International, Inc.         4.685.00         1.02           2.658 Boning Holdi	17.337	Apollo Global Management, Inc.		
270 Archer-Daniele-Midland Co.       172 322       0.01         24 Arthur J Gallagher & Co.       6.842       0.01         713 Assurant, Inc.       108.447       0.01         2.3313 Arta Tinc.       583.490       0.05         318 AutoZone, Inc.       579.645       0.00         319 AutoZone, Inc.       7.166       0.00         1.248 Avery Dennison Corp.       255.927       0.00         7.2103 Baker Hughes Co.       1.828.84       0.14         18.148 Ball Corp.       1.865.931       0.14         7.3865 Bank of America Corp.       1.866.931       0.14         8.400 Bank of New York Mellon Corp.       3.86.165       0.86.185       0.01         6.401 Bank & Body Works, Inc.       485.340       0.04         4.914 Backer International, Inc.       3.66.37       0.03         6.402 Bank & Body Works, Inc.       485.340       0.04         8.155 Bank of New York Mellon Corp.       1.575.558       0.13         6.224 Berthine Harlands yn. Inc.*       7.255.919       0.61         6.40 Bank & Body Works, Inc.       486.340       0.04         8.155 Bank of New York Mellon Corp.       3.76       0.03         6.24 Backer International, Inc.       3.80       0.01				
42 Arthur J Gallagher & Co.       6.842       0.00         713 Assurant, Inc.       534.930       0.05         1.866 Autodesk, Inc.       481.944       0.06         30 Avalofiasy Communities, Inc.       576.645       0.05         30 Avalofiasy Communities, Inc.       7.166       0.00         1.248 Avery Demission Corp.       255.927       0.02         7.2103 Baker Hughes Co.       1.682.884       0.14         1.8148 Ball Corp.       3.284.777       0.02         7.365 Bank of America Corp.       3.284.777       0.02         1.573 Bank of New York Mellon Corp.       68.185       0.01         4.640 Bank a Badoy Winter, Inc.       486.340       0.04         4.914 Baxter International, Inc.       305.437       0.03         3.624 Becknine Heldmany, Inc. To?       2.85.910       0.13         3.624 Becknine Heldmany, Inc. To?       3.276       0.13         3.628 Becknine Heldmany, Inc. To?       4.86.567       0.01         3.63 Bon Techne Corp.       4.86.567       0.04         4.8 Bo Techne Corp.       4.86.567       0.04         4.8 Bo Techne Corp.       4.86.567       0.04         4.8 Bo Techne Corp.       1.62.60       0.00         5.2 Bound Scientific Corp.				
713 Assurant, Inc.       188.447       0.01         2.3431 AT&T, Inc.       534.390       0.05         1.896 AutoZone, Inc.       481.944       0.04         319 AutoZone, Inc.       7.166       0.05         30 AvalonBay Communities, Inc.       7.166       0.00         1.248 Avery Dennison Corp.       1.682.834       0.14         1.8148 Ball Corp.       1.682.884       0.14         7.3655 Bank of America Corp.       3.284.777       0.28         1.573 Bank of New York Mellon Corp.       485.340       0.04         4.04 Bank & Boak of New York Mellon Corp.       485.340       0.04         4.04 Bank & Beak of International, Inc.       485.340       0.04         4.04 Bank & Beak District Corp.       1.575.558       0.13         6.64 Bedion Dickinson and Co.       1.575.558       0.13         6.64 Bedion Dickinson and Co.       1.575.558       0.13         6.65 Best Buy Co. Inc.       69.886       0.01         6.6 Best Buy Co. Inc.       486.567       0.04         8 Bio-Techne Corp.       3.776       0.00         75 Booking Holdings, Inc.       1.622.334       0.14         1.02 Booking Holdings, Inc.       1.022.035       0.032.035         1.03 Booking Holdings, Inc.<				
3.431 NTAT.Inc.     554,830     0.05       1.808 Autodesk, Inc.     579,645     0.05       3.0 Autoalnally Communities, Inc.     77,166     0.00       1.248 Avery Dennison Corp.     255,927     0.02       7.103 Baker Hughes Co.     1,682,884     0,14       1.8148 Ball Corp.     1,685,884     0,14       7.3655 Bank of America Corp.     32,947,777     0,28       1.575     Bank of New York Mellon Corp.     86,185     0,01       6.60 Bark B Body Works, Inc.     465,340     0,04       4.914 Baxter International, Inc.     366,437     0,03       6.64 Best Bury Co., Inc.     7,255,919     0,61       6.65 Best Bluy Co., Inc.     69,886     0,01       2.64 Biogen, Inc.     486,567     0,04       8 Bi-Techne Corp.     3,776     0,00       775 Booking Holdings, Inc.     1,628,934     0,14       1,152 Boxin Scientific Corp.     486,567     0,04       1,152 Boxin Scientific Corp.     486,541     0,04       1,152 Boxin Scientific Corp.     1,628,64     0,13       1,153 Boxin Scientific Corp.     486,541     0,04       1,152 Boxin Scientific Corp.     1,628,64     0,13       1,16 Brown & Brown, Inc.     1,565,648     0,13       1,16 Brown & Brown, Inc.     1,566,648 <td></td> <td>· ·</td> <td></td> <td></td>		· ·		
1.886 AutoZenk, Inc.       481,944 0,04         3.19 AutoZenk, Inc.       579,645 0,05         3.0 AvalonBay Communities, Inc.       7,166 0,00         1.24 & Wey Dennison Corp.       255,927 0,02         7.2 103 Baker Hughes Co.       1,682,884 0,14         1.8 14.18 Ball Corp.       3,284,777 0,28         1.37 Bank of New York Mellon Corp.       3,284,777 0,28         6.40 Bank & Rody Works, Inc.       485,340 0,04         4.94 Bank & Bedro International, Inc.       485,340 0,03         6.64 Bedro International, Inc.       365,347 0,03         6.62 Bedro International, Inc.       1,575,558 0,13         6.63 Best Buy Co., Inc.       485,340 0,03         644 Best Buy Co., Inc.       485,557 0,04         655 Best Buy Co., Inc.       485,550 0,04         66 Best Buy Co., Inc.       485,550 0,04         67 Best Buy Co., Inc.       1,578,558 0,04         68 Best Buy Co., Inc.       1,582,534 0,04         69 Best Buy Co., Inc.       1,582,534 0,04         1,78 Boxing Holdings, Inc.       1,582,534 0,04         2,88 Boxing Holdings, Inc.       1,582,534 0,04         1,192 Boxing Abdroing, Inc.       1,583,546 0,03         1,68 Boxing Abdroing, Inc.       1,583,546 0,03         1,89 Boxing Abdroing, Inc.       1,583,546 0,0				
319 AutoCane, Inc.       579.645       0,05         30 AveroDeanison Corp.       25.927       0,02         1 248 Avery Dennison Corp.       1.862.884       0,14         18 148 Ball Corp.       1.862.834       0,14         1 7,3865 Bank of America Corp.       3.284.777       0,28         1,573 Bank of New York Mellon Corp.       86.185       0,01         6,400 Bank & Body Works, Inc.       86.185       0,01         4,914 Baxter International, Inc.       366.437       0,03         8,644 Becton Dickinson and Co.       1.575.888       0,13         26,228 Bertshirth Harthaway, Inc. "8"       7.265.919       0,81         64 Best Buy Co., Inc.       69.886       0,01         2064 Biggen, Inc.       486.867       0,04         8 Bio-Techne Corp.       3.776       0,00         77 Sbocking Holdings, Inc.       1.62.893       0,14         2,39 BorgWarner, Inc.       1.42.89       0,14         1,1762 Boston Scientific Corp.       448.841       0,04         1,1862 Boston Scientific Corp.       448.841       0,04         1,1872 Boston Scientific Corp.       1.56.948       0,13         2,217 Graddorm, Inc.       1.96.674       0,17         2,217 Corp.       1.81.00 <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>				
1.248   Avery Demison Corp.   525.927   0.02     72.103   Baker Hughes Co.   1.686.284   0.14     73.865   Baker Grammerica Corp.   1.695.931   0.14     73.865   Bank of New York Mellon Corp.   86.185   0.01     6.460   Bank of New York Mellon Corp.   86.185   0.01     6.490   Bank of New York Mellon Corp.   86.185   0.01     6.491   Bank of New York Mellon Corp.   86.185   0.01     6.492   Bank of New York Mellon Corp.   86.185   0.01     6.493   Bank of New York Mellon Corp.   86.185   0.01     6.494   Bank of Demisson and Co.   1.575.558   0.13     7.494   Bacter International, Inc.   986.437   0.03     7.495   Berchairle Hathaway, Inc. 'B'   7.255.919   0.61     7.495   Berchairle Hathaway, Inc. 'B'   7.255.919   0.61     7.595   Borgh Varner, Inc.   486.567   0.00     8   Bio-Techne Corp.   3.776   0.00     9   Borgh Varner, Inc.   1.629.93   0.14     1.1782   Boston Scientific Corp.   444.541   0.01     1.1782   Boston Scientific Corp.   444.541   0.01     1.1782   Boston Scientific Corp.   444.541   0.01     1.1812   Capasar Entratiament, Inc.   1.031   0.00     2.205   Caesars Entratiament, Inc.   1.031   0.00     2.205   Caesars Entratiament, Inc.   1.031   0.00     2.205   Caesars Entratiament, Inc.   3.306   0.01     2.1811   Capital One Financial Corp.   254.500   0.02     1.812   Carlinal Health, Inc.   3.306   0.01     2.1812   Carlinal Health, Inc.   3.306   0.01     2.1813   Carlinal Beath, Inc.   3.306   0.01     2.1814   Carlinal Leath, Inc.   3.306   0.01     2.1814   Carlinal Leath, Inc.   3.306   0.01     2.1812   Carlinal Health, Inc.   3.306   0.01     2.1812   Carlinal Health, Inc.   3.306   0.01     3.1814   Carlinal Leath, Inc.   3.306   0.01     3.1814   Carlinal Health, Inc.   3.306   0.01     3.1814   Carlinal Health, Inc.   3.307   0.00     3.1816   Carlinal Health, Inc.   3.306   0.01     3.1816   Carlinal Health, Inc.   3.306   0.			579.645	0,05
72.103       Baker Hughes Co.       1.682.284       0.14         18.14.8       Ball Corp.       1.685.331       0.14         17.38.55       Bank of America Corp.       3.284.777       0.28         1.573       Bank of New York Mellon Corp.       86.185       0.01         640       Bath & Body Works, Inc.       485.340       0.04         4.914       Baxter International, Inc.       366.437       0.03         6.64       Betron Dickinson and Co.       1.575.558       0.13         6.64       Betrishire Hathaway, Inc. 'B'       7.259.919       0.81         664       Betrishire Hathaway, Inc. 'B'       6.81       0.61         68       Bio-Techne Corp.       3.766       0.00         8       Bio-Techne Corp.       3.776       0.00         77       5       Booking Holdings, Inc.       1.1229.934       0.14         1.172       2.63       Borg Warmer, Inc.       1.124.216       0.01         1.178       Boston Scientific Corp.       448.541       0.04         1.95       Bristal-Myers Scigub Co.       1.04       1.04         1.6       Brown & Brown, Inc.       1.05       1.01         1.6       Brown & Brown, Inc.       1.02 <td>30</td> <td>AvalonBay Communities, Inc.</td> <td>7.166</td> <td>0,00</td>	30	AvalonBay Communities, Inc.	7.166	0,00
18.148 Ball Commertea Corp       3.284 777       0.28         1.573 Bank of New York Mellon Corp.       86.185       0.01         6.400 Bah & Body Works, Inc.       485.340       0.04         4.914 Banker International, Inc.       366.437       0.03         6.644 Becton Dickinson and Co.       1.575.559       0.13         6.645 Best Buy Co., Inc.       68.868       0.01         2.064 Biggen, Inc.       486.567       0.01         8 Bio-Techne Corp.       3.76       0.00         75 Booking Holdings, Inc.       1.629.934       0.14         1.1782 Boston Scientific Corp.       448.541       0.01         1.1782 Boston Scientific Corp.       448.541       0.01         1.1782 Boston Scientific Corp.       448.541       0.04         1.1812 Brastonn, Inc.       1.03       0.00         2.1812 Broadcorn, Inc.       1.03       0.00         2.1812 Grown & Brown, Inc.       1.03       0.00         2.1812 Grown & Brown, Inc.       1.03       0.00 <td></td> <td>· ·</td> <td></td> <td></td>		· ·		
73.865         Bank of America Corp.         86.185         0.01           6.460         Bath & Rolw Work Mellon Corp.         485.340         0.04           6.491         Bath & Body Works, Inc.         366.437         0.03           6.644         Becton Dickinson and Co.         1.575.558         0.13           2.224         Berkshire Halfhaway, Inc. "B"         7.255.919         0.61           6.64         Biogen, Inc.         486.567         0.04           8         Bio-Techne Corp.         3.776         0.00           775         Booking Holdings, Inc.         1.628.934         0.14           2.639         Borg/Warner, Inc.         1.628.934         0.14           1.158         Boston Scientific Corp.         448.541         0.04           1.558         Brisol-Myers Squibb Co.         1.03         0.00           2.152         Broadcom, Inc.         1.568.948         0.13           1.6         Brown & Brown, Inc.         1.559.948         0.13           1.6         Brown & Brown, Inc.         1.559.948         0.13           2.040         Campbell Soup Co.         2.257.00         2.254.500         0.02           2.057         Cassars Entertainment, Inc.         3.25.20		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		
1.573       Bank of New York Mellon Corp.       4815.34       0.04         6.469       Bath & Body Works, Inc.       368.437       0.03         6.494       Becton Dickinson and Co.       1.575.558       0.13         6.262       Bers Buy Co., Inc.       69.886       0.01         654       Best Buy Co., Inc.       69.886       0.01         654       Best Buy Co., Inc.       486.567       0.06         8       Bio-Techne Corp.       3.776       0.00         75       Booking Holdings, Inc.       1.628,934       0.14         2.639       BorgWarner, Inc.       114.216       0.01         1.1782       Bosban Scientific Corp.       114.8216       0.01         1.1782       Bosban Scientific Corp.       114.8366       0.09         2.812       Broadcom, Inc.       1.556.948       0.13         1.6       Brown, Inc.       1.03       0.00         2.812       Broadcom, Inc.       1.03       0.01         2.812       Broadcom, Inc.		•		
6.460       Bath & Body Works, Inc.       485.340       0.04         4.914       Bacter International, Inc.       366.347       0.03         6.644       Becton Dickinson and Co.       1.575.558       0.13         26.224       Berkshire Hathaway, Inc. 'Br'       7.255.919       0.61         654       Best Buy Co., Inc.       486.567       0.04         8 Bio-Techne Corp.       3.776       0.00         775       Booking Holdings, Inc.       1.628.934       0.14         2.639       BorgWarner, Inc.       1.628.934       0.14         1.782       Boston Scientific Corp.       448.541       0.04         1.9558       Bristol-Myers Squibb Co.       1.048.896       0.09         2.812       Broad & Brown, Inc.       1.034       0.00         2.957       Cassars Entertainment, Inc.       1.906.67       0.07         2.057       Cassars Entertainment, Inc.       1.906.67       0.07         2.057       Cassars Entertainment, Inc.       1.906.67       0.07         2.057       Cassars Entertainment, Inc.       1.906.67       0.07         2.801       Cardinal Health, Inc.       8.00       0.01         2.802       Cardinal Health, Inc.       8.00 <t< td=""><td></td><td>·</td><td></td><td></td></t<>		·		
4 914 Baxter International, Inc.       366.437 0.03         6 644 Betcon Dickinson and Co.       1.575.558 0.13         26 224 Berkshire Hathaway, Inc. 'B'       7.255.919 0.61         654 Best Buy Co., Inc.       486.567 0.04         2.094 Biggen, Inc.       486.567 0.00         8 Bio-Techne Corp.       3.776 0.00         775 Booking Holdings, Inc.       116.289.34 0.14         2.639 BorgWarner, Inc.       114.216 0.01         11.782 Boston Scientific Corp.       448.541 0.04         19.558 Bristol-Myers Squibb Co.       1.048.806 0.09         2.812 Broadcorn, Inc.       1.058.948 0.13         16 Brown & Brown, Inc.       1.031 0.00         2.057 Caesars Entertainment, Inc.       1.988.674 0.77         2.040 Campbell Soup Co.       82.273 0.01         1.811 Capital One Financial Corp.       82.273 0.01         1.802 Cardinal Health, Inc.       83.306 0.01         2.05 Cardinal Health, Inc.       83.306 0.01         2.073 Carrier Global Corp.       82.273 0.01         2.074 Cardinal Health, Inc.       93.0733 0.00         2.075 Cardinal Health, Inc.       93.0730 0.00         2.076 Cardinal Health, Inc.       93.0730 0.00         2.077 Cardinal Health, Inc.       93.0730 0.00         4.731 Caterpillar, Inc.       6.7		•		
6.644       Betton Dickinson and Co.       1.576.558       0.13         26.224       Berkshire Hathaway, Inc. 'B'       7.255.919       0.61         654       Best Buy Co., Inc.       69.886       0.01         2.054       Biogen, Inc.       486.567       0.04         8       Bio-Techne Corp.       3.776       0.00         775       Booking Holdings, Inc.       1.628.934       0.14         2.639       BorgWarner, Inc.       1.14.26       0.01         1.782       Boston Scientific Corp.       448.541       0.04         1.558       Bristol-Myers Squibb Co.       1.08.866       0.09         2.812       Broadcom, Inc.       1.556.948       0.13         16       Brown & Brown, Inc.       1.09.00       1.00         2.207       Ceassars Entertainment, Inc.       1.956.674       0.17         2.040       Campbell Soup Co.       82.273       0.01         1.811       Capital One Financial Corp.       82.273       0.01         2.180       Cardinal Health, Inc.       83.306       0.01         2.181       Cardinal Health, Inc.       83.306       0.01         3.181       Catepillar, Inc.       90.79       0.15				
654 Best Buy Co., Inc.         69.886         0.01           2.064 Biogen, Inc.         486.567         0.04           8 Bio-Techne Corp.         3.776         0.00           775 Booking Holdings, Inc.         11.628.934         0.14           2.639 BorgWamer, Inc.         114.216         0.01           11,782 Boston Scientific Corp.         448.541         0.04           11,558 Biristol-Myers Squibb Co.         1.048.896         0.09           2.812 Broadcom, Inc.         1.556.948         0.13           1 Brown & Brown, Inc.         1.03         0.00           2.057 Cassars Entertainment, Inc.         1.986.674         0.17           2.040 Carphell Soup Co.         82.273         0.01           1.811 Capital One Financial Corp.         82.273         0.01           2.180 Cardinal Health, Inc.         83.306         0.01           2.193 Carrier Global Corp.         1.465.191         0.12           2.103 Carrier Global Corp.         1.465.191         0.12           6.181 Casterpillar, Inc.         91.73         0.00           9 C Dec Global Markets, Inc.         6.705         0.00           9 S DER Group, Inc. "A"         9.270         0.00           2.899 C Dec Global Markets, Inc.         6.705			1.575.558	0,13
2.064       Bion-Techne Corp.       3.776       0.00         775       Booking Holdings, Inc.       1.622.934       0,14         2.639       BorgWarner, Inc.       114.216       0.01         1.1782       Boston Scientific Corp.       448.541       0,04         1.9558       Bristol-Myers Squibb Co.       1.048.896       0.09         2.812       Brown & Brown, Inc.       1.031       0.00         2.040       Campbell Soup Co.       1.986.674       0,17         2.040       Campbell Soup Co.       82.273       0.01         1.801       Captilial Corp.       254.500       0.02         1.802       Cardinal Health, Inc.       30.793       0.00         2.180       Cardinal Health, Inc.       30.793       0.00         2.1802       Cardinal Health, Inc.       30.793       0.00         2.1802       Cardinal Health, Inc.       30.793       0.00         2.1802       Cardinal Health, Inc.       30.793       0.00         2.1803       Cardinal Health, Inc.       91.733       0.15         4.181       Cardinal Health, Inc.       91.733       0.05         5.202       Cardial Corp.       1.733.276       0.15         6.	26.224	Berkshire Hathaway, Inc. "B"	7.255.919	0,61
8 Bio-Techne Corp.         3.776         0.00           775 Booking Holdings, Inc.         1.628.934         0,14           2.639 BorgWarner, Inc.         114.216         0.01           11.782 Boston Scientific Corp.         448.541         0.04           19.558 Bristol-Myers Squibb Co.         1.048.896         0.09           2.812 Broadcom, Inc.         1.556.948         0.13           16 Brown & Brown, Inc.         1.986.674         0.17           2.040 Campbell Soup Co.         82.273         0.01           1.811 Capital One Financial Corp.         83.308         0.01           1.812 Cardinal Health, Inc.         83.308         0.01           21.802 Cardinal Health, Inc.         83.308         0.01           21.813 Carrian Co.         1.733.276         0.15           4.734 Caterpillar, Inc.         1.733.276         0.15           4.731 Caterpillar, Inc.         9.17         9.00           2.899 CDW Corp.         54.955         0.05           2.899 CDW Corp.         54.955         0.05           4.991 Centene Corp.         36.20         0.00           4.931 Centene Corp.         36.20         0.00           4.932 Certer Corp.         9.519         0.00           4.				
775         Booking Holdings, Inc.         1.628.934         0,14           2.633         BorgWarner, Inc.         448.541         0,00           11.782         Boston Scientific Corp.         448.541         0,04           19.558         Bristol-Myers Squibb Co.         1.048.896         0,09           2.812         Broadcom, Inc.         1.056.948         0,13           10         Brown & Brown, Inc.         1.031         0,00           2.047         Caspell Soup Co.         82.273         0,01           1.811         Capital One Financial Corp.         254.500         0,02           1.802         Cardinal Health, Inc.         83.306         0,01           2.181         Cardiax, Inc.         30.793         0,00           2.703         Carrier Global Corp.         1.465.191         0,12           6.181         Carviax, Inc.         30.793         0,00           5.2 Choe Global Markets, Inc.         91.739         0,00           97         CBRE Group, Inc. *A*         92.70         0,00           2.899         CDW Corp.         548.955         0,05           1.89         Celanese Corp.         28.07         0,00           4.931         Centene Corp.				
2.63 BorgWarner, Inc.       114.216       0,01         11.782 Boston Scientific Corp.       448.541       0,04         1.9558 Bristol-Myers Squibb Co.       1.048.896       0,09         2.812 Broadcom, Inc.       1.556.948       0,13         1.6 Brown & Brown, Inc.       1.98.674       0,17         2.040 Campbell Soup Co.       82.273       0,01         1.811 Capital One Financial Corp.       254.500       0,02         1.802 Cardinal Health, Inc.       33.306       0,01         218 Cardwax, Inc.       30.793       0,00         27.073 Carrier Global Corp.       1.465.191       0,12         6.181 Caravana Co.       1.733.276       0,15         4.731 Caterpillar, Inc.       914.739       0,06         52 Cboe Global Markets, Inc.       9.00       0,00         97 CBRE Group, Inc. "A"       9.00       0,00         4.931 Centene Corp.       548.955       0,05         189 Celanese Corp.       28.007       0,00         9.525 Cremer Corp.       362.213       0,03         5.250 Cerner Corp.       369.863       0,03         676 CF Industries Holdings, Inc.       9.519       0,00         2.638 Charles River Laboratories International, Inc.       9.519 <t< td=""><td></td><td>·</td><td></td><td></td></t<>		·		
11.782       Boston Scientific Corp.       448.541       0,04         19.558       Bristol-Myers Squibb Co.       1,048.896       0,09         2.812       Broadcom, Inc.       1,556.948       0,13         16       Brown & Brown, Inc.       1,001       0,00         2.057       Caesars Entertainment, Inc.       1,986.674       0,17         2.040       Campbell Soup Co.       82.273       0,01         1.811       Capital One Financial Corp.       254.500       0,02         1.802       Cardinal Health, Inc.       30.793       0,00         2.1802       Cardinal Health, Inc.       30.793       0,00         2.1802       Cardinal Health, Inc.       30.793       0,00         2.1802       Cardinal Health, Inc.       30.793       0,00         2.1803       Cardinal Health, Inc.       91.72       0,00         4.181       Carvan Co.       1,733.276       0,15         4.181       Carvan Co.       1,732.276       0,15         4.181       Carvan Co.       1,732.276       0,00         2.899       CDW Corp.       548.955       0,05         1.891       Celanese Corp.       382.123       0,03         4.931				
19.558       Bristol-Myers Squibb Co.       1.048.896       0.09         2.812       Broadcom, Inc.       1.556.948       0.13         16       Brown & Brown, Inc.       1.031       0.00         22.057       Caesars Entertainment, Inc.       1.986.674       0.17         2.040       Cambbell Soup Co.       82.273       0.01         1.811       Capital One Financial Corp.       83.306       0.01         1.802       Cardinal Health, Inc.       83.306       0.01         21       Cardwa, Inc.       30.793       0.00         27.073       Carrier Global Corp.       1.465.191       0.12         6.181       Carvana Co.       1.733.276       0.15         4.731       Caterpillar, Inc.       914.739       0.08         52       Cboe Global Markets, Inc.       914.739       0.00         97       CBRE Group, Inc. "A"       9.270       0.00         2.899       CDW Corp.       548.955       0.55         189       Celanese Corp.       352.123       0.03         4.931       Centene Corp.       352.123       0.03         5.250       Cerner Corp.       369.863       0.01         2.638       Charles River Labo				
2.812       Broadcom, Inc.       1.556.948       0,13         1 6       Brown & Brown, Inc.       1.000         2.057       Caesars Enterlainment, Inc.       1.986.674       0,17         2.040       Campbell Soup Co.       82.273       0,01         1.811       Capital One Financial Corp.       254.500       0,02         1.802       Cardinal Health, Inc.       83.306       0,01         21 Cardinal Health, Inc.       30.793       0,00         27.073       Carrier Global Corp.       1.465.191       0,15         6.181       Carvana Co.       1.733.276       0,15         4.731       Caterpillar, Inc.       91.739       0,08         52       Cboe Global Markets, inc.       6,705       0,00         97       CBRE Group, Inc. "A"       9.270       0,00         2.899       CDW Corp.       548.955       0,05         189       Celanese Corp.       352.123       0,03         4.931       Centene Corp.       369.863       0,03         676       C F Industries Holdings, Inc.       9.51       0,00         2.633       C Farler Corp.       9.51       0,00         2.634       C Farler Corp.       1.267 <td< td=""><td></td><td>·</td><td></td><td></td></td<>		·		
22.057       Caesars Entertainment, Inc.       1.986.674       0,17         2.040       Campbell Soup Co.       82.273       0,01         1.811       Capital One Financial Corp.       254.500       0,02         1.802       Cardinal Health, Inc.       83.306       0,01         218       Cardwax, Inc.       30.793       0,00         27.073       Carrier Global Corp.       1.465.191       0,12         6.181       Carvana Co.       1.733.276       0,15         4.731       Caterpillar, Inc.       914.739       0,08         52       Cobe Global Markets, Inc.       914.739       0,08         52       Cobe Global Markets, Inc.       9.270       0,00         2.899       CDW Corp.       548.955       0,05         189       Celanese Corp.       28.607       0,00         4.931       Centene Corp.       352.123       0,03         5.250       Cerner Corp.       369.83       0,03         676       C Industries Holdings, Inc.       40.959       0,00         2.633       Charles Schwab Corp.       9.519       0,00         246       Charler Communications, Inc. "A"       158.985       0,01         2.722       <			1.556.948	
2.040       Campbell Soup Co.       82.273       0.01         1.811       Capital One Financial Corp.       254.500       0.02         1.821       Carfinancial Health, Inc.       33.306       0.01         218       Carfier Global Corp.       30.793       0.00         27.073       Carrier Global Corp.       1.465.191       0.15         6.181       Carvana Co.       1.733.276       0.15         4.731       Caterpillar, Inc.       914.739       0.08         52       Cboe Global Markets, Inc.       6.705       0.00         97       CBRE Group, Inc. "A"       9.270       0,00         2.899       CDW Corp.       548.955       0.05         189       Celanese Corp.       28.607       0.00         4.931       Centene Corp.       352.123       0.03         5.200       Cerner Corp.       369.83       0.03         676       CF Industries Holdings, Inc.       40.959       0.00         2.633       Charlers Schwab Corp.       9.519       0.00         2.646       Charler Communications, Inc. "A"       158.985       0.01         2.722       Chemed Corp.       2.567.905       0.22         2.751       Chevr	16	Brown & Brown, Inc.	1.031	0,00
1.811       Capital One Financial Corp.       0,02         1.802       Cardinal Health, Inc.       83.306       0,01         218       Cardinal, Inc.       30.793       0,01         27.073       Carrier Global Corp.       1.465.191       0,12         6.181       Carvana Co.       1.733.276       0,15         4.731       Caterpillar, Inc.       91.739       0,08         52       Cboe Global Markets, Inc.       6.705       0,00         97       CBRE Group, Inc. "A"       9.270       0,00         2.899       CDW Corp.       548.995       0,05         189       Celanese Corp.       28.607       0,00         4.931       Centree Corp.       362.123       0,03         5.250       Cerner Corp.       369.863       0,03         6.76       C Industries Holdings, Inc.       40.959       0,00         2.638       Charler Skiver Laboratories International, Inc.       965.165       0,08         123       Charles Schwab Corp.       9.519       0,00         2.722       Chemed Corp.       1.267.064       0,11         2.722       Chemed Corp.       2.567.905       0,22         275       Chemed Corp.       2.	22.057	Caesars Entertainment, Inc.		0,17
1.802       Cardinal Health, Inc.       83.306       0,01         218       CarMax, Inc.       30.793       0,00         27.073       Carrier Global Corp.       1.465.191       0,12         6.181       Cavrana Co.       1.733.276       0,15         4.731       Caterpillar, Inc.       914.739       0,08         52       Cboe Global Markets, Inc.       6.705       0,00         97       CBRE Group, Inc. "A"       9.270       0,00         2.899       CDW Corp.       548.955       0,05         189       Celanese Corp.       352.123       0,03         4.931       Centere Corp.       352.123       0,03         5.250       Cerner Corp.       369.863       0,03         676       CF Industries Holdings, Inc.       40.959       0,00         2.638       Charles River Laboratories International, Inc.       965.165       0,08         123       Charles Schwab Corp.       9.519       0,00         2.64       Charler Communications, Inc. "A"       1.267.064       0,11         2.722       Chemed Corp.       2.567.905       0,22         279       Chipotle Mexican Grill, Inc.       488.511       0,04         721				
218 CarMax, Inc.       30.793       0,00         27.073 Carrier Global Corp.       1.465.191       0,12         6.181 Carvana Co.       1.733.276       0,15         4.731 Caterpillar, Inc.       914.739       0,08         52 Cboe Global Markets, Inc.       6.705       0,00         97 CBRE Group, Inc. "A"       9.270       0,00         2.899 CDW Corp.       548.955       0,05         189 Celanese Corp.       28.607       0,00         4.931 Centene Corp.       352.123       0,03         5.250 Cerner Corp.       369.863       0,03         6.75 F Industries Holdings, Inc.       40.959       0,00         2.638 Charles River Laboratories International, Inc.       965.165       0,8         123 Charles Schwab Corp.       9.519       0,00         246 Charter Communications, Inc. "A"       158.985       0,01         2.722 Chemed Corp.       2.567.905       0,22         279 Chipotte Mexican Grill, Inc.       458.511       0,04         721 Church & Dwight Co., Inc.       64.443       0,01         9.089 Cigna Corp.       1744.179       0,15         3.633 Cincinnati Financial Corp.       413.799       0,04		·		
27.073       Carrier Global Corp.       1.465.191       0,12         6.181       Carvana Co.       1.733.276       0,15         4.731       Caterpillar, Inc.       914.739       0,08         52       Cboe Global Markets, Inc.       6.705       0,00         97       CBRE Group, Inc. "A"       9.270       0,00         2.899       CDW Corp.       548.955       0,05         189       Celanese Corp.       28.607       0,00         4.931       Centene Corp.       352.123       0,03         5.250       Cerner Corp.       369.863       0,03         676       CF Industries Holdings, Inc.       40.959       0,00         2.633       Charles River Laboratories International, Inc.       965.165       0,08         123       Charles River Laboratories International, Inc.       965.165       0,08         123       Charles Corp.       9.519       0,00         246       Charler Communications, Inc. "A"       1.267.064       0,11         2.722       Chemed Corp.       2.567.905       0,22         279       Chipotte Mexican Grill, Inc.       458.511       0,04         721       Church & Dwight Co., Inc.       458.511       0,04				
6.181 Carvana Co.       1.733.276       0,15         4.731 Caterpillar, Inc.       914.739       0,08         52 Cboe Global Markets, Inc.       6.705       0,00         97 CBRE Group, Inc. "A"       9.270       0,00         2.899 CDW Corp.       548.955       0,05         189 Celanese Corp.       28.607       0,00         4.931 Centene Corp.       352.123       0,03         5.250 Cerner Corp.       369.863       0,03         676 CF Industries Holdings, Inc.       40.959       0,00         2.638 Charles River Laboratories International, Inc.       965.165       0,08         123 Charles Schwab Corp.       9.519       0,00         246 Charter Communications, Inc. "A"       158.985       0,01         2.722 Chemed Corp.       2.567.005       0,22         275 Chipotle Mexican Grill, Inc.       458.511       0,04         721 Church & Dwight Co., Inc.       454.43       0,01         9.090 Cigna Corp.       1,744.179       0,15         3.633 Cincinnati Financial Corp.       413.799       0,04				
4.731       Caterpillar, Inc.       914.739       0,08         52       Cboe Global Markets, Inc.       6.705       0,00         97       CBRE Group, Inc. "A"       9.270       0,00         2.899       CDW Corp.       548.955       0,05         189       Celanese Corp.       28.607       0,00         4.931       Centene Corp.       352.123       0,03         5.250       Cerner Corp.       369.863       0,03         676       CF Industries Holdings, Inc.       40.959       0,00         2.638       Charles River Laboratories International, Inc.       965.165       0,08         123       Charles Schwab Corp.       9.519       0,00         246       Charler Communications, Inc. "A"       158.985       0,01         2.722       Chemed Corp.       1.267.064       0,11         2.725       Chemed Corp.       2.567.905       0,22         279       Chipotle Mexican Grill, Inc.       458.511       0,04         721       Church & Dwight Co., Inc.       64.443       0,01         9.089       Cigna Corp.       1.744.179       0,15         3.633       Cincinnati Financial Corp.       413.799       0,04				
52       Cboe Global Markets, Inc.       6.705       0,00         97       CBRE Group, Inc. "A"       9.270       0,00         2.899       CDW Corp.       548.955       0,05         189       Celanese Corp.       28.607       0,00         4.931       Centene Corp.       362.123       0,03         5.250       Cerner Corp.       369.863       0,03         676       CF Industries Holdings, Inc.       40.959       0,00         2.638       Charles River Laboratories International, Inc.       965.165       0,08         123       Charles Communications, Inc. "A"       9.519       0,00         246       Charler Communications, Inc. "A"       158.985       0,01         2.722       Chemed Corp.       1.267.064       0,11         22.751       Chevron Corp.       2.567.905       0,22         279       Chipotle Mexican Grill, Inc.       458.511       0,04         721       Church & Dwight Co., Inc.       64.443       0,01         9.089       Cigna Corp.       1.744.179       0,15         3.633       Cincinnati Financial Corp.       413.799       0,04				
2.899       CDW Corp.       548.955       0,05         189       Celanese Corp.       28.607       0,00         4.931       Centene Corp.       352.123       0,03         5.250       Cerner Corp.       369.863       0,03         676       CF Industries Holdings, Inc.       40.959       0,00         2.638       Charles River Laboratories International, Inc.       965.165       0,08         123       Charles Schwab Corp.       9.519       0,00         246       Charter Communications, Inc. "A"       158.985       0,01         2.722       Chemed Corp.       1.267.064       0,11         22.751       Chevron Corp.       2.567.905       0,22         279       Chipotle Mexican Grill, Inc.       458.511       0,04         721       Church & Dwight Co., Inc.       64.443       0,01         9.089       Cigna Corp.       1.744.179       0,15         3.633       Cincinnati Financial Corp.       413.799       0,04				
189 Celanese Corp.       28.607       0,00         4.931 Centene Corp.       352.123       0,03         5.250 Cerner Corp.       369.863       0,03         676 CF Industries Holdings, Inc.       40.959       0,00         2.638 Charles River Laboratories International, Inc.       965.165       0,08         123 Charles Schwab Corp.       9.519       0,00         246 Charter Communications, Inc. "A"       158.985       0,01         2.722 Chemed Corp.       1.267.064       0,11         22.751 Chevron Corp.       2.567.905       0,22         279 Chipotle Mexican Grill, Inc.       458.511       0,04         721 Church & Dwight Co., Inc.       64.443       0,01         9.089 Cigna Corp.       1.744.179       0,15         3.633 Cincinnati Financial Corp.       413.799       0,04	97	CBRE Group, Inc. "A"	9.270	0,00
4.931       Centene Corp.       352.123       0,03         5.250       Cerner Corp.       369.863       0,03         676       CF Industries Holdings, Inc.       40.959       0,00         2.638       Charles River Laboratories International, Inc.       965.165       0,08         123       Charles Schwab Corp.       9.519       0,00         246       Charler Communications, Inc. "A"       158.985       0,01         2.722       Chemed Corp.       1.267.064       0,11         22.751       Chevron Corp.       2.567.905       0,22         279       Chipotle Mexican Grill, Inc.       458.511       0,04         721       Church & Dwight Co., Inc.       64.443       0,01         9.089       Cigna Corp.       1.744.179       0,15         3.633       Cincinnati Financial Corp.       413.799       0,04	2.899	CDW Corp.	548.955	0,05
5.250       Cerner Corp.       369.863       0,03         676       CF Industries Holdings, Inc.       40.959       0,00         2.638       Charles River Laboratories International, Inc.       965.165       0,08         123       Charles Schwab Corp.       9.519       0,00         246       Charler Communications, Inc. "A"       158.985       0,01         2.722       Chemed Corp.       1.267.064       0,11         22.751       Chevron Corp.       2.567.905       0,22         279       Chipotle Mexican Grill, Inc.       458.511       0,04         721       Church & Dwight Co., Inc.       64.443       0,01         9.089       Cigna Corp.       1.744.179       0,15         3.633       Cincinnati Financial Corp.       413.799       0,04		·		
676       CF Industries Holdings, Inc.       40.959       0,00         2.638       Charles River Laboratories International, Inc.       965.165       0,08         123       Charles Schwab Corp.       9.519       0,00         246       Charter Communications, Inc. "A"       156.985       0,01         2.722       Chemed Corp.       1.267.064       0,11         22.751       Chevron Corp.       2.567.905       0,22         279       Chipotle Mexican Grill, Inc.       458.511       0,04         721       Church & Dwight Co., Inc.       64.443       0,01         9.089       Cigna Corp.       1.744.179       0,15         3.633       Cincinnati Financial Corp.       413.799       0,04		·		
2.638       Charles River Laboratories International, Inc.       965.165       0,08         123       Charles Schwab Corp.       9.519       0,00         246       Charter Communications, Inc. "A"       158.985       0,01         2.722       Chemed Corp.       1.267.064       0,11         22.751       Chevron Corp.       2.567.905       0,22         279       Chipotle Mexican Grill, Inc.       458.511       0,04         721       Church & Dwight Co., Inc.       64.443       0,01         9.089       Cigna Corp.       1.744.179       0,15         3.633       Cincinnati Financial Corp.       413.799       0,04		·		
123       Charles Schwab Corp.       9.519       0,00         246       Charter Communications, Inc. "A"       158.985       0,01         2.722       Chemed Corp.       1.267.064       0,11         22.751       Chevron Corp.       2.567.905       0,22         279       Chipotle Mexican Grill, Inc.       458.511       0,04         721       Church & Dwight Co., Inc.       64.443       0,01         9.089       Cigna Corp.       1.744.179       0,15         3.633       Cincinnati Financial Corp.       413.799       0,04				
246       Charter Communications, Inc. "A"       158.985       0,01         2.722       Chemed Corp.       1.267.064       0,11         22.751       Chevron Corp.       2.567.905       0,22         279       Chipotle Mexican Grill, Inc.       458.511       0,04         721       Church & Dwight Co., Inc.       64.443       0,01         9.089       Cigna Corp.       1.744.179       0,15         3.633       Cincinnati Financial Corp.       413.799       0,04				
2.722 Chemed Corp.       1.267.064       0,11         22.751 Chevron Corp.       2.567.905       0,22         279 Chipotle Mexican Grill, Inc.       458.511       0,04         721 Church & Dwight Co., Inc.       64.443       0,01         9.089 Gipa Corp.       1.744.179       0,15         3.633 Cincinnati Financial Corp.       413.799       0,04				
22.751 Chevron Corp.       2.567.905       0,22         279 Chipotle Mexican Grill, Inc.       458.511       0,04         721 Church & Dwight Co., Inc.       64.443       0,01         9.089 Cigna Corp.       1.744.179       0,15         3.633 Cincinnati Financial Corp.       413.799       0,04				
279 Chipotle Mexican Grill, Inc.       458.511       0,04         721 Church & Dwight Co., Inc.       64.443       0,01         9.089 Cigna Corp.       1.744.179       0,15         3.633 Cincinnati Financial Corp.       413.799       0,04		·		
9.089 Cigna Corp.       1.744.179       0,15         3.633 Cincinnati Financial Corp.       413.799       0,04		·		
3.633 Cincinnati Financial Corp. 413.799 0,04	721	Church & Dwight Co., Inc.	64.443	0,01
•				
973 Cintas Corp. 410.791 0,03		•		
	973	Unitas Corp.	410.791	0,03

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ord	inarias – (continuación)		
	s – (continuación)		
76.166	Cisco Systems, Inc.	4.176.943	0,35
	Citigroup, Inc.	345.318	0,03
	Citizens Financial Group, Inc.	115.386	0,01
	Citrix Systems, Inc. Clean Harbors, Inc.	340.299 993.402	0,03 0,08
	Clorox Co.	329.608	0,03
	Coca-Cola Co.	3.202.335	0,27
9.424	Cognizant Technology Solutions Corp. "A"	734.884	0,06
57.292	Comcast Corp. "A"	2.863.454	0,24
	Comerica, Inc.	289.020	0,02
	Conagra Brands, Inc.	98.402	0,01
	ConocoPhillips Concolidated Edison, Inc.	1.733.543 127.407	0,15
	Consolidated Edison, Inc. Constellation Brands, Inc. "A"	97.568	0,01 0,01
	Copart, Inc.	357.819	0,03
	Corning, Inc.	294.161	0,03
9.494	Corteva, Inc.	427.230	0,04
2.404	Costco Wholesale Corp.	1.296.670	0,11
	Crown Holdings, Inc.	1.114.709	0,09
	Cummins, Inc.	513.048	0,04
	CVS Health Corp. Danaher Corp.	1.153.416 7.719	0,10 0,00
	Darden Restaurants, Inc.	349.014	0,03
	DaVita. Inc.	207.050	0,02
660	Deere & Co.	228.056	0,02
30.685	Dell Technologies, Inc. "C"	1.732.782	0,15
9.465	Delta Air Lines, Inc.	342.633	0,03
	Dentsply Sirona, Inc.	321.002	0,03
	Devon Energy Corp.	11.609	0,00
	Dexcom, Inc. Diamondback Energy, Inc.	2.813 1.242.657	0,00 0,11
	Discover Financial Services	443.587	0,11
	Discovery, Inc. "C"	371.331	0,04
	Diversified Energy Co., Plc.	552	0,00
373	Dollar General Corp.	82.545	0,01
	Dollar Tree, Inc.	614.547	0,05
	Domino's Pizza, Inc.	362.181	0,03
	Dover Corp.	37.686	0,00
	Dow, Inc. DR Horton, Inc.	113.101 79.332	0,01 0,01
	DTE Energy Co.	361.856	0,01
	Duke Energy Corp.	120.486	0,01
	Duke Realty Corp.	7.758	0,00
	DuPont de Nemours, Inc.	471.347	0,04
5.421	DXC Technology Co.	162.576	0,01
	Eastman Chemical Co.	69.666	0,01
	Eaton Corp., Plc.	493.797	0,04
	eBay, Inc.	121.765	0,01
	Ecolab, Inc. Edison International	493.214 469.037	0,04 0,04
	Edwards Lifesciences Corp.	1.553.420	0,13
	Elanco Animal Health, Inc.	1.044.383	0,09
	Electronic Arts, Inc.	385.330	0,03
58	Eli Lilly & Co.	14.386	0,00
	Emerson Electric Co.	541.534	0,05
	Entergy Corp.	64.017	0,01
	EOG Resources, Inc.	9.048	0,00
	Equifax, Inc. Equinix, Inc.	4.180 2.357.817	0,00 0,20
	Equity, rite.	5.801	0,20
	Etsy, Inc.	5.217	0,00
	Evergy, Inc.	68.364	0,01
	Exelon Corp.	166.310	0,01
	Expedia Group, Inc.	99.393	0,01
	Expeditors International of Washington, Inc.	851	0,00
	Extra Space Storage, Inc.	11.400	0,00
	Exxon Mobil Corp.	1.777.607	0,15
	F5, Inc. Fastenal Co.	489.752 409.811	0,04 0,03
	FedEx Corp.	237.972	0,03
	•	_56.2	-,

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ord	inarias – (continuación)		
	s – (continuación)		
	Fidelity National Financial, Inc.	1.251.313	0,11
	Fidelity National Information Services, Inc.	400.235	0,03
	Fifth Third Bancorp First American Financial Corp.	52.266 1.358.681	0,00 0,12
	First Republic Bank	1.491.312	0,12
	Fisery, Inc.	364.073	0,03
	FleetCor Technologies, Inc.	203.195	0,02
	Ford Motor Co.	1.116.570	0,09
	Fortinet, Inc. Fortive Corp.	487.870 372.526	0,04 0,03
	Fortune Brands Home & Security, Inc.	94.398	0,03
	Fox Corp. "A"	273.253	0,02
7.875	Fox Corp. "B"	264.600	0,02
	Franklin Resources, Inc.	90.947	0,01
	Freeport-McMoRan, Inc.	104.158	0,01
	Gap, Inc. Gartner, Inc.	258.860 479.616	0,02 0,04
	Generac Holdings, Inc.	384.171	0,03
	General Dynamics Corp.	206.166	0,02
23.661	General Electric Co.	2.247.558	0,19
	General Mills, Inc.	108.901	0,01
	General Motors Co. Genuine Parts Co.	2.676.487 411.706	0,23 0,04
	Glead Sciences, Inc.	872.654	0,04
	Global Payments, Inc.	381.166	0,03
	Globe Life, Inc.	112.156	0,01
	Halliburton Co.	365.886	0,03
	Hanesbrands, Inc.	128.150	0,01
	Hartford Financial Services Group, Inc.	167.233	0,01
	Hasbro, Inc. HCA Healthcare, Inc.	349.070 1.752.834	0,03 0,15
	Henry Schein, Inc.	221.139	0,13
	Hershey Co.	53.779	0,00
	Hess Corp.	7.377	0,00
	Hewlett Packard Enterprise Co.	413.653	0,04
	Hologic, Inc. Home Depot, Inc.	1.480.177 3.656.768	0,13 0,31
	Honeywell International, Inc.	803.904	0,07
	Hormel Foods Corp.	21.528	0,00
12.535	HP, Inc.	442.235	0,04
	Humana, Inc.	521.700	0,04
	Huntington Ingalls Industries, Inc.	197.569 423.825	0,02
	IDEXX Laboratories, Inc. Illumina, Inc.	1.831.399	0,04 0,16
	Incyte Corp.	257.742	0,02
	Ingersoll Rand, Inc.	99.236	0,01
	Insulet Corp.	941.468	0,08
	Intel Corp.	1.755.505	0,15
	Intercontinental Exchange, Inc. International Business Machines Corp.	3.529 1.208.004	0,00 0,10
	International Paper Co.	122.358	0,10
	Interpublic Group of Cos., Inc.	484.043	0,04
	Intuit, Inc.	3.057.330	0,26
	Invesco Ltd.	167.564	0,01
	IPG Photonics Corp. IQVIA Holdings, Inc.	197.521 1.890.094	0,02
	Iron Mountain, Inc.	10.633	0,16 0,00
	Jack Henry & Associates, Inc.	234.420	0,02
10.184	Jacobs Engineering Group, Inc.	1.451.831	0,12
	JM Smucker Co.	131.908	0,01
	Johnson & Johnson	4.918.344	0,42
	Johnson Controls International Plc. JP Morgan Chase & Co.	1.759.701 6.001.233	0,15 0,51
	Juniper Networks, Inc.	533.537	0,05
	Kellogg Co.	320.767	0,03
	KeyCorp	411.931	0,04
	Keysight Technologies, Inc.	467.724	0,04
	Kimco Realty Corp.	266.394 137.640	0,02
	Kinder Morgan, Inc. KKR & Co., Inc.	137.640 1.452.892	0,01 0,12
		702.002	٥,

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ordi	narias – (continuación)		
	s – (continuación)	440.050	0.04
	Kraft Heinz Co. Kroger Co.	112.358 148.428	0,01 0,01
	KyndrylHoldings, Inc.	18.644	0,00
	Laboratory Corp. of America Holdings	293.605	0,03
	Lamb Weston Holdings, Inc.	200.204	0,02
	Leggett & Platt, Inc.	30.535	0,00
	Leidos Holdings, Inc. Lennar Corp. "A"	141.008 1.491.290	0,01 0,13
	Liberty Broadband Corp. "C"	1.487.334	0,13
	Lincoln National Corp.	205.358	0,02
	Live Nation Entertainment, Inc.	1.004.963	0,09
	LKQ Corp.	430.486	0,04
	Loews Corp. Lowe's Cos., Inc.	210.098 202.765	0,02 0,02
	Lumen Technologies, Inc.	408.898	0,03
1.392	LyondellBasell Industries NV "A"	121.285	0,01
	M&T Bank Corp.	67.441	0,01
	Madison Square Garden Sports Corp.	1.027.246	0,09
	Marathon Oil Corp.  Marathon Petroleum Corp.	195.918 451.385	0,02 0,04
	Markel Corp.	1.549.682	0,13
	MarketAxess Holdings, Inc.	203.149	0,02
	Marsh & McLennan Cos., Inc.	644.599	0,05
	Masco Corp.	76.708	0,01
	Masimo Corp.  Mastercard, Inc. "A"	1.116.096 4.446.985	0,09 0,38
	McDonald's Corp.	1.012.155	0,09
	McKesson Corp.	204.621	0,02
	Merck & Co., Inc.	1.051.736	0,09
	Meta Platforms, Inc. "A"	9.694.540	0,82
	MetLife, Inc. Mettler-Toledo International, Inc.	255.875 1.813.928	0,02 0,15
	MGM Resorts International	1.618.624	0,13
	Microchip Technology, Inc.	118.637	0,01
4.528	Micron Technology, Inc.	380.352	0,03
	Microsoft Corp.	6.635.602	0,56
	Mid-America Apartment Communities, Inc.  Mohawk Industries, Inc.	11.138 175.424	0,00 0,02
	Molina Healthcare, Inc.	915.713	0,02
	Molson Coors Beverage Co. "B"	151.585	0,01
2.476	Mondelez International, Inc. "A"	145.935	0,01
	Monolithic Power Systems, Inc.	373.585	0,03
	Monster Beverage Corp. Moody's Corp.	429.289 532.833	0,04 0,05
	Morgan Stanley	2.145.871	0,03
	Mosaic Co.	1.737.349	0,15
1.617	Motorola Solutions, Inc.	409.392	0,03
	MSCI, Inc.	9.442	0,00
	Nasdaq, Inc.	10.974 520.837	0,00
	NetApp, Inc. Netflix, Inc.	1.598.973	0,04 0,14
	Newell Brands, Inc.	139.147	0,01
	Newmont Corp.	52.284	0,00
	News Corp. "A"	412.229	0,04
	News Corp. "B"	175.977	0,02
	Nexstar Media Group, Inc. "A"  NextEra Energy, Inc.	1.231.431 1.948.558	0,10 0,17
	Nielsen Holdings Plc.	173.417	0,01
	NiSource, Inc.	21.740	0,00
	NortonLifeLock, Inc.	368.923	0,03
	NOV, Inc.	214.036	0,02
	NRG Energy, Inc. Nucor Corp.	126.466 124.856	0,01 0,01
	NVIDIA Corp.	5.483.360	0,01
	NVR, Inc.	146.310	0,01
8.365	Occidental Petroleum Corp.	248.022	0,02
	Old Dominion Freight Line, Inc.	474.507	0,04
	Omnicom Group, Inc.	343.416	0,03
	ONEOK, Inc. Oracle Corp.	10.592 3.592.124	0,00 0,30
55.557	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	0.002.124	0,00

Tenencias	Descripción del valor	Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones ord	inarias – (continuación)		
Estados Unido	s – (continuación)		
	O'Reilly Automotive, Inc.	567.962	0,05
	Parker-Hannifin Corp.	566.967	0,05
	Paychex, Inc. Penn National Gaming, Inc.	1.788 148.157	0,00 0,01
	PepsiCo, Inc.	3.087.589	0,26
	PerkinElmer, Inc.	64.667	0,01
	Pfizer, Inc.	3.518.240	0,30
	Philip Morris International, Inc.	1.838.514	0,16
	Phillips 66	173.202	0,01
	Pinnacle West Capital Corp. Pioneer Natural Resources Co.	91.135 9.986	0,01 0,00
	Plug Power, Inc.	2.074.989	0,00
	PNC Financial Services Group, Inc.	10.244	0,00
	PPG Industries, Inc.	408.242	0,03
1.670	PPL Corp.	46.476	0,00
	Principal Financial Group, Inc.	152.933	0,01
	Procter & Gamble Co.	2.816.563	0,24
	Progressive Corp. Prologis, Inc.	606.433 8.894	0,05 0,00
	Prudential Financial, Inc.	277.534	0,00
	Public Storage	11.458	0,00
	PulteGroup, Inc.	165.399	0,01
97	PureTech Health Plc.	375	0,00
	PVH Corp.	156.539	0,01
	Qorvo, Inc.	317.758	0,03
	Quanta Services, Inc.	910 575.392	0,00
	Quest Diagnostics, Inc. Ralph Lauren Corp.	379.103	0,05 0,03
	Raymond James Financial, Inc.	9.927	0,00
	Regency Centers Corp.	230.139	0,02
	Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	173.773	0,01
18.700	Regions Financial Corp.	425.425	0,04
	Republic Services, Inc.	1.279.351	0,11
	Robert Half International, Inc.	274.145	0,02
	Rockwell Automation, Inc. Rollins, Inc.	426.302 228.634	0,04 0,02
	Ross Stores, Inc.	130.035	0,02
	S&P Global, Inc.	2.736.659	0,23
	SBA Communications Corp.	406.028	0,03
165	Schlumberger NV	4.732	0,00
	Seagate Technology Holdings Plc.	197.948	0,02
	Sealed Air Corp.	255.934	0,02
	Sempra Energy Sherwin-Williams Co.	46.629 2.270.319	0,00
	Simon Property Group, Inc.	1.715.018	0,19 0,15
	Skyworks Solutions, Inc.	149.385	0,13
	Snap-on, Inc.	147.226	0,01
	Southern Co.	1.100.778	0,09
	Southwest Airlines Co.	150.072	0,01
	Spectrum Brands Holdings, Inc.	751.150	0,06
	Stanley Black & Decker, Inc.	455.599	0,04
	Starbucks Corp. State Street Corp.	817.147 49.912	0,07 0,00
	SVB Financial Group	501.939	0,04
	Synchrony Financial	467.608	0,04
4.194	Synopsys, Inc.	1.430.154	0,12
4.863	Sysco Corp.	340.605	0,03
	T Rowe Price Group, Inc.	395.101	0,03
	Take-Two Interactive Software, Inc.	353.490 403.765	0,03
	Tagestry, Inc. Target Corp.	402.765 1.058.022	0,03 0,09
	Teledyne Technologies, Inc.	250.005	0,09
	Teradyne, Inc.	104.257	0,01
	Tesla, Inc.	5.497.138	0,47
	Texas Instruments, Inc.	3.113.701	0,26
	TJX Cos., Inc.	1.771.643	0,15
	Tractor Supply Co.	1.449.773	0,12
	Trade Desk, Inc. "A" Travelers Cos., Inc.	1.976.046 196.913	0,17 0,02
	Trimble, Inc.	433.729	0,02
0.001		.50.725	0,0 .

Tenencias	Descripción del valor			Valor	de mercado en USD	% del patrimonio
Acciones or	dinarias – (continuación)					
	os – (continuación)				474.004	0.04
	6 Tyson Foods, Inc. "A" 9 UDR, Inc.				474.234 6.184	0,04 0,00
	Ulta Beauty, Inc.				406.987	0,03
	Under Armour, Inc. "A"				367.862	0,03
	3 Under Armour, Inc. "C"				87.365	0,01
	United Parcel Service, Inc. "B"				934.124	0,08
	B United Rentals, Inc. D UnitedHealth Group, Inc.				1.005.380 4.113.477	0,09 0,35
	5 US Bancorp				568.618	0,05
	3 Valero Energy Corp.				377.274	0,03
1.552	2 VeriSign, Inc.				372.340	0,03
	3 Verisk Analytics, Inc.				411.062	0,03
	Verizon Communications, Inc.				1.492.365	0,13
	Vertex Pharmaceuticals, Inc. VF Corp.				449.965 323.789	0,04 0,03
	2 Viatris, Inc.				321.808	0,03
	3 Visa, Inc. "A"				3.698.682	0,31
3.45	Walgreens Boots Alliance, Inc.				154.605	0,01
	3 Walmart, Inc.				330.199	0,03
	6 Walt Disney Co.				2.651.090	0,22
	Waste Management, Inc.     Waters Corp.				9.319 273.610	0,00 0,02
	Wells Fargo & Co.				3.251.811	0,02
	West Pharmaceutical Services, Inc.				5.755	0,00
7.530	Western Digital Corp.				435.535	0,04
	Western Union Co.				318.536	0,03
	5 Westinghouse Air Brake Technologies Corp.				173.545	0,01
	Westrock Co.     Weyerhaeuser Co.				121.015 335.444	0,01 0,03
	Whirlpool Corp.				177.240	0,03
	Williams Cos., Inc.				1.295.457	0,11
	Williams-Sonoma, Inc.				1.104.353	0,09
	WR Berkley Corp.				52.039	0,00
	3 WW Grainger, Inc.				350.466	0,03
	Xylem, Inc.     Yum! Brands, Inc.				282.065 402.301	0,02 0,03
	S Zebra Technologies Corp. "A"				1.828.751	0,03
	2 Zimmer Biomet Holdings, Inc.				56.451	0,00
	) Zions Bancorp NA				305.307	0,03
7.637	Zoetis, Inc.				1.695.719	0,14
					353.557.048	29,93
TOTAL DE AC	CIONES ORDINARIAS 07.585.980)				416.347.933	35,24
	nversión – 5,89 %					
Irlanda	I Scharge Developed Maylete Dranact World HOLTO ETE				0.040.047	0.00
	I iShares Developed Markets Property Yield UCITS ETF B iShares Fallen Angels High Yield Corp. Bond UCITS ETF				2.349.217 7.564.316	0,20 0,64
	I iShares J.P. Morgan USD Emerging Markets Bond UCITS ETF				2.403.883	0,04
	iShares USD Corp. Bond UCITS ETF				26.005.267	2,20
	SPDR Refinitiv Global Convertible Bond UCITS ETF				31.197.205	2,64
					69.519.888	5,89
TOTAL DE FO	NDOS DE INVERSIÓN 0.181.243)				69.519.888	5,89
TOTAL DE VA	LORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE	VALORES OFICIAL			03.313.000	
(coste USD 9	77.094.189)				985.239.065	83,40
Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% del
	iliarios negociados en otro mercado regulado					
Bonos - 3,29						
Estados Unid			0.000.07	10/10/005	4 000 0==	0.10
	) Federal Farm Credit Banks Funding Corp. <sup>(c)</sup> ) Federal Farm Credit Banks Funding Corp. <sup>(c)</sup>	USD USD	0,290 % 0,290 %	13/12/2021 13/12/2021	1.200.072 1.400.084	0,10 0,12
	Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (c)  Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (c)	USD	0,290 %	31/01/2022	599.988	0,12
	Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (c)	USD	0,380 %	07/02/2022	300.150	0,03
	÷ ,					

Tenencias	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor d mercado e USI	n % de
Bonos – (con	<del> </del>					
•	os – (continuación)					
	Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (c)	USD	0,180 %	11/02/2022	500.06	0 0,04
	Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (c)	USD	0,195 %	14/02/2022	1.300.20	
	Federal Farm Credit Banks Funding Corp.(c)	USD	0,196 %	18/04/2022	28.510.54	
	Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (c)	USD	0,140 %	21/11/2022	600.04	
	Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (c) Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (c)	USD	0,085 % 0,150 %	25/11/2022 02/12/2022	199.93 899.87	
	Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (c)	USD	0,080 %	17/02/2023	500.02	
	Federal Farm Credit Banks Funding Corp.(c)	USD	0,105 %	13/04/2023	499.75	
	Federal Farm Credit Banks Funding Corp.(c)	USD	0,085 %	23/10/2023	1.300.05	2 0,1
1.100.000	Federal Home Loan Banks <sup>(c)</sup>	USD	0,170 %	28/02/2022	1.100.27	5 0,0
		_			38.911.06	0 3,2
TOTAL DE BO (coste USD 38					38.911.06	0 3,2
REGULADO	LORES MOBILIARIOS NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO					
(coste USD 38					38.911.06	0 3,29
(coste USD 1.0	RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS 015.994.030)				1.024.150.12	5 86,69
Contratos de	futuros – (0,42 %)			Compromiso Valor de mercado	Plusvalía	
Número de contratos	Descripción del valor			en USD	latente USD %	del patrimonio
27	CAD Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021	L	_arga	5.245.089	54.177	0,00
	EUR					
1	Futuros sobre Euro BTP Bonos del Estado de Italia 08/12/2021	L	_arga	170.742	1.283	0,0
6	Futuros sobre OAT en euros 08/12/2021	L	₋arga	1.136.361	9.759	0,0
	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años 08/12/2021	L	₋arga	8.341.395	37.966	0,0
	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/2021		₋arga	2.705.875	77.117	0,0
29	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5 años 08/12/2021	L	_arga	4.421.413	560	0,0
	GBP			16.775.786	126.685	0,0
(308)	Futuros en libras esterlinas a 90 días 20/12/2023	(	Corta	(50.240.224)	4.409	0,0
, ,	Futuros sobre el FTSE 100 Index 17/12/2021		_arga	21.823.193	59.502	0,0
			•	(28.417.031)	63.911	0,0
	HKD					
(27)	Futuros sobre el Hang Seng Index 30/12/2021	(	Corta	(4.065.144)	163.873	0,0
(54)	Futuros sobre el HSCEI Index 30/12/2021	(	Corta	(2.905.430)	121.328	0,0
				(6.970.574)	285.201	0,0
	JPY					
1	Futuros sobre bonos del Estado de Japón a 10 años 13/12/2021 USD	L	_arga	1.338.148	2.378	0,00
(252)	Futuros en eurodólares a 90 días 13/06/2022	(	Corta	(62.707.050)	8.699	0,0
, ,	Futuros en eurodólares a 90 días 13/03/2023		Corta	(157.920.862)	83.333	0,0
, ,	Futuros en eurodólares a 90 días 18/12/2023		Corta	(122.053.200)	35.254	0,00
	Futuros sobre el E-Mini NASDAQ 100 Index 17/12/2021		∟arga	9.367.290	416.954	0,04
3	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/03/2022	L	∟arga	486.375	11.063	0,00
				(332.827.447)	555.303	0,0
PLUSVALIA LA	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS				1.087.655	0,09
Número de contratos	Descripción del valor			Compromiso Valor de mercado en USD	Minusvalía latente USD	% de patrimonio
	AUD					
(123)	Futuros sobre letras bancarias a 90 días 08/09/2022	(	Corta	(87.060.720)	(33.989)	(0,00
, ,	F					
. ,	Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2021	(	Corta	(4.445.779)	(37.088)	(0,01

Número de	futuros – (continuación)			Compromiso Valor de mercado en	Minusvalía latente	% de
contratos	Descripción del valor			USD	USD	patrimonio
(204)	CAD	1022	Conto	(E0 603 603)	(20.540)	(0.00
, ,	<ul> <li>Futuros sobre letras de aceptación del Banco de Canadá 19/09/2</li> <li>Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/202:</li> </ul>		Corta Corta	(50.603.602) (4.393.514)	(29.519) (80.137)	(0,00) (0,01)
(12)	Trada de ser la companya de la compa	_	Corta	(54.997.116)	(109.656)	(0,01
	EUR					
(185)	Futuros sobre el EURIBOR a 3 meses 13/03/2023		Corta	(52.199.563)	(39.581)	(0,00
(205)	Futuros sobre el EURIBOR a 3 meses 18/12/2023		Corta	(57.738.923)	(42.101)	(0,00
	Futuros sobre el Amsterdam Index 17/12/2021		Larga	3.149.096	(200.106)	(0,02
	Futuros sobre el CAC 40 Index 17/12/2021		Larga	4.157.742	(263.970)	(0,02
	Futuros sobre el DAX Index 17/12/2021		Larga	8.096.357	(389.842)	(0,03)
	Futuros sobre el E-mini FTSE MIB Index 17/12/2021 Futuros sobre el Euro STOXX 50 Index 17/12/2021		Larga	3.485.128	(56.008)	(0,01)
	Futuros sobre el Euro STOAX 50 index 17/12/2021 Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 2 añ	ine 08/12/2021	Larga Larga	54.196.935 15.181.418	(911.666) (1.881)	(0,08) (0,00)
	Futuros sobre el IBEX 35 Index 17/12/2021	105 00/12/2021	Larga	1.219.410	(94.386)	(0,00)
				(20.452.400)	(1.999.541)	(0,17
	GBP			/	(==)	
, ,	Futuros en libras esterlinas a 90 días 15/06/2022		Corta	(45.555.878)	(55.822)	(0,01)
` ,	) Futuros en libras esterlinas a 90 días 15/03/2023 ) Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 29/0	02/2022	Corta Corta	(51.263.068)	(30.426) (32.851)	(0,00)
(13)	Futuros sobre borios dei Estado británico (giits) a largo piazo 29/0	03/2022	Corta	(2.508.209)		(0,00)
	JPY			(99.327.155)	(119.099)	(0,01)
51	Futuros sobre el TOPIX Index 09/12/2021		Larga	8.516.095	(689.214)	(0,06)
	KRW					
3	3 Futuros sobre el KOSPI 200 Index 09/12/2021		Larga	235.721	(5.649)	(0,00)
110	SEK  Futuros sobre el OMX Stockholm 30 Index 17/12/2021		Lorgo	2.941.331	(106 211)	(0.01)
	THB		Larga	2.941.331	(186.211)	(0,01)
437	Futuros sobre el SET50 Index 29/12/2021		Larga	2.410.292	(134.800)	(0,01)
	USD					
. ,	Futuros sobre el CBOE Volatility Index 22/12/2021		Corta	(488.044)	(75.881)	(0,01)
, ,	Futures sobre el CBOE Volatility Index 19/01/2022		Corta	(529.554)	(80.154)	(0,01)
. ,	Futures cobre el CBOE Volatility Index 16/02/2022		Corta Corta	(533.426)	(67.076)	(0,00)
, ,	Futuros sobre el E-Mini S&P 500 Index 17/12/2021 Futuros sobre el E-Mini S&P MidCap 400 Index 17/12/2021		Larga	(88.356.937) 3.247.440	(1.764.053) (100.872)	(0,15) (0,01)
	Futuros sobre el Mini-Russell 2000 Index 17/12/2021		Larga	6.152.440	(237.317)	(0,01)
	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03/20	022	Corta	(19.486.406)	(238.396)	(0,02)
, ,	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 2 años 31/03/202		Corta	(26.017.305)	(43.722)	(0,00)
	) Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/202		Corta	(18.447.813)	(142.204)	(0,01)
				(144.459.605)	(2.749.675)	(0,23)
MINUSVALÍA I	LATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS				(6.064.922)	(0,51)
Contratos de	e divisas a plazo – 0,02 %					
<b>D</b>				Fecha de	Plusvalía latente	% del
Divisa	Compra Divisa	Venta		vencimiento	USD	patrimonio
JPY USD		020.406 700.000		23/12/2021 23/12/2021	13.575 144.593	0,00 0,02
USD		880.000		23/12/2021	17.290	0,02
USD		670.000		23/12/2021	16.077	0,00
USD		500.000		23/12/2021	300.295	0,02
USD		160.000		23/12/2021	430.316	0,04
USD	3.565.562 SEK 31.8	800.000		23/12/2021	58.149	0,01
USD		200.000		23/12/2021	30.847	0,00
PHP		955.430		29/12/2021	17.249	0,00
USD		030.000		29/12/2021	28.587	0,00
PLUSVALIA L	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO				1.056.978	0,09
		v		Fecha	Minusvalía latente	% del
Divisa	Compra Divisa	Venta		de vencimiento	USD	patrimonio
PHP	436.690.000 USD 8.3	700.353		01/12/2021	(33.290)	(0,00)

### Goldman Sachs Funds—Absolute Return Tracker Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

	•	Distan			Fecha	Minusvalía latente	%
visa	Compra	Divisa	Venta		de vencimiento	USD	patrimo
SD	8.579.376		436.690.000		01/12/2021	(87.688)	(0,
AD.	4.270.000		3.381.155		23/12/2021	(51.637)	(0,
S	39.950.000	USD	12.916.004		23/12/2021	(223.866)	(0,
ZD	1.960.000	USD	1.374.270		23/12/2021	(44.294)	(0,
SD	20.268.245	CHF	18.750.000		23/12/2021	(11.902)	(0,
SD	8.760.226	HUF	2.850.080.000		23/12/2021	(17.577)	(0,
SD	35.161.867	JPY	4.004.560.000		23/12/2021	(121.342)	(0,
SD	9.963.170	PLN	41.320.000		23/12/2021	(13.864)	(0,
R	155.487.240.000	USD	10.837.999		29/12/2021	(16.980)	(0
R	724.130.000	USD	9.690.469		29/12/2021	(79.204)	(0
JB	315.880.000		4.268.055		29/12/2021	(50.462)	(0
SD	5.026.913		4.204.460.000		29/12/2021	(5.295)	(0
SD	8.721.501		10.396.510.000		29/12/2021	(48.446)	(0
SD							
חפ	3.065.617	טעעו	85.180.000		29/12/2021	(15.057)	(0
NUSVALÍA LA	TENTE SOBRE CONTR	RATOS DE DIV	ISAS A PLAZO			(820.904)	(0
ontratos de di	ivisas a plazo especí	ficos de una	clase de acciones - (0,24 %)			Diversalie	
visa	Compra	Divies	Venta		Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% patrime
	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		,				-
łF	244.362.027		264.009.710		23/12/2021	294.172	
Υ	6.278.386.809	USD	55.125.754		23/12/2021	191.593	
D	5.224.019	CHF	4.828.498		23/12/2021	1.478	
D	728.804	GBP	547.539		23/12/2021	4.080	
D	3.344.653	SEK	30.302.231		23/12/2021	2.438	
D	2.700	SGD	3.699		23/12/2021	3	
USVALÍA LAT	ENTE SOBRE CONTRA	ATOS DE DIVIS	SAS A PLAZO CELEBRADOS CON FIN	ES DE COBERTURA		493.764	
						Minusvalía	
					Fecha de	latente	
risa	Compra	Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	latente USD	
	Compra 1.316		Venta 955				patrin
JD	-	USD			vencimiento	USD	patrim (I
JD JR	1.316	USD USD	955		vencimiento 23/12/2021	(22)	patrim ((
JD JR BP	1.316 402.833.394	USD USD USD	955 455.862.044		23/12/2021 23/12/2021	(22) (2.041.959)	patrim ((
ID IR BP	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636	USD USD USD USD	955 455.862.044 51.019.972		23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249)	patrim (I
ID IR IP K ID	1.316 402.833.394 37.897.841	USD USD USD USD USD	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008		23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021	(22) (2.041.959) (858.260)	patrin ( ( ( (
D R P K D D	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029	USD USD USD USD USD USD JPY	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521	NES DE COBERTURA	23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995)	patrin ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( (
JD JR BP EK GD SD NUSVALÍA LA	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029	USD USD USD USD USD USD JPY	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579	NES DE COBERTURA	23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301)	patrin ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( (
visa  JD  JR  JR  BP  EK  GD  SD  NUSVALÍA LA*  pciones – 0,0	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029	USD USD USD USD USD USD JPY	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579	NES DE COBERTURA	vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)	patrin ( ( (
JD JR BP K K GD GD NUSVALÍA LA	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029	USD USD USD USD USD USD JPY	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579	NES DE COBERTURA	vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia)	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)	patrin ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( ( (
D R R P K K D D D NUSVALÍA LA	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029	USD USD USD USD USD USD JPY	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579	NES DE COBERTURA	vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)	patrin ( ( ( ( (
D R P K D D NUSVALÍA LA'	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029 TENTE SOBRE CONTE 1 %  Descripción del valor Opciones adquiridas	USD USD USD USD USD USD JPY	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579	NES DE COBERTURA	vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia) latente	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)	patrir
D R R P K D D D IUSVALÍA LA Ciones – 0,0	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029  TENTE SOBRE CONTR  1 %  Descripción del valor  Opciones adquiridas USD	USD USD USD USD USD USD JPY	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579 ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI		vencimiento 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 Plusvalia/ (minusvalia) latente USD	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)  Valor de mercado en USD	patrim
D R P C D D D D D D D D D D D D D D D D D D	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029  TENTE SOBRE CONTR  1 %  Descripción del valor  Opciones adquiridas USD  Call CBOE Volatility In	USD USD USD USD USD USD USD USD JPY  ATOS DE DIVI	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579 ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI	Precio de ejercicio 26,00	vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia) latente USD	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)  Valor de mercado en USD	patrin
19.000 20.000	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029  TENTE SOBRE CONTR  1 %  Descripción del valor Opciones adquiridas USD Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In	USD USD USD USD USD USD USD JPY  AATOS DE DIVI	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579  ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI	Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 25,00	vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia) latente USD  17.150 38.393	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)  Valor de mercado en USD	patrin
19.000 20.000 20.000	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029  TENTE SOBRE CONTR  1 %  Descripción del valor  Opciones adquiridas USD Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In	USD USD USD USD USD USD USD JPY  AATOS DE DIVI	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579  ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI  Vence 22/12/2021 Vence 19/01/2022 Vence 16/02/2022	Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 26,00	vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia) latente USD  17.150 38.393 35.000	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)  Valor de mercado en USD  70.300 102.000 104.000	patrin
19.000 20.000	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029  TENTE SOBRE CONTE  1 %  Descripción del valor Opciones adquiridas USD Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Put S&P 500 Index	USD USD USD USD USD USD USD JPY  AATOS DE DIVI	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579  ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI  Vence 22/12/2021 Vence 19/01/2022 Vence 16/02/2022 Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 3.540,00	vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia) latente USD  17.150 38.393 35.000 (1.408)	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)  Valor de mercado en USD  70.300 102.000 104.000 3	patrim
19.000 20.000 20.000	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029  TENTE SOBRE CONTE  1 %  Descripción del valor Opciones adquiridas USD Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Put S&P 500 Index	USD USD USD USD USD USD USD JPY  AATOS DE DIVI	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579  ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI  Vence 22/12/2021 Vence 19/01/2022 Vence 16/02/2022	Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 26,00	vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia) latente USD  17.150 38.393 35.000	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)  Valor de mercado en USD  70.300 102.000 104.000	patrin
P ( D D D D D D D D D D D D D D D D D D	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029  TENTE SOBRE CONTE  1 %  Descripción del valor Opciones adquiridas USD Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Put S&P 500 Index	USD USD USD USD USD USD USD JPY  AATOS DE DIVI	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579  ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI  Vence 22/12/2021 Vence 19/01/2022 Vence 16/02/2022 Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 3.540,00	vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia) latente USD  17.150 38.393 35.000 (1.408)	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)  Valor de mercado en USD  70.300 102.000 104.000 3	patrim
19.000 20.000 100 20.000 20.000 20.000 300	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029  TENTE SOBRE CONTE  1 %  Descripción del valor  Opciones adquiridas USD Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Put S&P 500 Index Put S&P 500 Index	USD USD USD USD USD USD USD JPY  AATOS DE DIVI	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579  ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI  Vence 22/12/2021 Vence 19/01/2022 Vence 16/02/2022 Vence 30/11/2021 Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 3.540,00 Precio de ejercicio 3.650,00	vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia) latente USD  17.150 38.393 35.000 (1.408) (1.995)	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)  Valor de mercado en USD  70.300 102.000 104.000 3 5	patrim
19.000 20.000 20.000 20.000 200 300 400	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029  TENTE SOBRE CONTR  1 %  Descripción del valor  Opciones adquiridas USD  Call CBOE Volatility In CBOE Volatility	USD USD USD USD USD USD USD JPY  AATOS DE DIVI	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579  ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI  Vence 22/12/2021 Vence 19/01/2022 Vence 16/02/2022 Vence 30/11/2021 Vence 30/11/2021 Vence 30/11/2021 Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 3.540,00 Precio de ejercicio 3.650,00 Precio de ejercicio 3.915,00 Precio de ejercicio 4.010,00	Vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia) latente USD  17.150 38.393 35.000 (1.408) (1.995) (2.452) (2.494)	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)  Valor de mercado en USD  70.300 102.000 104.000 3 5 7	patrim
19.000 20.000 20.000 20.000 20.000 400 300	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029  TENTE SOBRE CONTR  1 %  Descripción del valor  Opciones adquiridas USD  Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Put S&P 500 Index	USD USD USD USD USD USD USD JPY  AATOS DE DIVI	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579  ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI  Vence 22/12/2021 Vence 19/01/2022 Vence 16/02/2022 Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 3,540,00 Precio de ejercicio 3,650,00 Precio de ejercicio 3,915,00 Precio de ejercicio 4.010,00 Precio de ejercicio 4.150,00	Vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia) latente USD  17.150 38.393 35.000 (1.408) (1.995) (2.452) (2.494) (1.973)	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)  Valor de mercado en USD  70.300 102.000 104.000 3 5 7 10 8	patrin
PACIONES - 0,0°  RUSVALÍA LA*  Ciones - 0,0°  encias  19.000 20.000 100 200 300 400 300 200	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029  TENTE SOBRE CONTE  1 %  Descripción del valor Opciones adquiridas USD Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Put S&P 500 Index	USD USD USD USD USD USD USD JPY  AATOS DE DIVI	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579  ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI  Vence 22/12/2021 Vence 19/01/2022 Vence 16/02/2022 Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 3.540,00 Precio de ejercicio 3.650,00 Precio de ejercicio 3.915,00 Precio de ejercicio 4.010,00 Precio de ejercicio 4.150,00 Precio de ejercicio 4.235,00	vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia) latente USD  17.150 38.393 35.000 (1.408) (1.995) (2.452) (2.494) (1.973) (259)	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)  Valor de mercado en USD  70.300 102.000 104.000 3 5 7 10 8 5	patrim
D R P C D D D D D D D D D D D D D D D D D D	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029  TENTE SOBRE CONTE  1 %  Descripción del valor Opciones adquiridas USD Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Put S&P 500 Index	USD USD USD USD USD USD USD JPY  AATOS DE DIVI	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579  ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI  Vence 19/01/2022 Vence 16/02/2022 Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 3.540,00 Precio de ejercicio 3.650,00 Precio de ejercicio 3.915,00 Precio de ejercicio 4.010,00 Precio de ejercicio 4.150,00 Precio de ejercicio 4.235,00 Precio de ejercicio 4.420,00	23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia) latente USD  17.150 38.393 35.000 (1.408) (1.995) (2.452) (2.494) (1.973) (259) (565)	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)  Valor de mercado en USD  70.300 102.000 104.000 3 5 7 10 8 5 5	patrin
PACIONES - 0,0°  IUSVALÍA LA*  ciones - 0,0°  encias  19.000 20.000 20.000 400 300 400 300 200 200 200 100	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029  TENTE SOBRE CONTF  1 %  Descripción del valor  Opciones adquiridas USD Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Put S&P 500 Index	USD USD USD USD USD USD USD JPY  AATOS DE DIVI	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579  ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI  Vence 19/01/2022 Vence 16/02/2022 Vence 30/11/2021 Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 3.540,00 Precio de ejercicio 3.915,00 Precio de ejercicio 4.010,00 Precio de ejercicio 4.150,00 Precio de ejercicio 4.235,00 Precio de ejercicio 4.420,00 Precio de ejercicio 3.850,00	vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia) latente USD  17.150 38.393 35.000 (1.408) (1.995) (2.452) (2.494) (1.973) (259) (565) 680	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)  Valor de mercado en USD  70.300 102.000 104.000 3 5 7 10 8 5 5 1.470	patrim
19.000 20.000 20.000 400 300 400 200 200 100 100	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029  TENTE SOBRE CONTF  1 %  Descripción del valor  Opciones adquiridas USD  Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatili	USD USD USD USD USD USD USD JPY  AATOS DE DIVI	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579  ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI  Vence 22/12/2021 Vence 19/01/2022 Vence 16/02/2022 Vence 30/11/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 3.540,00 Precio de ejercicio 3.650,00 Precio de ejercicio 3.915,00 Precio de ejercicio 4.010,00 Precio de ejercicio 4.150,00 Precio de ejercicio 4.235,00 Precio de ejercicio 3.850,00 Precio de ejercicio 3.850,00 Precio de ejercicio 3.905,00	Vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia) latente USD  17.150 38.393 35.000 (1.408) (1.995) (2.452) (2.494) (1.973) (259) (565) 680 915	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)  Valor de mercado en USD  70.300 102.000 104.000 3 5 7 10 8 5 5 1.470 1.665	patrim
19.000 20.000 20.000 20.000 20.000 20.000 20.000 100 300 400 300 200 200 200 300 400 300 300 300 300 300 300 300 3	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029  TENTE SOBRE CONTR  1 %  Descripción del valor  Opciones adquiridas USD  Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Put S&P 500 Index	USD USD USD USD USD USD USD JPY  AATOS DE DIVI	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579  ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI  Vence 22/12/2021 Vence 19/01/2022 Vence 30/11/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 3,540,00 Precio de ejercicio 3,650,00 Precio de ejercicio 3,015,00 Precio de ejercicio 4,010,00 Precio de ejercicio 4,150,00 Precio de ejercicio 4,235,00 Precio de ejercicio 4,20,00 Precio de ejercicio 3,850,00 Precio de ejercicio 3,905,00 Precio de ejercicio 3,005,00 Precio de ejercicio 3,005,00	Vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia) latente USD  17.150 38.393 35.000 (1.408) (1.995) (2.452) (2.494) (1.973) (259) (565) 680 915 3.015	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)  Valor de mercado en USD  70.300 102.000 104.000 3 5 7 10 8 5 1.470 1.665 6.315	patrim
19.000 20.000 100 20.000 20.000 20.000 100 200 200 200 300 400 300 100 100 300 100	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029  TENTE SOBRE CONTF  1 %  Descripción del valor  Opciones adquiridas USD  Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatili	USD USD USD USD USD USD USD JPY  AATOS DE DIVI	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579  ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI  Vence 22/12/2021 Vence 19/01/2022 Vence 16/02/2022 Vence 30/11/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 3.540,00 Precio de ejercicio 3.650,00 Precio de ejercicio 3.915,00 Precio de ejercicio 4.010,00 Precio de ejercicio 4.150,00 Precio de ejercicio 4.235,00 Precio de ejercicio 3.850,00 Precio de ejercicio 3.850,00 Precio de ejercicio 3.905,00	Vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia) latente USD  17.150 38.393 35.000 (1.408) (1.995) (2.452) (2.494) (1.973) (259) (565) 680 915 3.015 2.352	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)  Valor de mercado en USD  70.300 102.000 104.000 3 5 7 10 8 5 1.470 1.665 6.315 4.370	patrin
D R P K D D NUSVALÍA LA:  ciones - 0,0:  encias  19.000 20.000 100 200 400 300 200 100 100 300 200 100 300 200 200 200 200 200 200 200 200 2	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029  TENTE SOBRE CONTR  1 %  Descripción del valor  Opciones adquiridas USD  Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Put S&P 500 Index	USD USD USD USD USD USD USD JPY  AATOS DE DIVI	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579  ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI  Vence 22/12/2021 Vence 19/01/2022 Vence 30/11/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 3,540,00 Precio de ejercicio 3,650,00 Precio de ejercicio 3,015,00 Precio de ejercicio 4,010,00 Precio de ejercicio 4,150,00 Precio de ejercicio 4,235,00 Precio de ejercicio 4,20,00 Precio de ejercicio 3,850,00 Precio de ejercicio 3,905,00 Precio de ejercicio 3,005,00 Precio de ejercicio 3,005,00	Vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia) latente USD  17.150 38.393 35.000 (1.408) (1.995) (2.452) (2.494) (1.973) (259) (565) 680 915 3.015	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)  Valor de mercado en USD  70.300 102.000 104.000 3 5 7 10 8 5 1.470 1.665 6.315	patrin
D R R P K D D NUSVALÍA LA: ciones - 0,0: nencias  19.000 20.000 20.000 400 300 400 200 100 100 300 200 200 100 300 200 200 200 200 200 200 200 200 2	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029  TENTE SOBRE CONTF  1 %  Descripción del valor  Opciones adquiridas USD  Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatili	USD USD USD USD USD USD USD JPY  AATOS DE DIVI	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579  ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI  Vence 22/12/2021 Vence 19/01/2022 Vence 30/11/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 3,540,00 Precio de ejercicio 3,650,00 Precio de ejercicio 3,015,00 Precio de ejercicio 4,010,00 Precio de ejercicio 4,150,00 Precio de ejercicio 4,235,00 Precio de ejercicio 4,20,00 Precio de ejercicio 3,850,00 Precio de ejercicio 3,905,00 Precio de ejercicio 3,005,00	Vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia) latente USD  17.150 38.393 35.000 (1.408) (1.995) (2.452) (2.494) (1.973) (259) (565) 680 915 3.015 2.352	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)  Valor de mercado en USD  70.300 102.000 104.000 3 5 7 10 8 5 1.470 1.665 6.315 4.370	patrin
D R P K D D D NUSVALÍA LA' viciones - 0,0' nencias  19.000 20.000 20.000 400 300 200 100 100 300 200 100 100 300 200 100 100 300 100 100 300 100 100 100 1	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029 TENTE SOBRE CONTF 1 %  Descripción del valor Opciones adquiridas USD Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Put S&P 500 Index	USD USD USD USD USD USD USD JPY  AATOS DE DIVI	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579  ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI  Vence 22/12/2021 Vence 19/01/2022 Vence 30/11/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 3,540,00 Precio de ejercicio 3,650,00 Precio de ejercicio 3,015,00 Precio de ejercicio 4,010,00 Precio de ejercicio 4,150,00 Precio de ejercicio 4,235,00 Precio de ejercicio 4,20,00 Precio de ejercicio 3,850,00 Precio de ejercicio 3,905,00 Precio de ejercicio 3,005,00	Vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia) latente USD  17.150 38.393 35.000 (1.408) (1.995) (2.452) (2.494) (1.973) (259) (565) 680 915 3.015 2.352	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)  Valor de mercado en USD  70.300 102.000 104.000 3 5 7 10 8 5 1.470 1.665 6.315 4.370 290.163	patrim
D R P K D D D VUSVALÍA LA' ciones - 0,0' dencias  19.000 20.000 20.000 300 400 300 200 100 100 200 TAL DE OPCIC ste USD 203.8	1.316 402.833.394 37.897.841 213.169.636 166.646 1.190.029 TENTE SOBRE CONTF 1 %  Descripción del valor Opciones adquiridas USD Call CBOE Volatility In Call CBOE Volatility In Put S&P 500 Index	USD USD USD USD USD USD USD USD JPY  AATOS DE DIVI	955 455.862.044 51.019.972 23.941.008 122.521 135.326.579  ISAS A PLAZO CELEBRADOS CON FI  Vence 22/12/2021 Vence 19/01/2022 Vence 30/11/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021 Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 26,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 25,00 Precio de ejercicio 3,540,00 Precio de ejercicio 3,650,00 Precio de ejercicio 3,015,00 Precio de ejercicio 4,010,00 Precio de ejercicio 4,150,00 Precio de ejercicio 4,235,00 Precio de ejercicio 4,20,00 Precio de ejercicio 3,850,00 Precio de ejercicio 3,905,00 Precio de ejercicio 3,005,00	Vencimiento  23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021 23/12/2021  Plusvalia/ (minusvalia) latente USD  17.150 38.393 35.000 (1.408) (1.995) (2.452) (2.494) (1.973) (259) (565) 680 915 3.015 2.352	(22) (2.041.959) (858.260) (429.249) (995) (2.301) (3.332.786)  Valor de mercado en USD  70.300 102.000 104.000 3 5 7 10 8 5 1.470 1.665 6.315 4.370 290.163	patrim

### Goldman Sachs Funds—Absolute Return Tracker Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

enencias	Descripción del valor			Plusvalia/ (minusvalia) latente USD	Valor de mercado en USD	% de patrimonio
-	Opciones suscritas – (continuación)					-
	USD – (continuación)					
()	Put S&P 500 Index	Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 4.480,00	17.372	(7)	(0,00)
. ,	Put S&P 500 Index	Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 4.545,00	20.104	(10)	(0,00)
. ,	Put S&P 500 Index Put S&P 500 Index	Vence 30/11/2021 Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 4.605,00 Precio de ejercicio 4.660,00	6.187 (13.322)	(10.620) (18.130)	(0,00)
, ,	Put S&P 500 Index	Vence 30/11/2021	Precio de ejercicio 4.685,00	(16.747)	(23.130)	(0,00)
, ,	Put S&P 500 Index	Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 4.590,00	(4.875)	(11.315)	(0,00
( /	Put S&P 500 Index	Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 4.645,00	(6.273)	(13.505)	(0,00
, ,	Put S&P 500 Index	Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 4.650,00	(16.800)	(41.220)	(0,00
, ,	Put S&P 500 Index	Vence 31/12/2021	Precio de ejercicio 4.665,00	(12.950)	(28.900)	(0,00)
(200)	Tat Gail Goo maox	70.100 0 17 12.202 1		(1)	(146.845)	(0,01
OTAL DE OPCIO	NES SUSCRITAS				(146.845)	(0,01
OTAL DE OPCIO	**				(1.10.0.10)	(0,0.
coste USD 56.960					143.318	0,0
ontratos de pe	rmutas financieras – (0,38 %)				Plusvalía	
nporte teórico ocal neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	latente USD	% d
	Permutas de rendimiento total					•
28.522.171	Variable (EURO STOXX Index)	Variable (LIBOR a 1 mes en EUR)	EUR	19/09/2022	1.963.801	0,1
8.952.357	Variable (FTSE 100 Total Return Index)	Variable (SONIA a 1 mes en GBP)	GBP	08/11/2022	454.991	0,0
466.881	Variable (MSCI World Daily Total Return					
	Net Index)	Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	USD	15/02/2022	17.802	0,
29.637.186	S Variable (MSCI World Index)	Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	USD	28/02/2022	1.130.002	0,
5.981.906	S Variable (MSCI World Index)	Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	USD	11/03/2022	228.077	0,0
LUSVALÍA LATE	NTE SOBRE PERMUTAS DE RENDIMIEN	TO TOTAL			3.794.673	0,
OTAL DE BLUSV	ALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE	DEDMITAS EINANCIEDAS			2 704 672	0.3
OTAL DE PLUSV	ALIA LATENTE SOBRE CONTRATOS DE	PERMUTAS FINANCIERAS			3.794.673	0,3
nporte teórico ocal neto					Minusvalía	
	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	latente	
	A pagar  Permutas de incumplimiento	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento		% d patrimon
	A pagar  Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento		
20.500.000	Permutas de incumplimiento	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento		
20.500.000	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)	A recibir Fijo 5,000 %	<b>Divisa</b> EUR	Fecha de vencimiento 20/12/2026		patrimon
	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  Variable (iTraxx Europe Crossover				USD	patrimon
109.750.000	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  1) Variable (Traxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  2) Variable (Traxx Europe Series 36 Version 1)				USD	patrimon
109.750.000	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  1) Variable (iTraxx Europe Series 36 Version 1)  2) Variable (The Markit CDX North America	Fijo 5,000 % Fijo 1,000 %	EUR EUR	20/12/2026 20/12/2026	(574.252) (588.330)	(0,0 (0,0
109.750.000 34.900.000	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  Variable (iTraxx Europe Series 36 Version 1)  Variable (The Markit CDX North America High Yield 37 Version 1 Index)	Fijo 5,000 %	EUR	20/12/2026	USD (574.252)	(0,0 (0,0
109.750.000 34.900.000	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  Variable (iTraxx Europe Series 36 Version 1)  Variable (The Markit CDX North America High Yield 37 Version 1 Index)  Variable (The Markit CDX North America	Fijo 5,000 % Fijo 1,000 % Fijo 5,000 %	EUR EUR USD	20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026	(574.252) (588.330) (535.596)	(0,0 (0,0 (0,0
109.750.000 34.900.000 121.800.000	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  1) Variable (iTraxx Europe Series 36 Version 1)  2) Variable (The Markit CDX North America High Yield 37 Version 1 Index)  2) Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)	Fijo 5,000 % Fijo 1,000 % Fijo 5,000 % Fijo 1,000 %	EUR EUR	20/12/2026 20/12/2026	(574.252) (588.330) (535.596) (326.181)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0
109.750.000 34.900.000 121.800.000	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  1) Variable (iTraxx Europe Series 36 Version 1)  2) Variable (The Markit CDX North America High Yield 37 Version 1 Index)  2) Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)	Fijo 5,000 % Fijo 1,000 % Fijo 5,000 % Fijo 1,000 %	EUR EUR USD	20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026	(574.252) (588.330) (535.596)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0
109.750.000 34.900.000 121.800.000	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  1) Variable (iTraxx Europe Series 36 Version 1)  2) Variable (The Markit CDX North America High Yield 37 Version 1 Index)  2) Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)  ENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLII  Permutas de rendimiento total	Fijo 5,000 % Fijo 1,000 % Fijo 5,000 % Fijo 1,000 % MIENTO CREDITICIO (CDS)	EUR EUR USD	20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026	(574.252) (588.330) (535.596) (326.181)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0
109.750.000 34.900.000 121.800.000	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  1) Variable (iTraxx Europe Series 36 Version 1)  2) Variable (The Markit CDX North America High Yield 37 Version 1 Index)  2) Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)	Fijo 5,000 % Fijo 1,000 % Fijo 5,000 % Fijo 1,000 %  MIENTO CREDITICIO (CDS)  Variable (MSCI Emerging Markets	EUR EUR USD USD	20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026	(574.252) (588.330) (535.596) (326.181) (2.024.359)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
109.750.000 34.900.000 121.800.000 IINUSVALÍA LATI	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  1) Variable (iTraxx Europe Series 36 Version 1)  2) Variable (The Markit CDX North America High Yield 37 Version 1 Index)  2) Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)  ENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLII  Permutas de rendimiento total	Fijo 5,000 % Fijo 1,000 % Fijo 5,000 % Fijo 1,000 % MIENTO CREDITICIO (CDS)	EUR EUR USD USD	20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026	(574.252) (588.330) (535.596) (326.181)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
109.750.000 34.900.000 121.800.000 IINUSVALÍA LATI	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  1) Variable (iTraxx Europe Series 36 Version 1)  1) Variable (The Markit CDX North America High Yield 37 Version 1 Index)  1) Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)  1) Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)  1) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Fijo 5,000 % Fijo 1,000 % Fijo 5,000 % Fijo 1,000 %  MIENTO CREDITICIO (CDS)  Variable (MSCI Emerging Markets Index) Variable (MSCI Emerging Markets Index)	EUR EUR USD USD	20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026	(574.252) (588.330) (535.596) (326.181) (2.024.359)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,1
109.750.000 34.900.000 121.800.000 INUSVALÍA LATI 21.538 12.666	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  1) Variable (iTraxx Europe Series 36 Version 1)  1) Variable (The Markit CDX North America High Yield 37 Version 1 Index)  1) Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)  1) Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)  1) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Fijo 5,000 % Fijo 1,000 % Fijo 5,000 % Fijo 1,000 % MIENTO CREDITICIO (CDS)  Variable (MSCI Emerging Markets Index) Variable (MSCI Emerging Markets	EUR EUR USD USD	20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026	(574.252) (588.330) (535.596) (326.181) (2.024.359)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,1
109.750.000 34.900.000 121.800.000 IINUSVALÍA LATI 21.539 12.666 4.350	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  1) Variable (iTraxx Europe Series 36 Version 1)  2) Variable (The Markit CDX North America High Yield 37 Version 1 Index)  2) Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)  ENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLI  Permutas de rendimiento total  2) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  3) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Fijo 5,000 % Fijo 1,000 % Fijo 5,000 % Fijo 1,000 %  MIENTO CREDITICIO (CDS)  Variable (MSCI Emerging Markets Index)	EUR EUR USD USD	20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 03/12/2021 15/12/2021	(574.252) (588.330) (535.596) (326.181) (2.024.359) (784.997) (461.617)	(0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,1) (0,0) (0,0)
109.750.000 34.900.000 121.800.000 INUSVALÍA LATI 21.539 12.666 4.350	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  1) Variable (iTraxx Europe Series 36 Version 1)  1) Variable (Traxx Europe Series 36 Version 1)  1) Variable (The Markit CDX North America High Yield 37 Version 1 Index)  1) Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)  1) Variable (Tabe Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)  1) Variable (Tabe Permutas DE INCUMPLII)  1) Permutas de rendimiento total  2) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  3) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  3) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Fijo 5,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 %  MIENTO CREDITICIO (CDS)  Variable (MSCI Emerging Markets Index)	EUR EUR USD USD USD USD USD	20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 03/12/2021 15/12/2021 12/01/2022 03/02/2022	(574.252) (588.330) (535.596) (326.181) (2.024.359) (784.997) (461.617) (158.537) (4.082)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
109.750.000 34.900.000 121.800.000 INUSVALÍA LATI 21.539 12.666 4.350 112 3.326	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  1) Variable (iTraxx Europe Series 36 Version 1)  1) Variable (The Markit CDX North America High Yield 37 Version 1 Index)  1) Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)  1) Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)  1) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  2) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  3) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  4) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  5) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  6) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  6) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Fijo 5,000 % Fijo 1,000 % Fijo 5,000 % Fijo 1,000 %  MIENTO CREDITICIO (CDS)  Variable (MSCI Emerging Markets Index)	EUR EUR USD USD USD USD USD USD USD	20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 03/12/2021 15/12/2021 12/01/2022 03/02/2022 13/03/2022	(574.252) (588.330) (535.596) (326.181) (2.024.359) (784.997) (461.617) (158.537) (4.082) (121.217)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
109.750.000 34.900.000 121.800.000 INUSVALÍA LATI 21.539 12.666 4.350 112 3.326	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  1) Variable (The Markit CDX North America High Yield 37 Version 1 Index)  1) Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)  1) Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)  1) Permutas de rendimiento total  1) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  2) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  2) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  3) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  4) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  5) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Fijo 5,000 %  Fijo 1,000 %  Fijo 5,000 %  Fijo 1,000 %  MIENTO CREDITICIO (CDS)  Variable (MSCI Emerging Markets Index)  Variable (JPGSMARB Index)	EUR EUR USD USD USD USD USD	20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 03/12/2021 15/12/2021 12/01/2022 03/02/2022	(574.252) (588.330) (535.596) (326.181) (2.024.359) (784.997) (461.617) (158.537) (4.082)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,1
109.750.000 34.900.000 121.800.000 211.539 12.666 4.350 112 3.326 10.295 28.794	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  2) Variable (The Markit CDX North America High Yield 37 Version 1 Index)  3) Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)  ENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLI  Permutas de rendimiento total  3) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  3) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  4) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  5) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  6) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Fijo 5,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 % Fijo 1,000 %  MIENTO CREDITICIO (CDS)  Variable (MSCI Emerging Markets Index) Variable (JPGSMARB Index) Variable (MSCI Emerging Markets Index) Variable (MSCI Emerging Markets Index)	EUR EUR USD USD USD USD USD USD USD	20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 03/12/2021 15/12/2021 12/01/2022 03/02/2022 13/03/2022 11/08/2022	(574.252) (588.330) (535.596) (326.181) (2.024.359) (784.997) (461.617) (158.537) (4.082) (121.217)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
109.750.000 34.900.000 121.800.000 INUSVALÍA LATI 21.539 12.666 4.350 112 3.326 10.295 28.794	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  2) Variable (The Markit CDX North America High Yield 37 Version 1 Index)  2) Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)  ENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLII  Permutas de rendimiento total  2) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  3) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  2) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  3) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  4) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  5) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  4) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  5) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  6) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Fijo 5,000 %  Fijo 1,000 %  Fijo 5,000 %  Fijo 5,000 %  MIENTO CREDITICIO (CDS)  Variable (MSCI Emerging Markets Index)  Variable (Alerian MLP Total Return Index)	EUR EUR USD	20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 03/12/2021 15/12/2021 12/01/2022 03/02/2022 13/03/2022 11/08/2022	(574.252) (588.330) (535.596) (326.181) (2.024.359) (784.997) (461.617) (158.537) (4.082) (121.217) (125.197)	(0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0) (0,0)
109.750.000 34.900.000 121.800.000 21.539 12.666 4.350 112 3.326 10.295 28.794	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  2) Variable (The Markit CDX North America High Yield 37 Version 1 Index)  3) Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)  ENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLI  Permutas de rendimiento total  3) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  3) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  4) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  5) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  6) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Fijo 5,000 % Fijo 1,000 % Fijo 5,000 % Fijo 1,000 %  MIENTO CREDITICIO (CDS)  Variable (MSCI Emerging Markets Index) Variable (Alerian MLP Total Return	EUR EUR USD	20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 03/12/2021 15/12/2021 12/01/2022 03/02/2022 13/03/2022 11/08/2022 12/08/2022	(574.252) (588.330) (535.596) (326.181) (2.024.359) (784.997) (461.617) (158.537) (4.082) (121.217) (125.197) (1.049.407)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
109.750.000 34.900.000 121.800.000 INUSVALÍA LATI 21.538 12.666 4.350 112 3.326 10.295 28.794 2.006 116.013	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  2) Variable (The Markit CDX North America High Yield 37 Version 1 Index)  2) Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)  ENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLII  Permutas de rendimiento total  2) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  3) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  2) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  3) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  4) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  5) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  4) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  5) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  6) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Fijo 5,000 %  Fijo 1,000 %  Fijo 5,000 %  Fijo 5,000 %  MIENTO CREDITICIO (CDS)  Variable (MSCI Emerging Markets Index)  Variable (JPGSMARB Index)  Variable (Alerian MLP Total Return Index)  Variable (Alerian MLP Total Return Index)  Variable (JP Morgan Bespoke Global	EUR EUR USD	20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 03/12/2021 15/12/2021 12/01/2022 03/02/2022 13/03/2022 11/08/2022 12/08/2022 17/08/2022	(574.252) (588.330) (535.596) (326.181) (2.024.359) (784.997) (461.617) (158.537) (4.082) (121.217) (125.197) (1.049.407) (225.950)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0
109.750.000 34.900.000 121.800.000 121.539 12.666 4.350 112 3.326 10.295 28.794 2.006 116.013	Permutas de incumplimiento crediticio (CDS)  1) Variable (iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1)  1) Variable (iTraxx Europe Series 36 Version 1)  2) Variable (The Markit CDX North America High Yield 37 Version 1 Index)  3) Variable (The Markit CDX North America Investment Grade 37 Version 1 Index)  ENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLII  Permutas de rendimiento total  3) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  3) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  4) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  5) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)  6) Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Fijo 5,000 %  Fijo 1,000 %  Fijo 5,000 %  Fijo 5,000 %  MIENTO CREDITICIO (CDS)  Variable (MSCI Emerging Markets Index) Variable (Alerian MLP Total Return Index) Variable (JP Morgan Bespoke Global Heatthcare Sector Index) Variable (JP Morgan Bespoke Global Heatthcare Sector Index) Variable (JP Morgan Bespoke Global	EUR EUR USD	20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 20/12/2026 03/12/2021 15/12/2021 12/01/2022 03/02/2022 13/03/2022 11/08/2022 12/08/2022 17/08/2022 25/08/2022	(574.252) (588.330) (535.596) (326.181) (2.024.359) (784.997) (461.617) (158.537) (4.082) (121.217) (125.197) (1.049.407) (225.950) (448.971)	(0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0 (0,0

### Goldman Sachs Funds—Absolute Return Tracker Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

#### Contratos de permutas financieras - (continuación)

Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% del patrimonio
	Permutas de rendimiento total – (continuación)					
530	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	Variable (MSCI Daily TR Net Emerging Markets)	USD	26/08/2022	(101.232)	(0,01)
113.571	Variable (SOFR a 1 mes en USD)	Variable (MSCI Emerging Markets Index)	USD	26/08/2022	(2.270.171)	(0,19)
442	Variable (LIBOR a 1 mes en USD)	Variable (IPXUOTR Index)	USD	10/11/2022	(2.270.171)	(0,19)
MINUSVALÍA LATE RENDIMIENTO TO	ENTE SOBRE PERMUTAS DE TAL				(6.322.293)	(0,53)
TOTAL DE MINUS	VALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS NANCIERAS	3			(8.346.652)	(0,70)
VALOR DE MERCA (coste USD 1.016.0	ADO DE LAS INVERSIONES 050.990)				1.012.161.249	85,68
OTROS ACTIVOS	Y PASIVOS				169.191.317	14,32
PATRIMONIO					1.181.352.566	100,00
TOTAL DE INVERS	SIONES				Valor de mercado USD	% del patrimonio
Total inversiones ex	ccluyendo derivados (coste USD 1.015.9	94.030)			1.024.150.125	86,69
Plusvalía latente so	bre contratos de futuros				1.087.655	0,09
Minusvalía latente s	sobre contratos de futuros				(6.064.922)	(0,51)
Plusvalía latente so	bre contratos de divisas a plazo				1.056.978	0,09
	sobre contratos de divisas a plazo				(820.904)	(0,07)
	bre contratos de divisas a plazo celebra				493.764	0,04
	sobre contratos de divisas a plazo celeb				(3.332.786)	(0,28)
	e opciones compradas (coste USD 203	,			290.163	0,02
	e opciones suscritas (coste USD (146.8	44))			(146.845)	(0,01)
	bre contratos de permutas financieras				3.794.673	0,32
	sobre contratos de permutas financieras				(8.346.652)	(0,70)
Otros activos y pasi	ivos				169.191.317	14,32
Patrimonio					1.181.352.566	100,00

El Comisionista de futuros fue Newedge Group.

La contraparte de los contratos de divisas a plazo fue JP Morgan Chase Bank N.A.

La contraparte de los contratos de opciones fue Morgan Stanley & Co. International Plc.

Las contrapartes de los contratos de permutas financieras fueron Credit Suisse, JP Morgan Chase Bank N.A. y Merrill Lynch International.

La exposición máxima a cada contraparte a 30 de noviembre de 2021, medida como porcentaje del VL, es del 0,44 %.

<sup>(</sup>a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.

<sup>(</sup>b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.

 $<sup>^{(</sup>c)}$  Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.

<sup>(</sup>d) 144A: La emisión de este título va destinada a inversores institucionales cualificados, con carácter de emisión privada, y es un valor mobiliario de conformidad con lo establecido en la Norma 144A de la Ley de Valores Estadounidense de 1933.

### Goldman Sachs Funds—Alternative Trend Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés <sup>(a)</sup>	Fecha de vencimiento <sup>(b)</sup>	Valor de mercado en USD	% de
Valores mobili	iarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial					
Bonos - 73,29	%					
Estados Unidos						
	10 Federal Farm Credit Banks Funding Corp.(c)	USD	0,290 %	13/12/2021	400.024	0,0
	00 Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (c)	USD	0,290 %	13/12/2021	500.030	0,1
	00 Federal Farm Credit Banks Funding Corp.(c)	USD USD	0,095 %	31/01/2022	299.994	0,0
	10 Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (c) 10 Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (c)	USD	0,380 % 0,180 %	07/02/2022 11/02/2022	100.050 200.024	0,0
	00 Federal Farm Credit Banks Funding Corp.(c)	USD	0,195 %	14/02/2022	400.064	0,0
	00 Federal Farm Credit Banks Funding Corp.(c)	USD	0,196 %	18/04/2022	11.604.292	2,2
	00 Federal Farm Credit Banks Funding Corp.(c)	USD	0,140 %	21/11/2022	300.021	0,0
	00 Federal Farm Credit Banks Funding Corp.(c)	USD	0,085 %	25/11/2022	99.965	0,0
400.00	00 Federal Farm Credit Banks Funding Corp.(c)	USD	0,150 %	02/12/2022	399.944	0,0
200.00	O Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (c)	USD	0,080 %	17/02/2023	200.010	0,0
300.00	00 Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (c)	USD	0,105 %	13/04/2023	299.853	0,0
600.00	00 Federal Farm Credit Banks Funding Corp. (c)	USD	0,085 %	23/10/2023	600.024	0,1
	00 Federal Home Loan Bank Discount Notes	USD	0,020 %	03/12/2021	24.999.972	4,8
	NO Federal Home Loan Bank Discount Notes	USD	0,041 %	08/12/2021	24.999.903	4,8
	00 Federal Home Loan Bank Discount Notes	USD	0,011 %	10/12/2021	25.999.870	5,0
	00 Federal Home Loan Bank Discount Notes	USD	0,004 %	15/12/2021	27.499.786	5,3
	10 Federal Home Loan Bank Discount Notes	USD	0,003 %	22/12/2021	19.999.767	3,8
	10 Federal Home Loan Bank Discount Notes	USD	0,013 %	21/01/2022	14.999.363	2,9
	10 Federal Home Loan Bank Discount Notes	USD	0,021 %	16/02/2022	19.998.289 69.993.468	3,8
	10 Federal Home Loan Bank Discount Notes 10 Federal Home Loan Bank Discount Notes	USD USD	0,020 % 0,054 %	23/02/2022 25/02/2022	54.494.794	13,5 10,5
	0 Federal Home Loan Banks	USD	0,050 %	14/01/2022	24.999.250	4,8
	0 Federal Home Loan Banks	USD	0,050 %	25/01/2022	33.493.970	6,4
	00 Federal Home Loan Banks <sup>(c)</sup>	USD	0,170 %	28/02/2022	400.100	0,0
	00 Federal Home Loan Mortgage Corp. (FHLMC)(c)	USD	0,145 %	19/08/2022	6.703.015	1,2
	00 Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,350 %	07/01/2022	13.503.375	2,6
	00 Federal National Mortgage Association (FNMA)(c)	USD	0,170 %	29/07/2022	1.500.825	0,2
		_	-,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,		378.990.042	73,2
TOTAL DE BON (coste USD 378					378.990.042 Valor de	73,2
Tenencias	Decembraión del velor				mercado en	% de
	Descripción del valor				USD	patrimoni
Irlanda	rersión – 8,34 %		(4)(2)			
Irlanda 43.101.83	rersión – 8,34 %  3 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones	de distribución >	⟨\)(d)(e)		USD 43.101.833	patrimonio
Irlanda 43.101.83 TOTAL DE FON	rersión – 8,34 %  3 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones  DOS DE INVERSIÓN	de distribución >	()(d)(e)			8,3
HIANDA 43.101.83 TOTAL DE FON (coste USD 43.1 TOTAL DE VALO	rersión – 8,34 %  3 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones DOS DE INVERSIÓN 101.833)  ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VA				43.101.833	8,3 8,3
Irlanda 43.101.83 TOTAL DE FON (coste USD 43.1 TOTAL DE VAL (coste USD 422	rersión – 8,34 %  3 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones DOS DE INVERSIÓN 101.833)  ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VA	LORES OFICIA			43.101.833 43.101.833	8,3 8,3 81,6
Irlanda 43.101.83 TOTAL DE FON (coste USD 43.1 TOTAL DE VALC (coste USD 422 VALOR DE MER	rersión – 8,34 %  3 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones DOS DE INVERSIÓN 101.833)  ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VA .082.945)	LORES OFICIA		Compressive	43.101.833 43.101.833 422.091.875	
Irlanda 43.101.83 TOTAL DE FON (coste USD 43.1 TOTAL DE VALC (coste USD 422 VALOR DE MER	rersión – 8,34 %  3 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones DOS DE INVERSIÓN 101.833)  ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VA. 082.945)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD	LORES OFICIA		Compromiso Valor de mercado	43.101.833 43.101.833 422.091.875	8,3 8,3 81,6
Irlanda 43.101.83 TOTAL DE FON (coste USD 43.1 TOTAL DE VALC (coste USD 422 VALOR DE MEF Contratos de f	rersión – 8,34 %  3 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones DOS DE INVERSIÓN 101.833)  ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VA. 082.945)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD	LORES OFICIA		Compromiso Valor de mercado en USD	43.101.833 43.101.833 422.091.875 422.091.875	8,3 8,3 81,6
Irlanda 43.101.83 TOTAL DE FON (coste USD 43.1 TOTAL DE VALC (coste USD 422 VALOR DE MEF  Contratos de f  Número de contratos	rersión – 8,34 %  33 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones DOS DE INVERSIÓN 101.833)  ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VA. 082.945)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD futuros – (0,81 %)  Descripción del valor  CAD	LORES OFICIA		Valor de mercado en USD	43.101.833 43.101.833 422.091.875 422.091.875 Plusvalia latente USD	8,3 8,3 81,6 81,6
Irlanda 43.101.83 TOTAL DE FON (coste USD 43.1 TOTAL DE VALC (coste USD 422 VALOR DE MEF  Contratos de f  Número de contratos	rersión – 8,34 %  3 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones DOS DE INVERSIÓN 101.833)  ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VA082.945)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD futuros – (0,81 %)  Descripción del valor	LORES OFICIA		Valor de mercado en	43.101.833 43.101.833 422.091.875 422.091.875 Plusvalia latente	8,3 8,3 81,6 81,6
Irlanda 43.101.83 TOTAL DE FON (coste USD 43.1 TOTAL DE VALC (coste USD 422 VALOR DE MEF Contratos de f Número de contratos	rersión – 8,34 %  33 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones DOS DE INVERSIÓN 101.833)  ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VA. 082.945)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD futuros – (0,81 %)  Descripción del valor  CAD	LORES OFICIA	L	Valor de mercado en USD	43.101.833 43.101.833 422.091.875 422.091.875 Plusvalia latente USD	8,3 8,3 81,6 81,6
Irlanda 43.101.83 TOTAL DE FON (coste USD 43.1 TOTAL DE VALC (coste USD 422 VALOR DE MER Contratos de f Número de contratos	rersión – 8,34 %  33 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones DOS DE INVERSIÓN 101.833)  ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VA. 082.945)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD de futuros – (0,81 %)  Descripción del valor  CAD  Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021	LORES OFICIA 422.082.945)	L	Valor de mercado en USD	43.101.833 43.101.833 422.091.875 422.091.875 Plusvalia latente USD	8,3 81,6 81,6 81,6 % d patrimoni
Irlanda 43.101.83 TOTAL DE FON (coste USD 43.1 TOTAL DE VAL (coste USD 422 VALOR DE MER Contratos de f Número de contratos	rersión – 8,34 %  33 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones DOS DE INVERSIÓN (01.833)  ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VA. (082.945)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD futuros – (0,81 %)  Descripción del valor  CAD  Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR	122.082.945)	<b>L</b> Larga	Valor de mercado en USD 14.569.691	43.101.833 43.101.833 422.091.875 422.091.875  Plusvalia latente USD 130.963	8,3 81,6 81,6 % d patrimoni
Irlanda 43.101.83 TOTAL DE FON (coste USD 43.1 TOTAL DE VAL (coste USD 422 VALOR DE MER Contratos de f Número de contratos	rersión – 8,34 %  33 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones DOS DE INVERSIÓN (01.833)  ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VA. (082.945)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD futuros – (0,81 %)  Descripción del valor  CAD  Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años 08/12/2	122.082.945)	<b>L</b> Larga Larga	14.569.691	43.101.833 43.101.833 422.091.875 422.091.875 Plusvalia latente USD 130.963	8,3 81,6 81,6 91,0 9,0 0,0
Irlanda 43.101.83 TOTAL DE FON (coste USD 43.1 TOTAL DE VALC (coste USD 422 VALOR DE MEF Contratos de f Número de contratos 75 59 26	rersión – 8,34 %  33 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones DOS DE INVERSIÓN 101.833)  ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VA. 082.945)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD futuros – (0,81 %)  Descripción del valor  CAD  Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años 08/12/5  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/5  GBP	122.082.945)	<b>L</b> Larga Larga Larga	14.569.691 11.445.169 6.395.705 17.840.874	43.101.833 422.091.875 422.091.875 Plusvalia latente USD 130.963 79.469 187.526 266.995	8,3 81,6 81,6 % dd patrimoni 0,0 0,0 0,0
Irlanda 43.101.83 TOTAL DE FON (coste USD 43.1 TOTAL DE VALC (coste USD 422 VALOR DE MEF Contratos de f  Número de contratos 75 59 26	rersión – 8,34 %  33 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones DOS DE INVERSIÓN 101.833)  ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VA. 082.945)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD futuros – (0,81 %)  Descripción del valor  CAD  Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años 08/12/2  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/2	122.082.945)	<b>L</b> Larga Larga	14.569.691 11.445.169 6.395.705	43.101.833 43.101.833 422.091.875 422.091.875  Plusvalia latente USD 130.963 79.469 187.526	8,3 8,3 81,6 81,6
Irlanda 43.101.83 TOTAL DE FON (coste USD 43.1 TOTAL DE VAL. (coste USD 422 VALOR DE MER Contratos de f  Número de contratos  75  59 26  (1.033)	rersión – 8,34 %  33 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones DOS DE INVERSIÓN (01.833)  ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VA. (082.945)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD de futuros – (0,81 %)  Descripción del valor  CAD  Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años 08/12/5  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/5  GBP  Futuros en libras esterlinas a 90 días 20/12/2023  HKD	122.082.945)	Larga Larga Larga Corta	14.569.691 11.445.169 6.395.705 17.840.874	43.101.833 422.091.875 422.091.875 Plusvalia latente USD 130.963 79.469 187.526 266.995	8,3 8,3 81,6 81,6 % dripatrimoni
Irlanda 43.101.83 TOTAL DE FON (coste USD 43.1 TOTAL DE VAL. (coste USD 422 VALOR DE MER Contratos de f  Número de contratos  75  59 26  (1.033)	rersión – 8,34 %  33 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones DOS DE INVERSIÓN 101.833)  ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VA. 082.945)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD futuros – (0,81 %)  Descripción del valor  CAD  Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años 08/12//  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12//  GBP  Futuros en libras esterlinas a 90 días 20/12/2023  HKD  Futuros sobre el Hang Seng Index 30/12/2021	122.082.945)	Larga Larga Larga Corta	14.569.691  14.569.691  11.445.169 6.395.705 17.840.874  (168.500.490)	43.101.833 422.091.875 422.091.875 Plusvalia latente USD 130.963 79.469 187.526 266.995 14.845	8,3 8,3 81,6 81,6 9 du patrimoni 0,0 0,0 0,0 0,0
Irlanda 43.101.83 TOTAL DE FON (coste USD 43.1 TOTAL DE VAL (coste USD 422 VALOR DE MER Contratos de f  Número de contratos  75  59 26  (1.033)	rersión – 8,34 %  33 Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (Clase de acciones DOS DE INVERSIÓN (01.833)  ORES MOBILIARIOS ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VA. (082.945)  RCADO DE LAS INVERSIONES EXCLUYENDO DERIVADOS (coste USD de futuros – (0,81 %)  Descripción del valor  CAD  Futuros sobre el S&P TSX 60 Index 16/12/2021  EUR  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 10 años 08/12/5  Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 30 años 08/12/5  GBP  Futuros en libras esterlinas a 90 días 20/12/2023  HKD	122.082.945)	Larga Larga Larga Corta	14.569.691 11.445.169 6.395.705 17.840.874 (168.500.490)	43.101.833 43.101.833 422.091.875 422.091.875  Plusvalia latente USD 130.963 79.469 187.526 266.995	8,3 81,6 81,6 9,0 0,0 0,0 0,0

### Goldman Sachs Funds—Alternative Trend Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Número de contratos	Descripción del valor			Compromiso Valor de mercado en USD	Plusvalía latente USD	% del
(7)	KRW Futuros sobre el KOSPI 200 Index 09/12/2021		Corta	(550.015)	25.873	0,01
(1)			Corta	(550.015)	25.075	0,01
(833)	USD Futuros en eurodólares a 90 días 13/06/2022		Corta	(207.281.638)	29.316	0,01
, ,	Futuros en eurodólares a 90 días 13/03/2023		Corta	(521.707.262)	280.255	0,05
, ,	Futuros en eurodólares a 90 días 18/12/2023		Corta	(403.563.000)	111.400	0,02
81	Futuros sobre el E-Mini NASDAQ 100 Index 17/12/2021		Larga	26.163.810	1.086.631	0,21
512	Futuros sobre el E-Mini S&P 500 Index 17/12/2021		Larga .	116.896.000	1.543.479	0,30
				(989.492.090)	3.051.081	0,59
PLUSVALÍA LA	TENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS				4.393.602	0,85
				Valor de mercado	Minusvalía	
Número de contratos	Descripción del valor			de la asignación USD	latente USD	% del
	AUD					
(150)	Futuros sobre bonos del Tesoro de Australia a 10 años 15/12/2	2021	Corta	(14.819.265)	(112.653)	(0,02)
	CAD					
(872)	Futuros sobre letras de aceptación del Banco de Canadá 19/0	9/2022	Corta	(167.145.229)	(93.588)	(0,02)
(130)	Futuros sobre bonos del Estado de Canadá a 10 años 22/03/2	022	Corta	(14.278.921)	(245.915)	(0,04)
				(181.424.150)	(339.503)	(0,06)
	EUR	-				
()	Futuros sobre el EURIBOR a 3 meses 13/03/2023		Corta	(174.656.917)	(156.038)	(0,03)
	Futuros sobre el EURIBOR a 3 meses 18/12/2023		Corta	(193.214.151)	(166.231)	(0,03)
	Futuros sobre el Amsterdam Index 17/12/2021		Larga	8.747.489	(556.920)	(0,11)
	Futuros sobre el CAC 40 Index 17/12/2021		Larga	11.792.867	(759.442)	(0,15)
	Futuros sobre el DAX Index 17/12/2021 Futuros sobre el E-mini FTSE MIB Index 17/12/2021		Larga	23.010.699 9.584.102	(1.043.527)	(0,20)
	Futuros sobre Euro BTP Bonos del Estado de Italia 08/12/2021	1	Larga Corta	(1.707.423)	(99.937) (2.071)	(0,02)
, ,	Futuros sobre el Euro STOXX 50 Index 17/12/2021		Larga	27.167.304	(917.877)	(0,18)
	Futuros sobre bonos de la República Federal de Alemania a 5	años 08/12/2021	Larga	2.134.475	(1.287)	(0,00)
	Futuros sobre el IBEX 35 Index 17/12/2021		Larga	3.001.624	(232.480)	(0,04)
				(284.139.931)	(3.935.810)	(0,76)
	GBP	-	-			
(930)	Futuros en libras esterlinas a 90 días 15/06/2022		Corta	(152.399.161)	(203.947)	(0,04)
(1.053)	Futuros en libras esterlinas a 90 días 15/03/2023		Corta	(171.910.861)	(97.535)	(0,02)
	Futuros sobre el FTSE 100 Index 17/12/2021		Larga	12.738.001	(157.645)	(0,03)
(64)	Futuros sobre bonos del Estado británico (gilts) a largo plazo 2	29/03/2022	Corta	(10.701.693)	(153.151)	(0,03)
				(322.273.714)	(612.278)	(0,12)
73	JPY Futuros sobre el TOPIX Index 09/12/2021		Larga	12.189.705	(916.964)	(0,18)
	SEK				(5151551)	(0,10)
328	Futuros sobre el OMX Stockholm 30 Index 17/12/2021		Larga	8.107.199	(513.514)	(0,10)
	ТНВ					
1.174	Futuros sobre el SET50 Index 29/12/2021		Larga	6.475.247	(353.912)	(0,07)
2.4	USD  Futures sobre at F. Mini S&P MidCap 400 Index 17/13/2021		Lorse	0.204.000	(186 FO1)	(0.04)
	Futuros sobre el E-Mini S&P MidCap 400 Index 17/12/2021 Futuros sobre el Mini-Russell 2000 Index 17/12/2021		Larga Larga	9.201.080 7.360.955	(186.501) (420.599)	(0,04) (0,08)
	Futuros sobre bonos del Tesoro de EE. UU. a largo plazo 22/0	3/2022	Corta	(1.783.375)	(11.687)	(0,00)
	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 10 años 22/03		Corta	(63.167.344)	(762.599)	(0,15)
(481)	Futuros sobre pagarés del Tesoro de EE. UU. a 5 años 31/03/2	2022	Corta	(58.377.617)	(441.427)	(0,08)
			•	(106.766.301)	(1.822.813)	(0,35)
MINUSVALÍA L	ATENTE SOBRE CONTRATOS DE FUTUROS				(8.607.447)	(1,66)
Contratos de	divisas a plazo – (0,08 %)					
				Facility of	Plusvalía	0/ -
Divisa	Compra Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	latente en USD	% del
JPY	2.395.340.000 USD 2	21.064.032		23/12/2021	40.729	0,01
USD	32.467.008 AUD	14.950.000		23/12/2021	586.535	0,11

### Goldman Sachs Funds—Alternative Trend Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

Contratos de divi	ione e plaza (cont	linuación)					
Contratos de divi	isas a plazo – (cont	inuacion)				B1 1'	
Divisa	Compra	Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	Plusvalía latente en USD	% del patrimonio
USD	94.796.191	EUR	83.770.000		23/12/2021	423.408	0,08
USD	44.005.279	GBP	32.760.000		23/12/2021	644.031	0,13
USD	8.151.797		73.430.000		23/12/2021	93.414	0,02
USD	17.071.201		24.970.000		23/12/2021	127.581	0,03
USD	19.710.422		176.800.000		23/12/2021	210.087	0,04
USD	6.605.856		104.660.000		23/12/2021	93.570	0,01
PHP USD	484.570.000 7.468.848		9.540.094 41.890.000		29/12/2021 29/12/2021	53.452 93.835	0,01 0,02
PLUSVALÍA LATEN	NTE SOBRE CONTRA	ATOS DE DIVISAS	S A PLAZO			2.517.955	0,49
		,				Minusvalía	
Divisa	Compra	Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	latente USD	% del patrimonio
PHP	1.455.630.000		28.958.518		01/12/2021	(68.371)	
USD	28.617.162		1.455.630.000		01/12/2021	(272.984)	(0,00) (0,05)
CAD	12.880.000		10.198.894		23/12/2021	(155.757)	(0,03)
CHF	8.190.000		8.860.875		23/12/2021	(2.506)	(0,00)
EUR	9.130.000		10.293.125		23/12/2021	(7.540)	(0,00)
ILS	118.960.000		38.460.270		23/12/2021	(666.610)	(0,13)
MXN	57.870.000		2.774.096		23/12/2021	(93.144)	(0,02)
NZD	10.330.000	USD	7.242.963		23/12/2021	(233.448)	(0,05)
USD	62.629.131	CHF	58.080.000		23/12/2021	(190.652)	(0,04)
USD	25.937.478	CZK	587.160.000		23/12/2021	(36.082)	(0,00)
USD	26.288.904	HUF	8.551.970.000		23/12/2021	(49.834)	(0,01)
USD	11.792.505	ILS	37.270.000		23/12/2021	(48.196)	(0,01)
USD	80.898.072	JPY	9.212.400.000		23/12/2021	(270.155)	(0,05)
USD	7.315.831		159.070.000		23/12/2021	(53.429)	(0,01)
USD	29.562.484		122.570.000		23/12/2021	(32.993)	(0,01)
IDR	476.162.100.000		33.224.232		29/12/2021	(86.081)	(0,02)
INR	2.109.300.000		28.227.123		29/12/2021	(230.712)	(0,05)
RUB	919.470.000		12.433.789		29/12/2021	(157.134)	(0,03)
USD	16.879.548		14.106.830.000		29/12/2021	(4.547)	(0,00)
USD USD	33.407.888		39.846.460.000		29/12/2021	(204.484)	(0,04)
USD	11.762.872 8.203.160		595.070.000		29/12/2021 29/12/2021	(18.359)	(0,00)
USD	9.160.500		616.670.000 254.530.000		29/12/2021	(30.545) (44.991)	(0,01) (0,01)
	ENTE SOBRE CONTR				25/12/2021	(2.958.554)	(0,57)
		,	use de acciones - (0,35 %)			(2.000.004)	(0,01)
Contractor do divi	ous a plazo coposi	noos as ana sia	(0,00 /0)		Fecha de	Plusvalía	0/ -1-1
Divisa	Compra	Divisa	Venta		vencimiento	latente en USD	% del patrimonio
JPY	758.820.434	USD	6.662.627		23/12/2021	23.156	0,01
USD	1.789.146	EUR	1.586.972		23/12/2021	1.311	0,00
USD	3.605.696		2.708.900		23/12/2021	20.187	0,00
PLUSVALÍA LATEN	NTE SOBRE CONTRA	ATOS DE DIVISAS	S A PLAZO CELEBRADOS CON F	INES DE COBERTURA		44.654	0,01
Divisa	Compra	Divisa	Venta		Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% del patrimonio
EUR	46.866.305	LISD	53.048.289		23/12/2021	(250.109)	(0,05)
GBP USD	70.370.999 224.395		94.727.408 25.517.472		23/12/2021 23/12/2021	(1.584.111) (434)	(0,31) (0,00)
MINUSVALÍA LATE	NTE SOBRE CONTR	RATOS DE DIVISA	AS A PLAZO CELEBRADOS CON	FINES DE COBERTURA		(1.834.654)	(0,36)
Contratos de per	mutas financieras -	- (0,20 %)					
Importe teórico local neto	A pagar		A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% del
	. •						,
	Permutas de incum crediticio (CDS)	ipiimiento					
15.450.000	Variable (iTraxx Euro	pe Crossover					
	Series 36 Version 1 I		Fijo 5,000 %	EUR	20/12/2026	(401.765)	(80,0)
36.050.000	Variable (iTraxx Euro						
	Series 36 Version 1 I	Index)	Fijo 1,000 %	EUR	20/12/2026	(194.796)	(0,04)

### Goldman Sachs Funds—Alternative Trend Portfolio Estado de las inversiones A 30 de noviembre de 2021

#### Contratos de permutas financieras - (continuación)

Importe teórico local neto	A pagar	A recibir	Divisa	Fecha de vencimiento	Minusvalía latente USD	% del
	Permutas de incumplimiento crediticio	(CDS) – (continuación)				_ ·
20 250 000	Variable (The Markit CDX North America	(CD3) = (ContinuaCion)				
20.230.000	High Yield 37 Version 1 Index)	Fijo 5,000 %	USD	20/12/2026	(294.153)	(0,06)
43.850.000	Variable (The Markit CDX North America	•			, ,	, ,
	Investment Grade 37 Version 1 Index)	Fijo 1,000 %	USD	20/12/2026	(121.594)	(0,02)
MINUSVALÍA LATE	ENTE SOBRE PERMUTAS DE INCUMPLI	MIENTO CREDITICIO (CDS)			(1.012.308)	(0,20)
TOTAL DE MINUS	VALÍA LATENTE SOBRE CONTRATOS D	E PERMUTAS FINANCIERAS			(1.012.308)	(0,20)
VALOR DE MERCA	ADO DE LAS INVERSIONES					
(coste USD 422.08	32.945)				414.635.123	80,19
OTROS ACTIVOS	Y PASIVOS				102.460.306	19,81
PATRIMONIO					517.095.429	100,00
TOTAL DE INVERS	SIONES				Valor de mercado en USD	% del patrimonio
Total inversiones ex	xcluyendo derivados (coste USD 422.082.9	45)			422.091.875	81,63
Plusvalía latente so	obre contratos de futuros	•			4.393.602	0,85
Minusvalía latente s	sobre contratos de futuros				(8.607.447)	(1,66)
Plusvalía latente so	obre contratos de divisas a plazo				2.517.955	0,49
Minusvalía latente s	sobre contratos de divisas a plazo				(2.958.554)	(0,57)
Plusvalía latente so	bre contratos de divisas a plazo celebrado	s con fines de cobertura			44.654	0,01
	sobre contratos de divisas a plazo celebrac	los con fines de cobertura			(1.834.654)	(0,36)
	sobre contratos de permutas financieras				(1.012.308)	(0,20)
Otros activos y pas	ivos				102.460.306	19,81
Patrimonio					517.095.429	100,00

El Comisionista de futuros fue Newedge Group.

La contraparte de los contratos de divisas a plazo fue JP Morgan Chase Bank N.A.

La contraparte de los contratos de permutas financieras fue Credit Suisse.

 $La \ exposición \ m\'{a}xima \ a \ cada \ contraparte \ a \ 30 \ de \ noviembre \ de \ 2021, \ medida \ como \ porcentaje \ del \ VL, \ es \ del \ 0.85 \ \%.$ 

<sup>(</sup>a) Los tipos de interés representan bien el tipo de cupón establecido, la rentabilidad anualizada descontada en la fecha de adquisición para los títulos descontados, o, en el caso de los títulos de interés variable, el tipo de reajuste vigente que se basa en los índices de los tipos de interés.

<sup>(</sup>b) Las fechas de vencimiento representan bien la fecha indicada en el título, o la siguiente fecha actualizada de interés para los títulos de interés variable, o la fecha preestablecida para ese tipo de títulos.

<sup>(</sup>c) Los tipos de cupones variables y flotantes son aquellos cotizados el 30 de noviembre de 2021.

<sup>(</sup>d) Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

<sup>(</sup>e) El rendimiento de este fondo a 30 de noviembre de 2021 fue del 0,028 %.

El Reglamento de la UE sobre divulgación de finanzas sostenibles ("SFDR") (Reglamento (UE) 2019/2088) se encuentra vigente desde el 10 de marzo de 2021. Con arreglo al artículo 11 del SFDR (Transparencia de la promoción de las características medioambientales o sociales y de las inversiones sostenibles en los informes periódicos), Goldman Sachs Asset Management Fund Services Limited está obligada a proporcionar una descripción del grado en que se han cumplido las características medioambientales o sociales con respecto a las Carteras que divulgan información de conformidad el apartado 1 del artículo 8 del SFDR y, en la medida en que resulte aplicable, con el artículo 9 del SFDR. Esta información se proporciona en este informe para las Carteras pertinentes:

Carteras	Categoría SFDR	Grado en que se han cumplido las características medioambientales o sociales
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  - las armas controvertidas (incluidas las armas nucleares);  - el tabaco;  - la extracción y/o la producción de determinados combustibles fósiles (incluidos el carbón térmico, las arenas bituminosas y el petróleo y el gas provenientes del Ártico);  - el entretenimiento para adultos;  - las prisiones con fines de lucro; y  - las armas de fuego civiles.
Asia Equity Portfolio	8	Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  • las armas controvertidas (incluidas las armas nucleares);  • el tabaco;  • la extracción y/o la producción de determinados combustibles fósiles (incluidos el carbón térmico, las arenas bituminosas y el petróleo y el gas provenientes del Ártico);  • el entretenimiento para adultos;  • las prisiones con fines de lucro; y  • las armas de fuego civiles.
All China Equity Portfolio	8	Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.  No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta
		los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.

Carteras	Categoría SFDR	Grado en que se han cumplido las características medioambientales o sociales
Emerging Markets Equity ESG Portfolio	8	Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  • las armas controvertidas (incluidas las armas nucleares);  • el tabaco;  • el alacohol;  • la extracción y/o la producción de determinados combustibles fósiles (incluidos el carbón térmico, las arenas bituminosas y el petróleo y el gas provenientes del Ártico);  • los juegos de azar;  • el entretenimiento para adultos;  • las prisiones con fines de lucro; y  • las armas de fuego civiles.  Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el
		"Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  • las armas controvertidas (incluidas las armas nucleares);  • el tabaco;  • la extracción y/o la producción de determinados combustibles fósiles;  • le entretenimiento para adultos;  • las prisiones con fines de lucro; y  • las armas de fuego civiles.
Emerging Markets Equity Portfolio	8	Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  • las armas controvertidas (incluidas las armas nucleares);  • el tabaco;  • la extracción y/o la producción de determinados combustibles fósiles;  • el entretenimiento para adultos;  • las prisiones con fines de lucro; y  • las armas de fuego civiles.
Global Environmental Impact Equity Portfolio	8	Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.

Carteras	Categoría SFDR	Grado en que se han cumplido las características medioambientales o sociales
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  • las armas controvertidas (incluidas las armas nucleares);  • el tabaco;  • la extracción y/o la producción de determinados combustibles fósiles;  • el entretenimiento para adultos;  • las prisiones con fines de lucro; y  • las armas de fuego civiles.
Global Equity Income Portfolio	8	Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.
Global Equity Partners ESG Portfolio	8	Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  • las armas controvertidas (incluidas las armas nucleares);  • el tabaco;  • el alacohol;  • la extracción y/o la producción de determinados combustibles fósiles (incluidos el carbón térmico, las arenas bituminosas y el petróleo y el gas provenientes del Ártico);  • los juegos de azar;  • el entretenimiento para adultos;  • las prisiones con fines de lucro; y  • las armas de fuego civiles.  Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.  No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.
Global Equity Partners Portfolio	8	Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  • las armas controvertidas (incluidas las armas nucleares); • el tabaco; • la extracción y/o la producción de determinados combustibles fósiles; • el entretenimiento para adultos; • las prisiones con fines de lucro; y • las armas de fuego civiles.  Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.

Carteras	Categoría SFDR	Grado en que se han cumplido las características medioambientales o sociales
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  • las armas controvertidas (incluidas las armas nucleares);  • el tabaco;  • la extracción y/o la producción de determinados combustibles fósiles;  • el entretenimiento para adultos;  • las prisiones con fines de lucro; y  • las armas de fuego civiles.
Global Future Health Care Equity Portfolio	8	Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.  No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta
		los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  • las armas controvertidas (incluidas las armas nucleares);  • el tabaco;  • la extracción y/o la producción de determinados combustibles fósiles;  • el entretenimiento para adultos;  • las prisiones con fines de lucro; y  • las armas de fuego civiles.
Global Future Technology Leaders Equity Portfolio	8	Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  • las armas controvertidas (incluidas las armas nucleares);  • el tabaco;  • la extracción y/o la producción de determinados combustibles fósiles;  • el entretenimiento para adultos;  • las prisiones con fines de lucro; y  • las armas de fuego civiles.
Global Millennials Equity Portfolio	8	Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.

Carteras	Categoría SFDR	Grado en que se han cumplido las características medioambientales o sociales
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  • las armas controvertidas (incluidas las armas nucleares); • el tabaco; • la extracción y/o la producción de determinados combustibles fósiles; • el entretenimiento para adultos; • las prisiones con fines de lucro; y • las armas de fuego civiles.
India Equity Portfolio	8	Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  • las armas controvertidas (incluidas las armas nucleares);  • el tabaco;  • la extracción y/o la producción de determinados combustibles fósiles;  • el entretenimiento para adultos;  • las prisiones con fines de lucro; y  • las armas de fuego civiles.
Japan Equity Partners Portfolio	8	Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  - las armas controvertidas (incluidas las armas nucleares); - el tabaco; - la extracción y/o la producción de determinados combustibles fósiles; - el entretenimiento para adultos; - las prisiones con fines de lucro; y - las armas de fuego civiles.
Japan Equity Portfolio	8	Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.

Carteras	Categoría SFDR	Grado en que se han cumplido las características medioambientales o sociales
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  - las armas controvertidas (incluidas las armas nucleares); - el tabaco; - la extracción y/o la producción de determinados combustibles fósiles; - el entretenimiento para adultos; - las prisiones con fines de lucro; y - las armas de fuego civiles.
US Equity Portfolio	8	Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  • las armas controvertidas (incluidas las armas nucleares);  • el tabaco;  • la extracción y/o la producción de determinados combustibles fósiles;  • el entretenimiento para adultos;  • las prisiones con fines de lucro; y  • las armas de fuego civiles.
US Focused Growth Equity Portfolio	8	Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  - las armas controvertidas (incluidas las armas nucleares); - el tabaco; - la extracción y/o la producción de determinados combustibles fósiles; - el entretenimiento para adultos; - las prisiones con fines de lucro; y - las armas de fuego civiles.
US Small Cap Equity Portfolio	8	Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.

Carteras	Categoría SFDR	Grado en que se han cumplido las características medioambientales o sociales				
	-	Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  - las armas controvertidas (incluidas las armas nucleares); - el tabaco; - la extracción y/o la producción de determinados combustibles fósiles; - el entretenimiento para adultos; - las prisiones con fines de lucro; y - las armas de fuego civiles.				
US Technology Opportunities Equity Portfolio	8	Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta lo criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.				
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.				
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. El Gestor de inversiones ha promovido las características medioambientales mediante la inversión, principalmente, en valores de renta variable de empresas domiciliadas en cualquier parte del mundo que han contribuido a la descarbonización de la economía mediante la generación, producción, transmisión y/o distribución de energía renovable.				
	8	El Gestor de inversiones ha contemplado factores ESG que pueden incluir, entre otros, la elaboración de informes medioambientales y sociales, la divulgación de información y la transparencia, el perfil de emisiones e intensidad de carbono, la seguridad y salud en el lugar de trabajo, el efecto en la comunidad, consideraciones en materia de derechos humanos, las prácticas de gobernanza y las relaciones con las partes interesadas, las relaciones con los empleados, la estructura de la junta, la transparencia y los incentivos de gestión.				
		Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.				
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.				
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  • las armas controvertidas (incluidas las armas nucleares);  • el tabaco;  • la extracción y/o la producción de determinados combustibles fósiles;  • le entretenimiento para adultos;  • las prisiones con fines de lucro; y  • las armas de fuego civiles.				
Global Infrastructure Equity Portfolio	8	Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.				
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.				

Carteras	Categoría SFDR	Grado en que se han cumplido las características medioambientales o sociales				
Global Real Estate Equity Portfolio  8  North America Energy & Energy Infrastructure 6 (positivo)		ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  • las armas controvertidas (incluidas las armas nucleares); • el tabaco; • la extracción y/o la producción de determinados combustibles fósiles; • el entretenimiento para adultos; • las prisiones con fines de lucro; y • las armas de fuego civiles.  Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.  No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se				
North America Energy & Energy Infrastructure		Reglamento de taxonomia. Por lo tanto, el principio de "no causar danos significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.  Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para				
Equity Portfolio	6 (positivo)	las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.				
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	8	Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del año, el Gestor ha abordado el riesgo de transición climática mediante el uso de métricas de carbono propias para lograr una intensidad de carbono media ponderada en el fondo inferior a la de su índice de referencia.  Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.  No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.				
Europe CORE® Equity Portfolio	8	Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del año, el Gestor ha abordado el riesgo de transición climática mediante el uso de métricas de carbono propias para lograr una intensidad de carbono media ponderada en el fondo inferior a la de su índice de referencia.  Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.  No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.				

Carteras	Categoría SFDR	Grado en que se han cumplido las características medioambientales o sociales				
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del año, el Gestor ha abordado el riesgo de transición climática mediante el uso de métricas de carbono propias para lograr una intensidad de carbono media ponderada en el fondo inferior a la de su índice de referencia.				
Eurozone CORE® Equity Portfolio	8	Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.				
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.				
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del año, el Gestor ha abordado el riesgo de transición climática mediante el uso de métricas de carbono propias para lograr una intensidad de carbono media ponderada en el fondo inferior a la de su índice de referencia.				
Global CORE® Equity Portfolio	8	su indice de referencia.  Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta lo criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.				
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.				
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del año, el Gestor ha abordado el riesgo de transición climática mediante el uso de métricas de carbono propias para lograr una intensidad de carbono media ponderada en el fondo inferior a la de su índice de referencia.				
Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	8					
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.				
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del año, el Gestor ha abordado el riesgo de transición climática mediante el uso de métricas de carbono propias para lograr una intensidad de carbono media ponderada en el fondo inferior a la de su índice de referencia.				
US CORE® Equity Portfolio	8	Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.				
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.				

Carteras	Categoría SFDR	Grado en que se han cumplido las características medioambientales o sociales					
US Small Cap CORE® Equity Portfolio	8	Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del año, el Gestor ha abordado el riesgo de transición climática mediante el uso de métricas de carbono propias para lograr una intensidad de carbono media ponderada en el fondo inferior a la de su índice de referencia.  Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.  No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.					
Asia High Yield Bond Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.					
Emerging Markets Corporate Bond Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.					
Emerging Markets Debt Blend Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.  Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para					
Emerging Markets Debt Local Portfolio	6 (positivo)	las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.  Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para					
Emerging Markets Debt Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.  Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del					
ESG-Enhanced Emerging Markets Short Duration Bond Portfolio	8	Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  • la producción de armas controvertidas (incluidas las armas nucleares) y/o la participación en la producción de las mismas;  • la producción o la venta de tabaco;  • la extracción, la producción o la generación de determinados combustibles fósiles (incluido el carbón térmico y las arenas bituminosas); y  • la producción o la venta de armas de fuego civiles.  El Gestor de inversiones también ha excluido de su universo de inversión a todas las empresas que violen los diez principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (que son principios de sostenibilidad corporativa ampliamente reconocidos que se adhieren a responsabilidades fundamentales en las áreas de derechos humanos, trabajo, medio ambiente y anticorrupción).  Además, el proceso de selección de la Cartera excluyó a los emisores corporativos y gubernamentales con la categoría de calificación ESG más baja de acuerdo con el sistema de calificación interno propio del Asesor de inversiones.  Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.					
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.					

Carteras	Categoría SFDR	Grado en que se han cumplido las características medioambientales o sociales
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los títulos de deuda emitidos por emisores corporativos y soberanos que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  • la producción de armas controvertidas (incluidas las armas nucleares) y/o la participación en la producción de las mismas;  • la producción o la venta de tabaco;  • la extracción, la producción o la generación de determinados combustibles fósiles (incluido el carbón térmico y las arenas bituminosas); y  • la producción o la venta de armas de fuego civiles.
ESG-Enhanced Euro Short Duration Bond Plus Portfolio  8	8	El Gestor de inversiones también ha excluido de su universo de inversión a todas las empresas que violen los diez principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (que son principios de sostenibilidad corporativa ampliamente reconocidos que se adhieren a responsabilidades fundamentales en las áreas de derechos humanos, trabajo, medio ambiente y anticorrupción).
		Además, el proceso de selección de la Cartera excluyó a los emisores corporativos y gubernamentales con la categoría de calificación ESG más baja de acuerdo con el sistema de calificación interno propio del Asesor de inversiones.
		Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
	No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.	
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los títulos de deuda emitidos por emisores corporativos y soberanos que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  • la producción de armas controvertidas (incluidas las armas nucleares) y/o la participación en la producción de las mismas;  • la producción o la venta de tabaco;  • la extracción, la producción o la generación de determinados combustibles fósiles (incluido el carbón térmico y las arenas bituminosas); y  • la producción o la venta de armas de fuego civiles.
ESG-Enhanced Europe High Yield Bond		El Gestor de inversiones también ha excluido de su universo de inversión a todas las empresas que violen los diez principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (que son principios de sostenibilidad corporativa ampliamente reconocidos que se adhieren a responsabilidades fundamentales en las áreas de derechos humanos, trabajo, medio ambiente y anticorrupción).
Portfolio	8	Además, el proceso de selección de la Cartera excluyó a los emisores corporativos y gubernamentales con la categoría de calificación ESG más baja de acuerdo con el sistema de calificación interno propio del Asesor de inversiones.
		Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.

Carteras	Categoría SFDR	Grado en que se han cumplido las características medioambientales o sociales
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los títulos de deuda emitidos por emisores corporativos y soberanos que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  • la producción de armas controvertidas (incluidas las armas nucleares) y/o la participación en la producción o la senta de tabaco;  • la extracción, la producción o la generación de determinados combustibles fósiles (incluido el carbón térmico y las arenas bituminosas); y  • la producción o la venta de armas de fuego civiles.
		El Gestor de inversiones también ha excluido de su universo de inversión a todas las empresas que violen los diez principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (que son principios de sostenibilidad corporativa ampliamente reconocidos que se adhieren a responsabilidades fundamentales en las áreas de derechos humanos, trabajo, medio ambiente y anticorrupción).
ESG-Enhanced Global Income Bond Portfolio	8	Además, el proceso de selección de la Cartera excluyó a los emisores corporativos y gubernamentales con la categoría de calificación ESG más baja de acuerdo con el sistema de calificación interno propio del Asesor de inversiones.
		Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los títulos de deuda emitidos por emisores corporativos y soberanos que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingresos a partir de las mismas:  • la producción de armas controvertidas (incluidas las armas nucleares) y/o la participación en la producción o la venta de tabaco;  • la extracción, la producción o la generación de determinados combustibles fósiles (incluido el carbón térmico y las arenas bituminosas); y  • la producción o la venta de armas de fuego civiles.
		El Gestor de inversiones también ha excluido de su universo de inversión a todas las empresas que violen los diez principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (que son principios de sostenibilidad corporativa ampliamente reconocidos que se adhieren a responsabilidades fundamentales en las áreas de derechos humanos, trabajo, medio ambiente y anticorrupción).
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio	8	Además, el proceso de selección de la Cartera excluyó a los emisores corporativos y gubernamentales con la categoría de calificación ESG más baja de acuerdo con el sistema de calificación interno propio del Asesor de inversiones.
		Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.
Global Credit Portfolio (Hedged)	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
Global Fixed Income Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
Global Fixed Income Portfolio (Hedged)	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
Global High Yield Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
Global Sovereign Bond Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Carteras	Categoría SFDR	Grado en que se han cumplido las características medioambientales o sociales			
Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.			
US Dollar Short Duration Bond Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.			
US Fixed Income Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.			
US Mortgage Backed Securities Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.			
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.			
ESG-Enhanced Global Multi-Asset Balanced Portfolio	8	Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. A lo largo del ejercicio, el Gestor de inversiones ha excluido los valores y emisores que participen directamente en las siguientes actividades y/u obtengan una parte significativa de ingripartir de las mismas:  • la producción de armas controvertidas y/o la participación en la producción de las misis extracción y/o la generación de carbón térmico;  • la extracción y/o la generación de carbón térmico;  • la extracción de petróleo y gas provenientes del Ártico;  • la producción y/o la distribución de aceite de palma;  • la producción o la venta de tabaco;  • la producción o la venta de armas de fuego civiles;  • las actividades empresariales relacionadas con los juegos de azar;  • las prisiones con fines de lucro; y  • los préstamos abusivos.  El Gestor de inversiones cuenta con una exposición limitada a emisores con una intende carbono superior a un nivel que el Asesor de inversiones considere apropiado. Asin el Gestor de inversiones ha excluido de su universo de inversión a todas las empresas violen los diez principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (que son Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tiene en cuenta criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles es entido del Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" aplica a ninguna de las inversio			
Global Multi-Asset Conservative Portfolio	8	Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. Durante el ejercicio, el Gestor de inversiones ha promovido determinadas características medioambientales y sociales a través de la inversión de una parte de los activos en determinados Fondos autorizados que: incorporan umbrales de exclusión basados en ingresos (incluidos, entre otros, el tabaco, los juegos de azar, las prisiones con fines de lucro, las armas de fuego civiles, las armas, las armas nucleares, las armas controvertidas, la extracción de carbón, y el petróleo y el gas provenientes del Ártico); y/o promovió determinadas temáticas ESG y/o características medioambientales y sociales incluidos, entre otros, el riesgo climático, la gobernanza y las cuestiones relativas a los empleados.  La adherencia a estas características ESG se llevó a cabo mediante la inversión en Fondos autorizados que tratan de limitar la exposición de la Cartera a empresas que obtienen una parte significativa de ingresos a partir de las actividades mencionadas anteriormente y/o que realizan inversiones basadas en las temáticas ESG promovidas por el Fondo autorizado.  Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.  No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se alsociamento de taxonomía. Por l			

Carteras	Categoría SFDR	Grado en que se han cumplido las características medioambientales o sociales
		Este Fondo promueve las características medioambientales y sociales. Durante el ejercicio, el Gestor de inversiones ha promovido determinadas características medioambientales y sociales a través de la inversión de una parte de los activos en determinados Fondos autorizados que: incorporan umbrales de exclusión basados en ingresos (incluidos, entre otros, el tabaco, los juegos de azar, las prisiones con fines de lucro, las armas de fuego civiles, las armas, las armas nucleares, las armas controvertidas, la extracción de carbón, la generación de carbón, y el petróleo y el gas provenientes del Ártico); y/o promovió determinadas temáticas ESG y/o características medioambientales y sociales incluidos, entre otros, el riesgo climático, la gobernanza y las cuestiones relativas a los empleados.
Global Multi-Asset Growth Portfolio	8	La adherencia a estas características ESG se llevó a cabo mediante la inversión en Fondos autorizados que tratan de limitar la exposición de la Cartera a empresas que obtienen una parte significativa de ingresos a partir de las actividades mencionadas anteriormente y/o que realizan inversiones basadas en las temáticas ESG promovidas por el Fondo autorizado.
		Como se ha mencionado anteriormente, este Fondo promueve las características medioambientales. En este sentido, el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento de taxonomía") exige que se declare que el principio de "no causar daños significativos" se aplica únicamente a las inversiones subyacentes del Fondo que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes del resto de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
		No obstante, cabe señalar que, a pesar de todo lo expuesto, este Fondo no tiene en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en el sentido del Reglamento de taxonomía y no se calcula la alineación de su cartera con dicho Reglamento de taxonomía. Por lo tanto, el principio de "no causar daños significativos" no se aplica a ninguna de las inversiones de este Fondo.
Global Multi-Asset Income Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
US Real Estate Balanced Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
Emerging Markets Total Return Bond Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
Global Absolute Return Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
Global Dynamic Bond Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
Global Dynamic Bond Plus Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
Global Strategic Macro Bond Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
Strategic Absolute Return Bond II Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
Global Corporate Portfolio (Hedged)	6 (positivo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
Absolute Return Tracker Portfolio	6 (negativo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.
Alternative Trend Portfolio	6 (negativo)	Las inversiones subyacentes de este Fondo no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

	Divisa	Fecha de creación	Porcentaje de comisión de asesoramiento	Límite de gastos <sup>(a)</sup>	Ratio de gastos netos totales <sup>(b)</sup>
Asia Equity Portfolio	USD				
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	14 de noviembre de 2005	1,50 %	1,90 %	1,84 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	31 de mayo de 1994	1,50 %	1,90 %	1,79 %
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	26 de mayo de 2016	1,50 %	2,40 %	2,29 %
Clase de acciones "A"	USD	5 de marzo de 2001	1,50 %	2,40 %	2,29 %
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	31 de julio de 2001	1,50 %	2,65 %	2,54 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	26 de octubre de 2007	0,75 %	1,21 %	0,98 %
Clase de acciones "I"	GBP	8 de abril de 2016	0,75 %	1,21 %	0,99 %
Clase de acciones "I" Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	13 de noviembre de 2001	0,75 %	1,21 %	0,97 %
	JPY USD	13 de septiembre de 2016	0,00 %	0,46 %	
Clase de acciones de acumulación "P" Clase de acciones "P"	USD	8 de septiembre de 2008 8 de septiembre de 2008	1,25 %	1,65 %	1,53 %
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	10 de diciembre de 2012	1,25 % 0,75 %	1,65 % 1,15 %	1,04 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	13 de diciembre de 2012	0,75 %	1,15 %	1,04 %
Clase de acciones "R"	GBP	8 de abril de 2016	0,75 %	1,15 %	1,04 %
Clase de acciones "R"	USD	10 de diciembre de 2012	0,75 %	1,15 %	1,05 %
All China Equity Portfolio <sup>(c)</sup>	USD		-,	.,	.,
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	26 de agosto de 2009	1,50 %	1,90 %	1,85 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	26 de agosto de 2009	1,50 %	1,90 %	1,85 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	26 de agosto de 2009	0,75 %	1,11 %	1,01 %
Clase de acciones "I"	USD	26 de agosto de 2009	0,75 %	1,11 %	1,03 %
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	3 de marzo de 2010	0,85 %	1,25 %	1,19 %
Clase de acciones "P"	USD	3 de marzo de 2010	0,85 %	1,25 %	1,19 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	3 de diciembre de 2012	0,75 %	1,15 %	1,09 %
Clase de acciones "R"	GBP	10 de diciembre de 2012	0,75 %	1,15 %	1,09 %
Clase de acciones "R"	USD	3 de diciembre de 2012	0,75 %	1,15 %	1,10 %
Emerging Markets Equity ESG Portfolio	USD				
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	27 de septiembre de 2018	1,75 %	2,25 %	2,00 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	27 de septiembre de 2018	1,75 %	2,25 %	1,98 %
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	3 de abril de 2019	1,75 %	2,75 %	2,50 %
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "I"	USD	27 de septiembre de 2018	0,85 %	1,31 %	1,01 %
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	13 de noviembre de 2019	0,85 %	1,31 %	1,04 %
Clase de acciones de acumulación "I"	GBP	9 de octubre de 2020	0,85 %	1,31 %	1,04 %
Clase de acciones de acumulación "I"  Clase de acciones "I"	USD	27 de septiembre de 2018	0,85 %	1,31 % 1,31 %	1,02 %
Clase de acciones 1 Clase de acciones de acumulación "IO"	EUR	27 de septiembre de 2018 24 de octubre de 2018	0,85 % 0,00 %	0,46 %	1,08 % 0,16 %
Clase de acciones "IO"(c)	USD	22 de febrero de 2021	0,00 %	0,46 %	
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	26 de febrero de 2020	1,25 %	1,75 %	1,48 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	27 de septiembre de 2018	0,85 %	1,35 %	1,11 %
Clase de acciones "R"	GBP	25 de septiembre de 2019	0,85 %	1,35 %	1,11 %
Clase de acciones "R"	USD	27 de septiembre de 2018	0,85 %	1,35 %	1,08 %
Emerging Markets Equity Portfolio	USD		-,	.,	.,
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	14 de noviembre de 2005	1,75 %	2,25 %	1,93 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	15 de diciembre de 1997	1,75 %	2,25 %	1,93 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	CHF	12 de agosto de 2016	1,75 %	2,25 %	1,92 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	11 de febrero de 2016	1,75 %	2,25 %	1,92 %
Clase de acciones puntuales en otras divisas	GBP	14 de mayo de 2010	1,75 %	2,25 %	1,93 %
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	27 de mayo de 2016	1,75 %	2,63 %	2,30 %
Clase de acciones "A"	USD	5 de marzo de 2001	1,75 %	2,63 %	2,30 %
Clase de acciones "B"	USD	5 de marzo de 2001	1,75 %	3,63 %	3,30 %
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	31 de julio de 2001	1,75 %	2,75 %	2,42 %
Clase de acciones "G"(c)	USD	8 de diciembre de 2020	0,00 %	0,50 %	
Clase de acciones de acumulación "I"  Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	3 de febrero de 2016 9 de abril de 2018	0,85 %	1,31 %	0,95 %
Clase de acciones de acumulación "I"	SEK USD	7 de marzo de 2018	0,85 % 0,85 %	1,31 % 1,31 %	
Clase de acciones de acumulación 1  Clase de acciones "I"	EUR	22 de marzo de 2018	0,85 %	1,31 %	0,96 %
Clase de acciones "I"	GBP	8 de abril de 2016	0,85 %	1,31 %	
Clase de acciones "I"	USD	6 de julio de 2001	0,85 %	1,31 %	
Clase de acciones de acumulación "IO"	GBP	19 de agosto de 2008	0,00 %	0,46 %	
Clase de acciones de acumulación "IO"(c)	SEK	13 de agosto de 2021	0,00 %	0,46 %	
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	30 de noviembre de 2007	0,00 %	0,46 %	0,11 %
Clase de acciones "IS" (Dis) (estable semestral)	EUR	8 de abril de 2019	0,60 %	0,81 %	
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IX"	USD	4 de septiembre de 2007	1,00 %	1,46 %	1,10 %
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	8 de septiembre de 2008	1,25 %	1,75 %	1,41 %
Clase de acciones "P"	USD	8 de septiembre de 2008	1,25 %	1,75 %	1,41 %
Clase de acciones de acumulación "R"	CHF	12 de agosto de 2016	0,85 %	1,35 %	
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	16 de agosto de 2016	0,85 %	1,35 %	1,03 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	13 de diciembre de 2012	0,85 %	1,35 %	1,03 %
Clase de acciones "R"	GBP	13 de diciembre de 2012	0,85 %	1,35 %	1,03 %
Clase de acciones "R"	USD	13 de diciembre de 2012	0,85 %	1,35 %	1,03 %
Global Environmental Impact Equity Portfolio	USD				
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	14 de febrero de 2020	1,50 %	1,90 %	1,68 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	14 de febrero de 2020	1,50 %	1,90 %	1,70 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas <sup>(c)</sup>	EUR	22 de febrero de 2021	1,50 %	1,90 %	1,69 %
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	14 de febrero de 2020	1,50 %	2,65 %	2,44 %
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	20 de marzo de 2020	0,75 %	1,11 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	GBP	14 de febrero de 2020	0,75 %	1,11 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	14 de febrero de 2020	0,75 %	1,11 %	
Clase de acciones "I"(c)	AUD	16 de marzo de 2021	0,75 %	1,11 %	
Clase de acciones "I"	GBP	14 de febrero de 2020	0,75 %	1,11 %	
Clase de acciones "I"	USD	14 de febrero de 2020	0,75 %	1,11 %	
Clase de acciones "IO"(C)	USD	22 de febrero de 2021	0,00 %	0,36 %	
Clase de acciones de acumulación "P"	GBP	14 de febrero de 2020	1,25 %	1,65 %	1,41 9

	Divisa	Fecha de creación	Porcentaje de comisión de asesoramiento	Límite de gastos <sup>(a)</sup>	Ratio de gastos netos totales <sup>(b)</sup>
Global Environmental Impact Equity Portfolio (continuación)					
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	14 de febrero de 2020	1,25 %	1,65 %	1,42 %
Clase de acciones "P"	GBP	14 de febrero de 2020	1,25 %	1,65 %	1,41 %
Clase de acciones "P"	USD	14 de febrero de 2020	1,25 %	1,65 %	
Clase de acciones de acumulación "R"	GBP	14 de febrero de 2020	0,75 %	1,15 %	
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	14 de febrero de 2020	0,75 %	1,15 %	
Clase de acciones "R"	GBP	14 de febrero de 2020	0,75 %	1,15 %	
Clase de acciones "R"	USD	14 de febrero de 2020	0,75 %	1,15 %	0,94 %
Global Equity Income Portfolio  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD USD	14 do noviembro do 2005	1 50 0/	1 00 %	1 00 0/
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	14 de noviembre de 2005 4 de diciembre de 1992	1,50 % 1,50 %	1,90 % 1,90 %	1,90 % 1,90 %
Clase de acciones "A"	USD	5 de marzo de 2001	1,50 %	2,40 %	
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	31 de julio de 2001	1,50 %	2,65 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	26 de octubre de 2007	0,65 %	1,01 %	
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	8 de septiembre de 2008	1,25 %	1,65 %	
Clase de acciones "P"	USD	8 de septiembre de 2008	1,25 %	1,65 %	
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "R"	USD	2 de enero de 2019	0,65 %	1,05 %	1,05 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	13 de diciembre de 2012	0,65 %	1,05 %	1,05 %
Clase de acciones "R"	GBP	13 de diciembre de 2012	0,65 %	1,05 %	1,05 %
Clase de acciones "R"	USD	13 de diciembre de 2012	0,65 %	1,05 %	1,05 %
Global Equity Partners ESG Portfolio	USD				
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	16 de septiembre de 2008	1,50 %	1,75 %	1,75 %
Clase de acciones en otras divisas	GBP	14 de mayo de 2010	1,50 %	1,75 %	
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	16 de septiembre de 2008	1,50 %	2,25 %	
Clase de acciones "A"	USD	16 de septiembre de 2008	1,50 %	2,25 %	
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	16 de septiembre de 2008	1,50 %	2,25 %	
Clase de acciones "E"	EUR	16 de septiembre de 2008	1,50 %	2,25 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	16 de septiembre de 2008	0,75 %	0,96 %	
Clase de acciones de acumulación "P"	EUR	16 de septiembre de 2008	1,25 %	1,50 %	
Clase de acciones de acumulación "P" Clase de acciones "P"	USD EUR	16 de septiembre de 2008	1,25 %	1,50 %	1,50 % 1,50 %
Clase de acciones "P"	USD	16 de septiembre de 2008 16 de septiembre de 2008	1,25 % 1,25 %	1,50 %	1,50 %
Clase de acciones "R"	USD	3 de diciembre de 2012	0,75 %	1,50 % 1,00 %	1,00 %
Global Equity Partners Portfolio	USD	3 de diciembre de 2012	0,73 70	1,00 /0	1,00 /0
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	23 de febrero de 2006	1,50 %	1,90 %	1,65 %
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)	USD	10 de abril de 2015	1,50 %	1,90 %	
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	25 de julio de 2007	1,50 %	1,90 %	
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)	USD	10 de abril de 2015	1,50 %	1,90 %	1,65 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	23 de febrero de 2006	1,50 %	1,90 %	1,65 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	GBP	3 de julio de 2006	1,50 %	1,90 %	1,65 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	10 de abril de 2015	1,50 %	1,90 %	
Clase de acciones en otras divisas	GBP	3 de julio de 2006	1,50 %	1,90 %	1,65 %
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	10 de abril de 2015	1,50 %	1,90 %	1,65 %
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	17 de abril de 2009	1,50 %	2,40 %	2,15 %
Clase de acciones "A"	USD	17 de abril de 2009	1,50 %	2,40 %	
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR EUR	17 de abril de 2009	1,50 %	2,65 %	
Clase de acciones de acumulación "l" Clase de acciones de acumulación "l"	USD	13 de diciembre de 2011 25 de octubre de 2013	0,75 % 0,75 %	1,11 % 1,11 %	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	15 de marzo de 2018	0,75 %	1,11 %	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en LON)	USD	20 de enero de 2017	0,75 %	1,11 %	0,83 %
Clase de acciones "I"	GBP	14 de noviembre de 2013	0,75 %	1,11 %	
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en USD)	USD	20 de enero de 2017	0,75 %	1,11 %	
Clase de acciones de acumulación "IO"	GBP	5 de junio de 2013	0,00 %	0,36 %	
Clase de acciones de acumulación "IO"(c)	SEK	13 de agosto de 2021	0,00 %	0,36 %	
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	2 de enero de 2013	0,00 %	0,36 %	
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD)	USD	20 de marzo de 2015	0,00 %	0,36 %	
Clase de acciones "IO"	USD	30 de junio de 2014	0,00 %	0,36 %	0,08 %
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	17 de abril de 2009	1,25 %	1,65 %	
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD)	USD	20 de enero de 2017	1,25 %	1,65 %	
Clase de acciones "P"	USD	17 de abril de 2009	1,25 %	1,65 %	
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en USD)	USD	20 de enero de 2017	1,25 %	1,65 %	
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	16 de octubre de 2015	0,75 %	1,15 %	
Clase de acciones de acumulación "R"	GBP	16 de octubre de 2015	0,75 %	1,15 %	
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	13 de diciembre de 2012	0,75 %	1,15 %	
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	16 de octubre de 2015	0,75 %	1,15 %	
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones "R"	USD GBP	16 de octubre de 2015	0,75 %	1,15 %	
Clase de acciones "R"	USD	13 de diciembre de 2012 13 de diciembre de 2012	0,75 % 0,75 %	1,15 % 1,15 %	
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	16 de octubre de 2015	0,75 %	1,15 %	
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD)	USD	16 de octubre de 2015	0,75 %	1,15 %	0,90 %
Global Future Health Care Equity Portfolio	USD	TO de octable de 2013	0,75 70	1,10 /0	0,30 /0
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	30 de septiembre de 2020	1,50 %	1,90 %	1,74 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	30 de septiembre de 2020	1,50 %	1,90 %	
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	6 de noviembre de 2020	1,50 %	2,40 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	26 de octubre de 2020	0,75 %	1,11 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	30 de septiembre de 2020	0,75 %	1,11 %	
Clase de acciones "I"	USD	30 de septiembre de 2020	0,75 %	1,11 %	
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	30 de septiembre de 2020	1,25 %	1,65 %	
Clase de acciones "P"	USD	30 de septiembre de 2020	1,25 %	1,65 %	
Clase de acciones de acumulación "R"	GBP	30 de septiembre de 2020	0,75 %	1,15 %	
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	30 de septiembre de 2020	0,75 %	1,15 %	1,00 %
Olass de assistant IIDII	GBP	30 de septiembre de 2020	0,75 %	1,15 %	1,00 %
Clase de acciones "R"			0,75 %		

	Divisa	Fecha de creación	Porcentaje de comisión de asesoramiento	Límite de gastos <sup>(a)</sup>	Ratio de gastos netos totales <sup>(b)</sup>
Global Future Technology Leaders Equity Portfolio	USD				
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	25 de febrero de 2020	1,50 %	1,90 %	1,64 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	25 de febrero de 2020	1,50 %	1,90 %	1,62 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	25 de febrero de 2020	1,50 %	1,90 %	1,64 %
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	25 de febrero de 2020	1,50 %	2,65 %	2,39 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	25 de febrero de 2020	0,75 %	1,11 %	0,81 %
Clase de acciones "I"(c)	GBP	6 de abril de 2021	0,75 %	1,11 %	0,81 %
Clase de acciones "I"	USD	25 de febrero de 2020	0,75 %	1,11 %	0,81 %
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	25 de febrero de 2020	0,00 %	0,36 %	0,06 %
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	19 de marzo de 2020	1,25 %	1,65 %	1,36 %
Clase de acciones "P"	USD	19 de marzo de 2020	1,25 %	1,65 %	1,36 %
Clase de acciones de acumulación "R"	GBP USD	25 de febrero de 2020	0,75 %	1,15 %	0,90 %
Clase de acciones de acumulación "R" <sup>(c)</sup> Clase de acciones "R"	EUR	18 de diciembre de 2020	0,75 %	1,15 % 1,15 %	0,89 % 0.89 %
Clase de acciones "R"	GBP	26 de junio de 2020 25 de febrero de 2020	0,75 % 0,75 %	1,15 %	0,88 %
Clase de acciones "R"	USD	26 de junio de 2020	0,75 %	1,15 %	0,88 %
Global Millennials Equity Portfolio	USD	20 de junio de 2020	0,75 /6	1,15 /6	0,09 /0
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	19 de septiembre de 2012	1,50 %	1,90 %	1,66 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	4 de enero de 2016	1,50 %	1,90 %	1,66 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	27 de enero de 2020	1,50 %	1,90 %	1,66 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	HKD	27 de noviembre de 2020	1,50 %	1,90 %	1,66 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	SGD	27 de noviembre de 2020	1,50 %	1,90 %	1,67 %
Clase de acciones en otras divisas	EUR	21 de junio de 2019	1,50 %	1,90 %	1,65 %
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	31 de octubre de 2018	1,50 %	2,65 %	2,41 %
Clase de acciones "E"	EUR	13 de enero de 2016	1,50 %	2,65 %	2,41 %
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	17 de mayo de 2018	0,75 %	1,11 %	0,84 %
Clase de acciones de acumulación "I"	GBP	13 de enero de 2016	0,75 %	1,11 %	0,84 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	19 de septiembre de 2012	0,75 %	1,11 %	0,84 %
Clase de acciones "I"	GBP	13 de enero de 2016	0,75 %	1,11 %	0,83 %
Clase de acciones "I"	USD	4 de enero de 2016	0,75 %	1,11 %	0,83 %
Clase de acciones "IO"	USD	31 de julio de 2020	0,00 %	0,36 %	0,09 %
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	4 de enero de 2016	1,25 %	1,65 %	1,39 %
Clase de acciones "P"	USD	4 de enero de 2016	1,25 %	1,65 %	1,39 %
Clase de acciones de acumulación "R"	GBP	13 de enero de 2016	0,75 %	1,15 %	0,91 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	3 de diciembre de 2012	0,75 %	1,15 %	0,91 %
Clase de acciones "R"	GBP	4 de enero de 2016	0,75 %	1,15 %	0,91 %
Clase de acciones "R"	USD	3 de diciembre de 2012	0,75 %	1,15 %	0,91 %
India Equity Portfolio	USD				
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	26 de marzo de 2008	1,75 %	2,25 %	1,95 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	26 de marzo de 2008	1,75 %	2,25 %	1,95 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	SEK	23 de febrero de 2015	1,75 %	2,25 %	1,95 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	SGD	16 de agosto de 2019	1,75 %	2,25 %	1,97 %
Clase de acciones en otras divisas	GBP	14 de mayo de 2010	1,75 %	2,25 %	1,96 %
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	25 de mayo de 2016	1,75 %	2,75 %	2,46 %
Clase de acciones "A"	USD EUR	26 de marzo de 2008	1,75 %	2,75 %	2,45 % 2,45 %
Clase de acciones de acumulación "E"  Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	26 de marzo de 2008	1,75 %	2,75 %	2,45 % 0,98 %
Clase de acciones de acumulación "l"	USD	12 de junio de 2015 26 de marzo de 2008	0,85 % 0,85 %	1,31 % 1,31 %	0,98 %
Clase de acciones "I"	GBP	11 de agosto de 2015	0,85 %	1,31 %	0,98 %
Clase de acciones "I"	USD	26 de marzo de 2008	0,85 %	1.31 %	0,98 %
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	23 de julio de 2015	0,00 %	0,46 %	0,13 %
Clase de acciones de acumulación "P"	EUR	12 de junio de 2015	1,25 %	1,75 %	1,42 %
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	8 de septiembre de 2008	1,25 %	1,75 %	1,43 %
Clase de acciones "P"	USD	8 de septiembre de 2008	1,25 %	1,75 %	1.43 %
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	20 de octubre de 2015	0,85 %	1,35 %	1,05 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	3 de diciembre de 2012	0,85 %	1,35 %	1,05 %
Clase de acciones "R"	GBP	10 de diciembre de 2012	0,85 %	1,35 %	1,05 %
Clase de acciones "R"	USD	3 de diciembre de 2012	0,85 %	1,35 %	1,05 %
Japan Equity Partners Portfolio	JPY				
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	JPY	27 de mayo de 2015	1,50 %	1,90 %	1,65 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	30 de septiembre de 2020	1,50 %	1,90 %	1,66 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas <sup>(c)</sup>	USD	24 de noviembre de 2021	1,50 %	1,90 %	1,90 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF)	CHF	27 de mayo de 2015	1,50 %	1,90 %	1,65 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	27 de mayo de 2015	1,50 %	1,90 %	1,65 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en USD)(c)	USD	24 de noviembre de 2021	1,50 %	1,90 %	1,90 %
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	JPY	1 de agosto de 2016	0,75 %	1,11 %	0,83 %
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	29 de junio de 2018	0,75 %	1,11 %	0,83 %
Clase de acciones de acumulación "I"	GBP	27 de mayo de 2015	0,75 %	1,11 %	0,83 %
Clase de acciones de acumulación "I"	JPY	27 de mayo de 2015	0,75 %	1,11 %	0,83 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	27 de mayo de 2015	0,75 %	1,11 %	0,83 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	27 de mayo de 2015	0,75 %	1,11 %	0,83 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)	USD	14 de marzo de 2016	0,75 %	1,11 %	0,83 %
Clase de acciones "I"	GBP	7 de diciembre de 2017	0,75 %	1,11 %	0,83 %
Clase de acciones de acumulación "IO"	JPY	20 de agosto de 2020	0,00 %	0,36 %	0,08 %
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	16 de septiembre de 2020	0,00 %	0,36 %	0,08 %
Clase de acciones de acumulación "P"	JPY	14 de marzo de 2016	1,25 %	1,65 %	1,38 %
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD)	USD	14 de marzo de 2016	1,25 %	1,65 %	1,38 %
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)	GBP	12 de octubre de 2016	1,25 %	1,65 %	1,38 %
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en USD)	USD	10 de agosto de 2018	1,25 %	1,65 %	1,38 %
Clase de acciones de acumulación "R"	JPY	27 de mayo de 2015	0,75 %	1,15 %	0,90 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	27 de mayo de 2015	0,75 %	1,15 %	0,90 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	27 de mayo de 2015	0,75 %	1,15 %	0,90 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en USD)	USD	18 de diciembre de 2017	0,75 %	1,15 %	0,90 %

	Divisa	Fecha de creación	Porcentaje de comisión de asesoramiento	Límite de gastos <sup>(a)</sup>	Ratio de gastos netos totales <sup>(b)</sup>
Japan Equity Partners Portfolio (continuación)					
Clase de acciones "R"	GBP	18 de noviembre de 2020	0,75 %	1,15 %	0,90 %
Clase de acciones "R" <sup>(c)</sup> Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	JPY GBP	4 de diciembre de 2020 11 de noviembre de 2015	0,75 % 0,75 %	1,15 % 1,15 %	
Japan Equity Portfolio	JPY	TT de Hoviembre de 2015	0,75 70	1,13 /0	0,30 /0
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	JPY	14 de noviembre de 2005	1,50 %	1,90 %	1,67 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	JPY	30 de abril de 1996	1,50 %	1,90 %	1,67 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK)	EUR SEK	26 de abril de 2011 12 de junio de 2013	1,50 % 1,50 %	1,90 % 1,90 %	1,67 % 1,67 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en USD)	USD	2 de mayo de 2013	1,50 %	1,90 %	
Clase de acciones en otras divisas	GBP	14 de mayo de 2010	1,50 %	1,90 %	1,68 %
Clase de acciones en otras divisas	USD	21 de enero de 2002	1,50 %	1,90 %	1,67 %
Clase de acciones "A" Clase de acciones "B"	USD USD	5 de marzo de 2001 5 de marzo de 2001	1,50 % 1,50 %	2,40 % 3,40 %	
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	31 de julio de 2001	1,50 %	2,65 %	
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	17 de mayo de 2013	1,50 %	2,65 %	
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	JPY	1 de junio de 2016	0,65 %	1,01 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	JPY	31 de octubre de 2007	0,65 %	1,01 %	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)	EUR USD	5 de abril de 2013 16 de agosto de 2013	0,65 % 0,65 %	1,01 % 1,01 %	0,75 % 0,75 %
Clase de acciones "I"	JPY	13 de noviembre de 2001	0,65 %	1,01 %	
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	26 de agosto de 2016	0,65 %	1,01 %	0,75 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "IS"(c)	EUR	18 de marzo de 2021	0,52 %	0,88 %	
Clase de acciones puntuales de acumulación "IS" (Clase de acciones puntuales de acumulación "IS" (Clase cubierta en EUR) (C)	JPY EUR	30 de diciembre de 2020	0,52 %	0,88 %	
Clase de acciones puntuales de acumulación "IS" (Clase cubierta en EUR)(9)  Clase de acciones de acumulación "P"	JPY	30 de diciembre de 2020 8 de septiembre de 2008	0,52 % 1,25 %	0,88 % 1,65 %	1,40 %
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD)	USD	2 de mayo de 2013	1,25 %	1,65 %	
Clase de acciones "P"	JPY	8 de septiembre de 2008	1,25 %	1,65 %	1,40 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "R"	JPY	3 de diciembre de 2012	0,65 %	1,05 %	
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones puntuales "R"	GBP GBP	26 de agosto de 2016 10 de diciembre de 2012	0,65 % 0,65 %	1,05 % 1,05 %	
Clase de acciones puntuales "R"	JPY	3 de diciembre de 2012	0,65 %	1,05 %	
Clase de acciones puntuales "R"	USD	23 de febrero de 2018	0,65 %	1,05 %	
Clase de acciones puntuales de acumulación "RS" (Clase cubierta en EUR)(c)	EUR	30 de julio de 2021	0,52 %	0,88 %	0,72 %
US Equity Portfolio	USD	2 de febrero de 2006	4.50.0/	1.00.0/	1.66.0/
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	3 de febrero de 2006 3 de febrero de 2006	1,50 % 1,50 %	1,90 % 1,90 %	1,66 % 1,66 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	29 de noviembre de 2010	1,50 %	1,90 %	1,66 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	17 de junio de 2009	1,50 %	1,90 %	1,66 %
Clase de acciones en otras divisas	GBP	14 de mayo de 2010	1,50 %	1,90 %	1,66 %
Clase de acciones en otras divisas Clase de acciones "A"	SGD USD	21 de junio de 2011 3 de febrero de 2006	1,50 % 1,50 %	1,90 % 2,40 %	1,66 % 2,16 %
Clase de acciones A  Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	3 de febrero de 2006	1,50 %	2,40 %	
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	6 de julio de 2010	1,50 %	2,65 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	19 de junio de 2015	0,75 %	1,11 %	0,84 %
Clase de acciones de acumulación "I"  Clase de acciones "I"	USD GBP	26 de octubre de 2007 27 de septiembre de 2010	0,75 % 0,75 %	1,11 % 1,11 %	
Clase de acciones "I"	USD	11 de junio de 2010	0,75 %	1,11 %	
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	8 de junio de 2011	0,00 %	0,36 %	
Clase de acciones "IS"	GBP	31 de julio de 2018	0,45 %	0,81 %	0,54 %
Clase de acciones de acumulación "P"  Clase de acciones "P"	USD	8 de septiembre de 2008	1,25 %	1,65 %	
Clase de acciones P  Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	8 de septiembre de 2008 10 de diciembre de 2012	1,25 % 0,75 %	1,65 % 1,15 %	
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	13 de diciembre de 2012	0,75 %	1,15 %	
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	5 de diciembre de 2012	0,75 %	1,15 %	
Clase de acciones "R"	GBP	10 de diciembre de 2012	0,75 %	1,15 %	0,91 %
Clase de acciones "R"  US Focused Growth Equity Portfolio	USD USD	10 de diciembre de 2012	0,75 %	1,15 %	0,91 %
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	14 de noviembre de 2005	1,50 %	1,90 %	1,90 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	15 de noviembre de 1999	1,50 %	1,90 %	1,90 %
Clase de acciones "A"	USD	5 de marzo de 2001	1,50 %	2,40 %	
Clase de acciones "B"  Clase de acciones de acumulación "E"	USD EUR	5 de marzo de 2001 10 de enero de 2005	1,50 % 1,50 %	3,40 % 2,65 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	26 de octubre de 2007	0,75 %	1,11 %	
Clase de acciones "I"	USD	6 de julio de 2001	0,75 %	1,11 %	
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	8 de septiembre de 2008	1,25 %	1,65 %	
Clase de acciones "P"	USD	8 de septiembre de 2008	1,25 %	1,65 %	
Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones "R"	USD GBP	13 de diciembre de 2012 10 de diciembre de 2012	0,75 % 0,75 %	1,15 % 1,15 %	
Clase de acciones "R"	USD	13 de diciembre de 2012	0,75 %	1,15 %	
US Small Cap Equity Portfolio(c)	USD				
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	15 de junio de 2018	1,50 %	1,90 %	
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación "E"	USD EUR	15 de junio de 2018 15 de junio de 2018	1,50 %	1,90 % 2,65 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	15 de junio de 2018 15 de junio de 2018	1,50 % 0,75 %	2,65 % 1,11 %	
Clase de acciones "I"	USD	15 de junio de 2018	0,75 %	1,11 %	
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	15 de junio de 2018	1,25 %	1,65 %	1,65 %
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	21 de agosto de 2018	1,25 %	1,65 %	
Clase de acciones "P"	USD	15 de junio de 2018	1,25 %	1,65 %	
Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	15 de junio de 2018 11 de julio de 2018	0,75 % 0,75 %	1,15 % 1,15 %	
Clase de acciones "R"	GBP	11 de marzo de 2019	0,75 %	1,15 %	
Clase de acciones "R"	USD	15 de junio de 2018	0,75 %	1,15 %	

	Divisa	Fecha de creación	Porcentaje de comisión de asesoramiento	Límite de gastos <sup>(a)</sup>	Ratio de gastos netos totales <sup>(b)</sup>
US Technology Opportunities Equity Portfolio	USD				
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	30 de octubre de 2020	1,50 %	1,90 %	1,71 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	30 de octubre de 2020	1,50 %	1,90 %	1,71 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	30 de octubre de 2020	1,50 %	1,90 %	1,71 %
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	30 de octubre de 2020	1,50 %	2,40 %	2,21 %
Clase de acciones de acumulación "I"	GBP	30 de octubre de 2020	0,75 %	1,11 %	0,89 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	30 de octubre de 2020	0,75 %	1,11 %	0,88 %
Clase de acciones "I"	USD	30 de octubre de 2020 30 de octubre de 2020	0,75 %	1,11 %	0,88 %
Clase de acciones de acumulación "IO" Clase de acciones de acumulación "P"	USD		0,00 %	0,36 %	0,14 %
Clase de acciones de acumulación "R"	GBP	30 de octubre de 2020 30 de octubre de 2020	1,25 % 0,75 %	1,65 % 1,15 %	1,44 % 0,96 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	30 de octubre de 2020	0,75 %	1,15 %	0,98 %
Clase de acciones "R"	USD	30 de octubre de 2020	0,75 %	1,15 %	0,96 %
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio <sup>(c)</sup>	USD	oo de oolabie de 2020	0,70 70	1,10 70	0,00 70
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia <sup>(c)</sup>	USD	19 de octubre de 2021	1,50 %	1,90 %	1,90 %
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia <sup>(c)</sup>	USD	19 de octubre de 2021	1,50 %	1,90 %	1,90 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia <sup>(c)</sup>	USD	19 de octubre de 2021	1,50 %	1,90 %	1,90 %
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis)(c)	HKD	19 de octubre de 2021	1,50 %	1,90 %	1,90 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas <sup>(c)</sup>	EUR	19 de octubre de 2021	1,50 %	1,90 %	1,90 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas <sup>(c)</sup>	HKD	19 de octubre de 2021	1,50 %	1,90 %	1,90 %
Clase de acciones de acumulación "E"(c)	EUR	19 de octubre de 2021	1,50 %	2,65 %	2,65 %
Clase de acciones "I SD"(c)	USD	23 de noviembre de 2021	0,45 %	0,81 %	0,81 %
Clase de acciones de acumulación "l"(c)	EUR	19 de octubre de 2021	0,75 %	1,11 %	1,11 %
Clase de acciones de acumulación "I"(c)	USD	19 de octubre de 2021	0,75 %	1,11 %	1,11 %
Clase de acciones "I"(c)	GBP	19 de octubre de 2021	0,75 %	1,11 %	1,11 %
Clase de acciones "I"(c)	USD	19 de octubre de 2021	0,75 %	1,11 %	1,11 %
Clase de acciones de acumulación "P"(c)	USD	19 de octubre de 2021	1,25 %	1,65 %	1,65 %
Clase de acciones "P"(c)	USD	19 de octubre de 2021	1,25 %	1,65 %	1,65 %
Clase de acciones de acumulación "R"(c)	EUR	19 de octubre de 2021	0,75 %	1,15 %	1,15 %
Clase de acciones de acumulación "R"(C)	USD	19 de octubre de 2021	0,75 %	1,15 %	1,15 %
Clase de acciones "R"(c)	EUR	19 de octubre de 2021	0,75 %	1,15 %	1,15 %
Clase de acciones "R"(c)	GBP	19 de octubre de 2021	0,75 %	1,15 %	1,15 %
Clase de acciones "R"(c)	USD	19 de octubre de 2021	0,75 %	1,15 %	1,15 %
Global Infrastructure Equity Portfolio	USD	0 de diciembre de 0040	4.50.0/	4.00.0/	4.00.0/
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) denominada en la divisa de referencia <sup>(c)</sup>	USD	2 de diciembre de 2016	1,50 %	1,90 % 1,90 %	1,90 % 1,90 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	2 de diciembre de 2016 2 de diciembre de 2016	1,50 % 1,50 %	1,90 %	1,90 %
Clase de acciones en otras divisas (bruta trimestral) (Dis) <sup>(c)</sup>	EUR	2 de diciembre de 2016	1,50 %	1,90 %	1,90 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	2 de diciembre de 2016	1,50 %	1,90 %	1,90 %
Clase de acciones en otras divisas	EUR	2 de diciembre de 2016	1,50 %	1,90 %	1,90 %
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "E"	EUR	21 de diciembre de 2016	1,50 %	2,65 %	2,65 %
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	21 de diciembre de 2016	1,50 %	2,65 %	2,65 %
Clase de acciones "E"	EUR	21 de diciembre de 2016	1,50 %	2,65 %	2,65 %
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "I"(c)	GBP	23 de diciembre de 2016	0,75 %	1,11 %	1,10 %
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "I"(c)	USD	2 de diciembre de 2016	0,75 %	1,11 %	1,11 %
Clase de acciones de acumulación "I"	GBP	23 de diciembre de 2016	0,75 %	1,11 %	1,11 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	2 de diciembre de 2016	0,75 %	1,11 %	1,11 %
Clase de acciones "I"	GBP	23 de diciembre de 2016	0,75 %	1,11 %	1,11 %
Clase de acciones "I"	USD	2 de diciembre de 2016	0,75 %	1,11 %	1,11 %
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "P"	USD	2 de diciembre de 2016	1,25 %	1,61 %	1,61 %
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	2 de diciembre de 2016	1,25 %	1,61 %	1,61 %
Clase de acciones "P"	USD	2 de diciembre de 2016	1,25 %	1,61 %	1,61 %
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "R"(c)	GBP	23 de diciembre de 2016	0,75 %	1,15 %	1,12 %
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "R"(c) Clase de acciones de acumulación "R"	USD GBP	2 de diciembre de 2016 23 de diciembre de 2016	0,75 %	1,15 %	1,15 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	2 de diciembre de 2016	0,75 % 0,75 %	1,15 % 1,15 %	1,15 % 1,15 %
Clase de acciones de acumulación 1000 Clase de acciones "R"	GBP	23 de diciembre de 2016	0,75 %	1,15 %	1,15 %
Clase de acciones "R"	USD	2 de diciembre de 2016	0,75 %	1,15 %	1,15 %
Global Real Estate Equity Portfolio	USD	2 de dioiembre de 2010	0,70 70	1,10 70	1,10 /0
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	2 de diciembre de 2016	1,50 %	1,90 %	1,90 %
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	2 de diciembre de 2016	1,50 %	1,90 %	1,90 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	2 de diciembre de 2016	1,50 %	1,90 %	1,90 %
Clase de acciones en otras divisas (bruta trimestral) (Dis) <sup>(c)</sup>	EUR	2 de diciembre de 2016	1,50 %	1,90 %	1,89 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	2 de diciembre de 2016	1,50 %	1,90 %	1,90 %
Clase de acciones en otras divisas <sup>(c)</sup>	EUR	2 de diciembre de 2016	1,50 %	1,90 %	1,89 %
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "E"	EUR	21 de diciembre de 2016	1,50 %	2,65 %	2,65 %
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	21 de diciembre de 2016	1,50 %	2,65 %	2,65 %
Clase de acciones "E"	EUR	21 de diciembre de 2016	1,50 %	2,65 %	2,65 %
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "I"(c)	GBP	23 de diciembre de 2016	0,75 %	1,11 %	1,10 %
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "I"	USD	2 de diciembre de 2016	0,75 %	1,11 %	1,11 %
Clase de acciones de acumulación "I"(c)	GBP	23 de diciembre de 2016	0,75 %	1,11 %	1,10 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	2 de diciembre de 2016	0,75 %	1,11 %	1,11 %
Clase de acciones "I"(c)	GBP	23 de diciembre de 2016	0,75 %	1,11 %	1,10 %
Clase de acciones "I"	USD	2 de diciembre de 2016	0,75 %	1,11 %	1,11 %
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "P"	USD	9 de enero de 2017	1,25 %	1,61 %	1,61 %
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	9 de enero de 2017	1,25 %	1,61 %	1,61 %
Clase de acciones "P"	USD	9 de enero de 2017	1,25 %	1,61 %	1,61 %
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "R"	GBP	23 de diciembre de 2016	0,75 %	1,15 %	1,15 %
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "R"(c) Clase de acciones de acumulación "R"(c)	USD	2 de diciembre de 2016	0,75 %	1,15 %	1,14 %
	GBP	23 de diciembre de 2016	0,75 %	1,15 %	1,14 %
	Hen	2 de diciembre de 2016		1 1 5 0/	
Clase de acciones de acumulación "R"  Clase de acciones "R"(c)	USD GBP	2 de diciembre de 2016 23 de diciembre de 2016	0,75 % 0,75 %	1,15 % 1,15 %	1,15 % 1,14 %

	Divisa	Fecha de creación	Porcentaje de comisión de asesoramiento	Límite de gastos <sup>(a)</sup>	Ratio o gasto neto totales
North America Energy & Energy Infrastructure Equity Portfolio	USD			<b>J</b>	
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	14 de abril de 2014	1,50 %	1,90 %	1,90
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	14 de abril de 2014	1,50 %	1,90 %	1,90
Clase de acciones "A"	USD	26 de mayo de 2017	1,50 %	2,40 %	2,40
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	14 de abril de 2014	1,50 %	2,65 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	14 de abril de 2014	0,75 %	1,11 %	
Clase de acciones "I"	USD	14 de abril de 2014	0,75 %	1,11 %	
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	23 de mayo de 2014	1,25 %	1,61 %	
Clase de acciones "P"	USD	23 de mayo de 2014	1,25 %	1,61 %	
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	20 de octubre de 2015	0,75 %	1,15 %	
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	14 de abril de 2014	0,75 %	1,15 %	
Clase de acciones "R"	USD	14 de abril de 2014	0,75 %	1,15 %	1,15
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	USD USD	10 de escata da 2000	4.25.0/	4.75.0/	1 50
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en la divisa de referencia	USD	10 de agosto de 2009 1 de diciembre de 2017	1,35 %	1,75 % 1,75 %	1,53 1,52
Clase de acciones puntuales de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones puntuales denominada en la divisa de referencia	USD	28 de abril de 2017	1,35 % 1,35 %	1,75 %	1,52
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas	EUR	30 de enero de 2017	1,35 %	1,75 %	1,52
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas (Long Emerging Markets	LUIX	30 de elleio de 2017	1,55 /6	1,75 /0	1,55
CCY vs USD)	CHF	4 de abril de 2018	1,35 %	1,75 %	1,53
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas (Long Emerging Markets	EUD	07 do obril do 2010	4.25.0/	4.75.0/	4 50
CCY vs USD)	EUR PLN	27 de abril de 2018	1,35 % 1,35 %	1,75 % 2,25 %	1,53 2,02
Clase de acciones puntuales de acumulación "A" (Long Emerging Markets CCY vs. USD)		2 de mayo de 2019			
Clase de acciones puntuales "A"(c) Clase de acciones de acumulación "E" al cierre	USD EUR	8 de enero de 2021 7 de agosto de 2017	1,35 % 1,35 %	2,25 % 2,50 %	
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	EUR	8 de enero de 2018	0.65 %	2,50 % 1.01 %	
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	USD	10 de agosto de 2009	0,65 %	1,01 %	
Clase de acciones puntuales de acumulación "I"	GBP	2 de mayo de 2019	0,65 %	1,01 %	
Clase de acciones "I" al cierre	EUR	9 de mayo de 2018	0,65 %	1,01 %	
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	GBP	8 de julio de 2011	0,00 %	0,36 %	
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	JPY	4 de marzo de 2019	0,00 %	0,36 %	
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	USD	10 de agosto de 2009	0,00 %	0.36 %	
Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"(c)	JPY	23 de marzo de 2021	0,00 %	0,36 %	
Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"	USD	12 de diciembre de 2017	0,00 %	0,36 %	
Clase de acciones puntuales "IO"	USD	14 de junio de 2017	0,00 %	0,36 %	
Clase de acciones de acumulación "P" al cierre	USD	19 de noviembre de 2012	0,80 %	1,20 %	
Clase de acciones "P" al cierre	USD	19 de noviembre de 2012	0,80 %	1,20 %	
Clase de acciones de acumulación "R" al cierre	USD	3 de diciembre de 2012	0,65 %	1,05 %	
Clase de acciones de acumulación "R" al cierre (Long Emerging Markets CCY vs. USD)	EUR	4 de abril de 2018	0,65 %	1,05 %	
Clase de acciones "R" al cierre	GBP	10 de diciembre de 2012	0,65 %	1,05 %	
Clase de acciones "R" al cierre	USD	3 de diciembre de 2012	0,65 %	1,05 %	
Europe CORE® Equity Portfolio	EUR		,	-	
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	EUR	14 de noviembre de 2005	1,25 %	1,50 %	1,41
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	EUR	1 de octubre de 1999	1,25 %	1,50 %	1,41
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	USD	27 de abril de 2017	1,25 %	1,50 %	1,41
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en USD)	USD	8 de junio de 2018	1,25 %	1,50 %	1,41
Clase de acciones en otras divisas	GBP	4 de mayo de 2017	1,25 %	1,50 %	1,42
Clase de acciones en otras divisas	USD	13 de abril de 2017	1,25 %	1,50 %	
Clase de acciones de acumulación "A"	EUR	4 de mayo de 2017	1,25 %	2,00 %	
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	7 de agosto de 2017	1,25 %	2,00 %	
Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)	PLN	2 de mayo de 2019	1,25 %	2,00 %	1,91
Clase de acciones "A"	EUR	5 de marzo de 2001	1,25 %	2,00 %	
Clase de acciones "A"	USD	31 de octubre de 2006	1,25 %	2,00 %	
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	10 de enero de 2005	1,25 %	2,00 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	CHF	4 de enero de 2018	0,50 %	0,71 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	5 de septiembre de 2006	0,50 %	0,71 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	4 de mayo de 2017	0,50 %	0,71 %	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF)	CHF	12 de marzo de 2018	0,50 %	0,71 %	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	25 de julio de 2018	0,50 %	0,71 %	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)	USD	19 de marzo de 2018	0,50 %	0,71 %	
Clase de acciones "I" Clase de acciones de accumulación "IO"	EUR EUR	28 de octubre de 2002 10 de diciembre de 2007	0,50 % 0,00 %	0,71 % 0,21 %	
Clase de acciones de acumulación "IO" (Long European CCY vs. EUR)	SGD	26 de abril de 2019	0,00 %	0,21 %	
Clase de acciones de acumulación "IO" (Long European CCY vs. EUR)  Clase de acciones de acumulación "IS"(c)	EUR	18 de diciembre de 2020	0,00 %	0,21 %	
Clase de acciones de acumulación "P"	EUR	11 de junio de 2007	1,00 %	1,25 %	
Clase de acciones "P"	EUR	4 de mayo de 2007	1,00 %	1,25 %	
Clase de acciones "P"	GBP	4 de mayo de 2017 4 de mayo de 2017	1,00 %	1,25 %	
Clase de acciones "P"	USD	8 de mayo de 2017	1,00 %	1,25 %	
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	10 de diciembre de 2012	0,50 %	0,75 %	
Clase de acciones "R"	EUR	3 de diciembre de 2012	0,50 %	0,75 %	
Clase de acciones "R"	GBP	3 de diciembre de 2012	0,50 %	0,75 %	0,6
Clase de acciones "R"	USD	4 de mayo de 2017	0,50 %	0,75 %	
Eurozone CORE® Equity Portfolio <sup>(c)</sup>	EUR		0,00 /0	-, 70	3,30
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia <sup>(c)</sup>	EUR	15 de julio de 2021	1,15 %	1,40 %	1,40
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia <sup>(c)</sup>	EUR	15 de julio de 2021	1,15 %	1,40 %	
Clase de acciones de acumulación en otras divisas <sup>(c)</sup>	USD	15 de julio de 2021	1,15 %	1,40 %	
Clase de acciones de acumulación "E"(c)	EUR	15 de julio de 2021	1,15 %	1,90 %	
Clase de acciones de acumulación "l"(c)	EUR	15 de julio de 2021	0,45 %	0,66 %	
Clase de acciones "I"(c)	EUR	15 de julio de 2021	0,45 %	0,66 %	
Clase de acciones de acumulación "R"(c)	EUR	15 de julio de 2021	0,45 %	0,70 %	
Clase de acciones "R"(c)	EUR	15 de julio de 2021	0,45 %	0,70 %	0,70
Global CORE® Equity Portfolio	USD	, 40 =021	3,40 /0	5,. 5 70	٥,,,
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en la divisa de referencia	USD	21 de noviembre de 2005	1,25 %	1,50 %	1,39
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en la divisa de referencia	USD	14 de noviembre de 2005	1,25 %	1,50 %	
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) al cierre denominada en la divisa de referencia	USD	7 de noviembre de 2018	1,25 %	1,50 %	
	USD	21 de noviembre de 2005	1,25 %	1,50 %	

	Divisa	Fecha de creación	Porcentaje de comisión de asesoramiento	Límite de gastos <sup>(a)</sup>	Ratio de gastos netos totales <sup>(b)</sup>
Global CORE® Equity Portfolio (continuación)				-	
Clase de acciones puntuales denominada en la divisa de referencia	USD	14 de octubre de 2004	1,25 %	1,50 %	1,38 %
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas	HKD	30 de enero de 2019	1,25 %	1,50 %	1,39 %
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas	SGD AUD	13 de febrero de 2018	1,25 % 1,25 %	1,50 % 1,50 %	1,39 % 1,38 %
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas (Clase cubierta en AUD)  Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas (Clase cubierta en SGD)	SGD	30 de enero de 2019 16 de abril de 2018	1,25 %	1,50 %	1,38 %
Clase de acciones puntuales de acumulación en otras divisas	EUR	19 de octubre de 2017	1,25 %	1,50 %	1,38 %
Clase de acciones puntuales de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	22 de agosto de 2019	1,25 %	1,50 %	1,39 %
Clase de acciones puntuales "A"	USD	8 de marzo de 2006	1,25 %	2,00 %	1,88 %
Clase de acciones de acumulación "E" al cierre	EUR	31 de octubre de 2006	1,25 %	2,00 %	1,88 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "E" Clase de acciones puntuales de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR EUR	29 de junio de 2005 5 de marzo de 2018	1,25 % 1,25 %	2,00 % 2,00 %	1,88 % 1,88 %
Clase de acciones puntuales "G"(C)	USD	7 de diciembre de 2020	0,00 %	0,25 %	0,12 %
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	EUR	26 de octubre de 2007	0,50 %	0,71 %	0,56 %
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	USD	31 de enero de 2006	0,50 %	0,71 %	0,56 %
"Clase de acciones de acumulación I" al cierre (Clase cubierta en CHF) "Clase de acciones de acumulación I" al cierre (Clase cubierta en EUR)	CHF EUR	26 de marzo de 2018 26 de febrero de 2018	0,50 % 0,50 %	0,71 % 0,71 %	0,56 % 0,56 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "I"(c)	GBP	7 de diciembre de 2020	0,50 %	0,71 %	0,50 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "I"(c)	SEK	29 de noviembre de 2021	0,50 %	0,71 %	0,71 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "I"	USD	6 de junio de 2019	0,50 %	0,71 %	0,57 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	5 de marzo de 2018	0,50 %	0,71 %	0,56 %
Clase de acciones "I" al cierre Clase de acciones "I" al cierre	GBP USD	23 de diciembre de 2016 10 de julio de 2006	0,50 % 0,50 %	0,71 % 0,71 %	0,56 % 0,56 %
Clase de acciones 1 al cierre  Clase de acciones puntuales "I"	USD	14 de octubre de 2004	0,50 %	0,71 %	0,56 %
Clase de acciones puntuales (mensual) (Dis) (Cap) "IO"	USD	14 de junio de 2019	0,00 %	0,21 %	0,07 %
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	EUR	25 de septiembre de 2008	0,00 %	0,21 %	0,06 %
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre(c)	GBP	19 de agosto de 2008	0,00 %	0,21 %	0,07 %
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"(c)	USD SEK	30 de noviembre de 2007 13 de agosto de 2021	0,00 % 0,00 %	0,21 % 0,21 %	0,06 % 0,07 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"	USD	21 de abril de 2015	0,00 %	0,21 %	0,06 %
Clase de acciones puntuales "IO"	USD	30 de junio de 2014	0,00 %	0,21 %	0,06 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "IS"(c)	EUR	21 de diciembre de 2020	0,40 %	0,61 %	0,47 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "IS"(C)	USD	9 de febrero de 2021	0,40 %	0,61 %	0,46 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "IS" (Clase cubierta en EUR) <sup>(c)</sup> Clase de acciones puntuales de acumulación "P"	EUR USD	21 de diciembre de 2020 11 de junio de 2007	0,40 % 1,00 %	0,61 % 1,25 %	0,47 % 1,11 %
Clase de acciones puntuales de accimilación P	USD	3 de abril de 2009	1,00 %	1,25 %	1,11 %
Clase de acciones de acumulación "R" al cierre (Clase cubierta en CHF)	CHF	28 de agosto de 2018	0,50 %	0,75 %	0,64 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "R"	EUR	19 de octubre de 2017	0,50 %	0,75 %	0,63 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "R"	USD	3 de diciembre de 2012	0,50 %	0,75 %	0,63 %
Clase de acciones "R" al cierre Clase de acciones puntuales "R"	GBP USD	23 de diciembre de 2016 3 de diciembre de 2012	0,50 % 0,50 %	0,75 % 0,75 %	0,63 % 0,64 %
Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	o de dioiembre de 2012	0,00 70	0,10 70	0,01 70
Clase de acciones al cierre denominada en la divisa de referencia	USD	3 de agosto de 2006	1,25 %	1,50 %	1,44 %
Clase de acciones puntuales denominada en la divisa de referencia	USD	3 de agosto de 2006	1,25 %	1,50 %	1,44 %
Clase de acciones puntuales de acumulación en otras divisas Clase de acciones puntuales de acumulación en otras divisas	EUR SEK	27 de abril de 2017 23 de octubre de 2015	1,25 % 1,25 %	1,50 % 1,50 %	1,44 % 1,44 %
Clase de acciones "A" al cierre	USD	30 de marzo de 2007	1,25 %	2,00 %	1,94 %
Clase de acciones puntuales "A"	USD	18 de junio de 2007	1,25 %	2,00 %	1,94 %
Clase de acciones de acumulación "E" al cierre	EUR	30 de marzo de 2007	1,25 %	2,00 %	1,94 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "E"	EUR	18 de junio de 2007	1,25 %	2,00 %	1,94 %
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre Clase de acciones puntuales de acumulación "I"	GBP EUR	24 de agosto de 2017 31 de octubre de 2007	0,60 % 0,60 %	0,81 % 0,81 %	0,72 % 0,72 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "I"	USD	7 de junio de 2016	0,60 %	0,81 %	0,72 %
Clase de acciones "I" al cierre	GBP	24 de agosto de 2017	0,60 %	0,81 %	0,72 %
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	GBP	19 de agosto de 2008	0,00 %	0,21 %	0,12 %
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	JPY USD	1 de agosto de 2018 30 de noviembre de 2007	0,00 % 0,00 %	0,21 % 0,21 %	0,12 % 0,12 %
Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre  Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"(c)	SEK	13 de agosto de 2021	0,00 %	0,21 %	0,12 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"	USD	21 de abril de 2015	0,00 %	0,21 %	
Clase de acciones puntuales "IO"	USD	30 de junio de 2014	0,00 %	0,21 %	0,12 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "P"	USD	11 de junio de 2007	1,00 %	1,25 %	1,17 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "R" Clase de acciones puntuales "R"	USD GBP	3 de diciembre de 2012 9 de julio de 2015	0,60 % 0,60 %	0,85 % 0,85 %	0,79 % 0,78 %
Clase de acciones puntuales "R"	USD	3 de diciembre de 2012	0,60 %	0,85 %	0,79 %
US CORE® Equity Portfolio	USD		2,22 /2	-, /-	-,
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en la divisa de referencia	USD	21 de noviembre de 2005	1,00 %	1,25 %	1,14 %
Clase de acciones puntuales de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	14 de noviembre de 2005	1,00 %	1,25 %	1,15 %
Clase de acciones al cierre denominada en la divisa de referencia Clase de acciones puntuales denominada en la divisa de referencia	USD USD	21 de noviembre de 2005 18 de noviembre de 1996	1,00 % 1,00 %	1,25 % 1,25 %	1,14 % 1,14 %
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas	HKD	28 de junio de 2019	1,00 %	1,25 %	1,14 %
Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en otras divisas	SGD	20 de junio de 2018	1,00 %	1,25 %	1,15 %
Clase de acciones puntuales "A"	USD	5 de marzo de 2001	1,00 %	1,75 %	1,64 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "E"	EUR	31 de julio de 2001	1,00 %	1,75 %	1,64 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	EUR HKD	8 de marzo de 2018 31 de mayo de 2019	1,00 % 0,50 %	1,75 % 0,71 %	1,64 % 0,57 %
Clase de acciones de acumulación "I" al cierre	USD	14 de septiembre de 2015		0,71 %	0,57 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "I"	USD	3 de diciembre de 2014	0,50 %	0,71 %	0,57 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	8 de marzo de 2018	0,50 %	0,71 %	0,57 %
Clase de acciones puntuales "I"	USD	22 de febrero de 2002	0,50 %	0,71 %	0,57 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "P" Clase de acciones puntuales "P"	USD USD	11 de junio de 2007 25 de abril de 2008	0,80 % 0,80 %	1,05 % 1,05 %	0,92 % 0,93 %
	USD	3 de diciembre de 2012	0,50 %	0,75 %	0,64 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "R"	030			0,75 /0	

	Divisa	Fecha de creación	Porcentaje de comisión de asesoramiento	Límite de gastos <sup>(a)</sup>	Ratio de gastos netos totales <sup>(b)</sup>
US CORE® Equity Portfolio (continuación)					
Clase de acciones puntuales "R"	USD	3 de diciembre de 2012	0,50 %	0,75 %	0,64 %
Clase de acciones "U" al cierre	USD	27 de febrero de 2004	1,00 %	1,25 %	1,18 %
US Small Cap CORE® Equity Portfolio  Clase de acciones de acumulación al cierre denominada en la divisa de referencia	USD USD	5 de diciembre de 2005	1,25 %	1,50 %	1,50 %
Clase de acciones puntuales de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	5 de diciembre de 2005	1,25 %	1,50 %	1,50 %
Clase de acciones puntuales denominada en la divisa de referencia	USD	5 de diciembre de 2005	1,25 %	1,50 %	1,50 %
Clase de acciones "A" al cierre	USD	5 de diciembre de 2005	1,25 %	2,00 %	2,00 %
Clase de acciones de acumulación "E" al cierre	EUR	5 de diciembre de 2005	1,25 %	2,00 %	
Clase de acciones puntuales de acumulación "E"	EUR	5 de diciembre de 2005	1,25 %	2,00 %	2,00 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "I"	USD	26 de octubre de 2007	0,60 %	0,81 %	0,78 %
Clase de acciones puntuales "I" Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"	USD	9 de octubre de 2006 7 de abril de 2017	0,60 % 0,00 %	0,81 % 0,21 %	0,79 % 0,19 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "P"	USD	11 de junio de 2007	0,80 %	1,05 %	1,04 %
Clase de acciones puntuales de acumulación "R"	USD	3 de diciembre de 2012	0,60 %	0,85 %	
Clase de acciones puntuales "R"	GBP	10 de diciembre de 2012	0,60 %	0,85 %	0,85 %
Clase de acciones puntuales "R"	USD	3 de diciembre de 2012	0,60 %	0,85 %	0,85 %
Asia High Yield Bond Portfolio	USD	40.1	4.05.0/	4.50.0/	4.50.0/
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	13 de agosto de 2020	1,25 %	1,50 %	1,50 % 1,50 %
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	13 de agosto de 2020 13 de agosto de 2020	1,25 % 1,25 %	1,50 % 1,50 %	1,50 %
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis)	HKD	13 de agosto de 2020	1,25 %	1,50 %	1,50 %
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase cubierta en AUD)	AUD	13 de agosto de 2020	1,25 %	1,50 %	1,50 %
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en AUD)	AUD	13 de agosto de 2020	1,25 %	1,50 %	1,50 %
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR)	EUR	13 de agosto de 2020	1,25 %	1,50 %	1,50 %
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en GBP)	GBP	13 de agosto de 2020	1,25 %	1,50 %	1,50 %
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en SGD)	SGD	13 de agosto de 2020	1,25 %	1,50 %	1,50 %
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR EUR	24 de noviembre de 2020 24 de noviembre de 2020	1,25 %	2,00 % 2,00 %	2,00 % 2.00 %
Clase de acciones de acumulación "I SD"	USD	8 de octubre de 2020	1,25 % 0,40 %	0,61 %	0,60 %
Clase de acciones "I SD"(c)	GBP	26 de marzo de 2021	0,40 %	0,61 %	0.58 %
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) "I"(c)	USD	9 de julio de 2021	0,60 %	0,81 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	13 de agosto de 2020	0,60 %	0,81 %	0,81 %
Clase de acciones "I"	GBP	4 de noviembre de 2020	0,60 %	0,81 %	
Clase de acciones "I"	USD	13 de agosto de 2020	0,60 %	0,81 %	
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)(C)	EUR GBP	9 de julio de 2021	0,60 %	0,81 % 0,81 %	
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)(c) Clase de acciones "IS"	USD	25 de febrero de 2021 13 de agosto de 2020	0,60 % 0,40 %	0,61 %	
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) "P"(c)	USD	9 de julio de 2021	0,90 %	1,15 %	
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	13 de agosto de 2020	0,90 %	1,15 %	
Clase de acciones "P"	USD	13 de agosto de 2020	0,90 %	1,15 %	
Clase de acciones "R"	GBP	4 de noviembre de 2020	0,60 %	0,85 %	0,85 %
Emerging Markets Corporate Bond Portfolio	USD	17.1	4.05.0/	4.50.0/	4 00 0/
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	17 de mayo de 2011	1,25 %	1,50 %	1,39 %
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	1 de diciembre de 2017 31 de marzo de 2017	1,25 % 1,25 %	1,50 % 1,50 %	1,39 % 1,38 %
Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	13 de abril de 2017	1,25 %	1,50 %	1,39 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	17 de mayo de 2011	1,25 %	1,50 %	1,39 %
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis)	HKD	30 de enero de 2019	1,25 %	1,50 %	1,38 %
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase cubierta en AUD)	AUD	30 de enero de 2019	1,25 %	1,50 %	1,38 %
Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en SGD)	SGD	31 de marzo de 2017	1,25 %	1,50 %	1,39 %
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en AUD) Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR)	AUD EUR	1 de junio de 2017 6 de septiembre de 2019	1,25 % 1,25 %	1,50 % 1,50 %	1,38 % 1,39 %
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en EDR)	GBP	8 de junio de 2017	1,25 %	1,50 %	1,38 %
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en SGD)	SGD	13 de abril de 2017	1,25 %	1,50 %	1,38 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF)	CHF	21 de febrero de 2020	1,25 %	1,50 %	1,38 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	17 de mayo de 2011	1,25 %	1,50 %	1,38 %
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	17 de mayo de 2011	1,25 %	1,50 %	
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en GBP)	GBP	17 de mayo de 2011	1,25 %	1,50 %	
Clase de acciones "A"  Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	USD EUR	17 de mayo de 2011 8 de agosto de 2012	1,25 % 1,25 %	1,75 % 2,00 %	
Clase de acciones (trimestrai) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	17 de mayo de 2011	1,25 %	2,00 %	
Clase de acciones de acumulación E (clase cubierta en Eork)  Clase de acciones (estable mensual) (Dis) "I"	USD	31 de octubre de 2019	0,70 %	0,91 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	17 de mayo de 2011	0,70 %	0,91 %	0,76 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en BRL)(c)	USD	8 de febrero de 2021	0,70 %	0,91 %	0,77 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF)	CHF	21 de febrero de 2020	0,70 %	0,91 %	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	17 de mayo de 2011	0,70 %	0,91 %	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1 de diciembre de 2014	0,70 %	0,91 %	
Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	USD EUR	17 de mayo de 2011 17 de mayo de 2011	0,70 % 0,70 %	0,91 % 0,91 %	
Clase de acciones "1" (Clase cubierta en GBP)	GBP	26 de junio de 2020	0,70 %	0,91 %	
Clase de acciones de acumulación "IO"	JPY	13 de septiembre de 2016		0,31 %	
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	24 de abril de 2015	0,00 %	0,21 %	
Clase de acciones "IO"	USD	15 de noviembre de 2013	0,00 %	0,21 %	0,06 %
Clase de acciones de acumulación "IS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	27 de febrero de 2019	0,45 %	0,66 %	
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	8 de febrero de 2013	1,00 %	1,25 %	1,11 %
Clase de acciones "P"	USD	8 de febrero de 2013	1,00 %	1,25 %	1,13 %
Clase de acciones de acumulación "R"  Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHE)	USD	13 de diciembre de 2012	0,70 %	0,95 %	
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones "R"	CHF USD	21 de febrero de 2020 13 de diciembre de 2012	0,70 % 0,70 %	0,95 % 0,95 %	0,83 % 0,84 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	5 de diciembre de 2012	0,70 %	0,95 %	0,84 %
Emerging Markets Debt Blend Portfolio	USD	- 55 5.5.5bic 00 E0 IE	0,70 70	0,00 /0	5,55 70
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	8 de mayo de 2013	1,40 %	1,65 %	1,58 %

	Divisa	Fecha de creación	Porcentaje de comisión de asesoramiento	Límite de gastos <sup>(a)</sup>	Ratio de gastos netos totales <sup>(b)</sup>
Emerging Markets Debt Blend Portfolio (continuación)		0.1	4.40.0/	4.05.0/	4.50.0/
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en EUR)	USD	8 de mayo de 2013 8 de mayo de 2013	1,40 % 1,40 %	1,65 % 1,65 %	1,58 % 1,59 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	8 de mayo de 2013	1,40 %	1,65 %	1,59 %
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	8 de mayo de 2013	1,40 %	2,15 %	2,08 %
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	15 de mayo de 2017	0,70 %	0,91 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	8 de mayo de 2013	0,70 %	0,91 %	0,82 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	28 de junio de 2017	0,70 %	0,91 %	0,81 %
Clase de acciones "I"	USD GBP	8 de mayo de 2013 8 de mayo de 2013	0,70 % 0,70 %	0,91 % 0,91 %	0,82 % 0,82 %
Clase de acciones "I" (Clase parcialmente cubierta en GBP) Clase de acciones "IO" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	14 de noviembre de 2019	0,70 %	0,91 %	0,82 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	8 de mayo de 2013	0,70 %	0,95 %	0,89 %
Clase de acciones "R"	USD	8 de mayo de 2013	0,70 %	0,95 %	0,89 %
Clase de acciones "R" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	8 de mayo de 2013	0,70 %	0,95 %	0,89 %
Emerging Markets Debt Local Portfolio	USD	00 1 : : 1 0007	4 00 0/	4.05.0/	4 == 0/
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	29 de junio de 2007 15 de abril de 2011	1,60 % 1,60 %	1,85 % 1,85 %	1,77 % 1,77 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	29 de junio de 2007	1,60 %	1,85 %	1,77 %
Clase de acciones en otras divisas	GBP	4 de junio de 2010	1,60 %	1,85 %	1,77 %
Clase de acciones de acumulación "A"	USD	29 de junio de 2007	1,60 %	2,10 %	2,02 %
Clase de acciones "A"	USD	29 de junio de 2007	1,60 %	2,10 %	2,02 %
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E"	EUR	15 de abril de 2011	1,60 %	2,10 %	2,02 %
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	29 de junio de 2007	1,60 %	2,10 %	2,02 %
Clase de acciones "E"	EUR	29 de junio de 2007	1,60 %	2,10 %	2,02 %
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "I"  Clase de acciones de acumulación "I"	EUR EUR	24 de junio de 2014 15 de marzo de 2010	0,70 % 0.70 %	0,91 % 0,91 %	0,80 % 0.80 %
Clase de acciones de acumulación "l"	GBP	1 de diciembre de 2014	0,70 %	0,91 %	0,80 %
Clase de acciones de acumulación "l"	USD	29 de junio de 2007	0,70 %	0,91 %	
Clase de acciones "I"	USD	29 de junio de 2007	0.70 %	0,91 %	0.80 %
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) "IO"	USD	18 de marzo de 2019	0,00 %	0,21 %	0,11 %
Clase de acciones de acumulación "IO"	JPY	31 de agosto de 2016	0,00 %	0,21 %	0,10 %
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	26 de septiembre de 2007		0,21 %	
Clase de acciones "IO"	USD	30 de junio de 2014	0,00 %	0,21 %	0,11 %
Clase de acciones "IS"	EUR	20 de marzo de 2020	0,45 %	0,66 %	
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IX"	USD	4 de septiembre de 2007	1,00 %	1,21 % 0,21 %	1,10 % 0,10 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO" Clase de acciones de acumulación "P"	USD	15 de octubre de 2009 29 de mayo de 2009	0,00 % 1,25 %	1,50 %	1,40 %
Clase de acciones "P"	USD	29 de mayo de 2009	1,25 %	1,50 %	1,40 %
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	13 de diciembre de 2012	0,70 %	0,95 %	
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	13 de diciembre de 2012	0,70 %	0,95 %	0,89 %
Clase de acciones "R"	EUR	13 de diciembre de 2012	0,70 %	0,95 %	0,87 %
Clase de acciones "R"	GBP	10 de diciembre de 2012	0,70 %	0,95 %	0,87 %
Clase de acciones "R"	USD	13 de diciembre de 2012	0,70 %	0,95 %	0,87 %
Emerging Markets Debt Portfolio Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	14 de noviembre de 2005	1,25 %	1,50 %	1,39 %
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)	USD	13 de julio de 2011	1,25 %	1,50 %	1,38 %
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR)	EUR	12 de octubre de 2007	1,25 %	1,50 %	1,38 %
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	1 de diciembre de 2017	1,25 %	1,50 %	1,39 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	15 de abril de 2011	1,25 %	1,50 %	1,38 %
Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	15 de julio de 2016	1,25 %	1,50 %	1,39 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	3 de mayo de 2000	1,25 %	1,50 %	1,39 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)	USD	13 de julio de 2011	1,25 %	1,50 %	1,38 %
Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en HKD)	EUR HKD	22 de septiembre de 2016 30 de septiembre de 2016		1,50 % 1,50 %	1,38 % 1,38 %
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en TRO)	SGD	15 de julio de 2016	1,25 %	1,50 %	1,38 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF)	CHF	13 de marzo de 2015	1,25 %	1,50 %	1,38 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en			1,=- /-	.,	.,
duración)	EUR	13 de julio de 2011	1,25 %	1,50 %	1,38 %
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	9 de mayo de 2012	1,25 %	1,50 %	1,38 %
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en SGD)	SGD	21 de junio de 2011	1,25 %	1,50 %	1,38 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"	USD	5 de mayo de 2011	1,25 %	1,75 %	1,63 %
Clase de acciones de acumulación "A" Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)	USD PLN	24 de octubre de 2016 27 de mayo de 2016	1,25 % 1,25 %	1,75 % 1,75 %	1,64 % 1,63 %
Clase de acciones de acumulación A (Clase cubierta en PLN)  Clase de acciones "A"	USD	5 de marzo de 2011	1,25 %	1,75 %	1,63 %
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	21 de abril de 2011	1,25 %	2,00 %	1,88 %
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	13 de julio de 2011	1,25 %	2,00 %	1,88 %
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	31 de julio de 2001	1,25 %	2,00 %	1,89 %
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	10 de noviembre de 2010	1,25 %	2,00 %	1,88 %
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	13 de julio de 2011	1,25 %	2,00 %	1,88 %
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	25 de abril de 2016	0,75 %	0,96 %	
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "I"	GBP	2 de septiembre de 2016	0,75 %	0,96 %	
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en CHF)	USD	27 de abril de 2015	0,75 %	0,96 % 0,96 %	
Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF)	CHF	3 de septiembre de 2010 17 de noviembre de 2015	0,75 % 0,75 %	0,96 %	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en duración) <sup>(c)</sup>	EUR	11 de mayo de 2015	0,75 %	0,96 %	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	7 de febrero de 2006	0,75 %	0,96 %	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	19 de agosto de 2014	0,75 %	0,96 %	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en JPY)	JPY	2 de junio de 2017	0,75 %	0,96 %	0,82 %
Clase de acciones "I"	EUR	23 de agosto de 2017	0,75 %	0,96 %	0,82 %
Clase de acciones "I"	USD	19 de junio de 2001	0,75 %	0,96 %	
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en duración)	USD	16 de julio de 2015	0,75 %	0,96 %	
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	27 de noviembre de 2006		0,96 %	
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	5 de julio de 2013	0,75 %	0,96 %	0,82 %

Emerging Markets Debt Portfolio (continuación)   Galle   Gal		Divisa	Fecha de creación	Porcentaje de comisión de asesoramiento		Ratio de gastos netos totales <sup>(b)</sup>
Clase de accorner 1" (Clase cuberte en GBP) (Clase cuberte en duración)**   Clase de accorner 1" (Clase cuberte en duración)**   Clase de accorner de anamusación 10" (Clase cuberte en EUR)   Clase de accorner de anamusación 10" (Clase cuberte en EUR)   Clase de accorner de anamusación 10" (Clase cuberte en EUR)   Clase de accorner de anamusación 10" (Clase cuberte en EUR)   Clase de accorner de anamusación 10" (Clase cuberte en EUR)   Clase de accorner de anamusación 10" (Clase cuberte en EUR)   Clase de accorner de anamusación 10" (Clase cuberte en EUR)   Clase de accorner de anamusación 10" (Clase cuberte en EUR)   Clase de accorner de anamusación 10" (Clase cuberte en EUR)   Clase de accorner de anamusación 10" (Clase cuberte en EUR)   Clase de accorner de anamusación 10" (Clase cuberte en EUR)   Clase de accorner de anamusación 10" (Clase cuberte en EUR)   Clase de accorner de anamusación 10" (Clase cuberte en EUR)   Clase de accorner de anamusación 10" (Clase cuberte en EUR)   Clase de accorner de anamusación 10" (Clase cuberte en EUR)   Clase de accorner de anamusación 10" (Clase cuberte en EUR)   Clase de accorner de anamusación 10" (Clase cuberte en EUR)   Clase de accorner de anamusación 10" (Clase cuberte en EUR)   Clase de accorner de anamusación 10" (Clase cuberte en EUR)   Clase de accorner 10" (Clase de accorner 20" (C	Emerging Markets Debt Portfolio (continuación)				-	
Classe de accionnes (brutam enssall) (bils) "10"   Gibbs of accionnes (brutam enssall) (bils) "10"   Gibbs of accionnes de accionnes (bils)   Gibbs of accionnes (bils)   Gibbs of accionnes de accionnes (bils)   Gibbs of accionnes (bils)						
Classe de accorner de accumisación 10°   19°   7 de octubre de 2018   0.00 %   0.21 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.07 %   0.0						
Clase de actiones de actions de						
Clase de accionnes de actimulación 10" (Clase cuberta en EUR)   EUR   8 de junio 2015   0.00 % 0.21 % 0.07 %   0.00 % 0.21 % 0.07 %   0.00 % 0.21 % 0.07 %   0.00 % 0.00 % 0.21 % 0.07 %   0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.00 % 0.						
Classe de acconnes de accumisación "10" (Classe oublerta en GBP)   GBP   31 de atim de 20016   0.00 % 0.21 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.07 % 0.0						
Classe de acconnes de accumilación "10" (Classe cubierta en EUR)   USP   7 de octubre de 2016   0,00 % 0,21 % 0,07 % 0,07 % 0,00 % 0,21 % 0,07 % 0,00 % 0,21 % 0,07 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,00 % 0,						
Clase de acciones 107   Clase cubierta en EUR    Clase cubierta en EUR    Clase de acciones timestrain  Clash 105 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de accumidador 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de accumidador 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en CPF)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en CPF)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en CPF)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en CPF)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en CPF)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en CPF)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en CPF)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en CPF)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en CPF)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en CPF)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157 (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones tin 157						
Clase de accones (trimestral) (Dis) "15" (Clase cuberta en EUR)   EUR   EUR   EUR   Clase de accones de acumuladors "15" (Clase cuberta en EUR)   EUR   EU						
Clase de acciones de accumilación 15" (Clase cubierta en CHF)   CHF   Cubier de acciones de accumilación 15" (Clase cubierta en CHF)   CHF   C						
Clase de acconnes de accumilación 15" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acconnes de accumilación 15" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acconnes 15" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acconnes 15" (Clase cubierta en GBP)   Clase de acconnes de accumilación 17"   Clase de acconnes 17						
Clase de acciones de accumisación 15" (Clase cabierta en EUR)   EUR   4 de diciembre de 2017   0.45 % 0.66 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.55 % 0.5						
Clase de accoines 195   Clase de accoines 495   Clase de accoines 695   Clase 695   Clas						
Clase de accionnes 15" (Clase cubierta en GBP)   GBP   4 de diciembre de 2017   0.45 %   0.68 %   0.25 %   Clase de accionnes (enenaul) (File) (Cap) 17"   USD   3 de major de 2017   1.05 %   1.25 %   1.11 %   Clase de accionnes de acumulación 17"   USD   3 de major de 2017   1.05 %   1.25 %   1.11 %   Clase de accionnes de acumulación 17"   USD   3 de major de 2011   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de accionnes de acumulación 17"   USD   3 de major de 2012   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de accionnes de acumulación 17" (Clase cubierta en CHF)   USD   3 de diciembre de 2012   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de accionnes de acumulación 17" (Clase cubierta en CHF)   USD   3 de diciembre de 2012   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de accionnes 17"   USD   3 de diciembre de 2015   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de accionnes 17"   USD   3 de diciembre de 2015   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de accionnes 17"   USD   3 de diciembre de 2015   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de accionnes 17"   USD   3 de diciembre de 2015   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de accionnes 17"   USD   3 de diciembre de 2012   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de accionnes 17"   USD   3 de diciembre de 2012   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de accionnes 17"   USD   3 de diciembre de 2012   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de accionnes 17"   USD   3 de diciembre de 2012   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de accionnes 17"   USD   3 de diciembre de 2012   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de accionnes 17"   USD   3 de diciembre de 2012   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de accionnes 17"   USD   0.50 %   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de accionnes 17"   USD   0.50 %   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de accionnes 17"   USD   0.50 %   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de accionnes 18"   USD   0.50 %   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de accionnes 18"   USD   0.50 %   0.75 %   0.50 %   Clase de accionnes 18"   USD   0.50 %   0.75 %   0.50 %   0.75 %   0.50 %   Clase de accionnes 18"   USD   0.50 %   0.50 %   0.50 %   0.50 %   0.50 %   0						
Clase de acciones (mensal) (Dis) (Cap) TX'   USD   3 de mayor de 2017   1,00 %   1,25 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,14 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1,15 %   1						
Class de acciones de accumisación 'P'   USD 3 de mayo de 2017   1,00 % 1,25 % 1,11 %   Class de acciones de accumisación 'P'   USD 3 de mayo de 2017   1,00 % 1,25 % 1,11 %   Class de acciones de accumisación 'P' (Clase cubierta en CHF)   USD 3 de mayo de 2017   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 % 0,85 %   1,00 %						
Clase de acciones fee   USD   3 de maryo de 2017   1,05 %   1,25 %   1,14 %   Clase de acciones de acumulación 'R'   Clase cubierta en CHF   USD   3 de diciembre de 2012   0,75 %   1,00 %   0,88 %   1,00 %   0,88 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   1,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %   0,00 %						
Clase de acciones de acumilación 'R' Clase cubierta en CIFF   USD 3 de diciembre de 2012   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de acciones de acumilación 'R' Clase cubierta en CIFF   USD 3 de diciembre de 2012   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de acciones de acumilación 'R' Clase cubierta en EUR)   USD 3 de diciembre de 2015   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de acciones 'R' Clase cubierta en EUR)   USD 3 de diciembre de 2012   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de acciones 'R' Clase cubierta en EUR)   USD 3 de diciembre de 2012   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de acciones 'R' Clase cubierta en EUR)   USD 3 de diciembre de 2012   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de acciones 'R' Clase cubierta en SED)   USD 3 de diciembre de 2012   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de acciones 'R' Clase cubierta en SED   (Clase cubierta en SED)   USD 3 de diciembre de 2012   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de acciones 'R' Clase cubierta en SED   USD 3 de diciembre de 2012   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de acciones 'R' Clase cubierta en SED   USD 3 de diciembre de 2012   0.75 %   1.00 %   0.88 %   Clase de acciones de acumilación 'RS' (Clase cubierta en CHF)   USD 1 de octubre de 2013   0.55 %   0.77 %   0.68 %   Clase de acciones de acumilación 'RS' (Clase cubierta en EUR)   USD 1 de octubre de 2019   0.55 %   0.77 %   0.68 %   Clase de acciones de acumilación 'RS' (Clase cubierta en EUR)   USD 1 de octubre de 2019   0.55 %   0.77 %   0.68 %   Clase de acciones de Talle 'USD   USD 1 de octubre de 2019   0.55 %   0.77 %   0.68 %   Clase de acciones de Talle 'USD   USD 1 de octubre de 2019   0.55 %   0.77 %   0.68 %   Clase de acciones de Talle 'USD   0.55 %   0.77 %   0.68 %   Clase de acciones de Talle 'USD   0.55 %   0.77 %   0.68 %   Clase de acciones de Talle 'USD   0.55 %   0.77 %   0.68 %   Clase de acciones de Talle 'USD   0.55 %   0.77 %   0.68 %   Clase de acciones de Talle 'USD   0.55 %   0.77 %   0.68 %   Clase de acciones de Talle 'USD   0.55 %   0.77 %   0.68 %   Clase de acciones de Talle 'USD   0.55 %   0.77 %						
Clase de acciones de acumulación "R' (Clase cubierta en CHF)						
Clase de acciones de acumulación "N" (Clase cubierta en EUR)						
Clase de acciones de acumulación 1º (Clase cubierta en EUR)   EUR   5 de diciembre de 2012   0,75 % 1,00 % 0,88 % Clase de acciones 1º (Clase cubierta en EUR)   EUR   5 de diciembre de 2012   0,75 % 1,00 % 0,88 % Clase de acciones 1º (Clase cubierta en GBP)   GBP   5 de diciembre de 2012   0,75 % 1,00 % 0,88 % Clase de acciones 1º (Clase cubierta en GBP)   GBP   5 de diciembre de 2012   0,75 % 1,00 % 0,88 % Clase de acciones 1º (Clase cubierta en GBP)   GBP   5 de diciembre de 2012   0,75 % 1,00 % 0,88 % Clase de acciones 1º (Clase cubierta en CBP)   GBP   5 de diciembre de 2012   0,75 % 1,00 % 0,88 % Clase de acciones de acumulación 1ºS¹ (Clase cubierta en CHF)   GBP   6 de combre de 2011   0,75 % 1,00 % 0,88 % Clase de acciones de acumulación 1ºS¹ (Clase cubierta en CHF)   GBP   1 de octubre de 2019   0,52 % 0,77 % 0,68 % Clase de acciones de acumulación 1ºS¹ (Clase cubierta en EUR)   EUR   1 de octubre de 2019   0,52 % 0,77 % 0,68 % Clase de acciones 1ºS¹ (Clase cubierta en EUR)   EUR   1 de octubre de 2019   0,52 % 0,77 % 0,68 % Clase de acciones 1ºS¹ (Clase cubierta en EUR)   USD   1 de octubre de 2019   0,52 % 0,77 % 0,68 % Clase de acciones 1ºS¹ (Clase cubierta en EUR)   USD   1 de octubre de 2019   0,52 % 0,77 % 0,68 % Clase de acciones 1ºS¹ (Clase cubierta en EUR)   USD   1 de octubre de 2019   0,52 % 0,77 % 0,68 % Clase de acciones 1ºS¹ (Clase cubierta en EUR)   USD   1 de octubre de 2019   0,52 % 0,77 % 0,68 % Clase de acciones 1ºS² (Clase cubierta en EUR)   USD   1 de octubre de 2019   0,52 % 0,77 % 0,68 % Clase de acciones 1ºS² (Clase cubierta en EUR)   USD   1 de octubre de 2019   0,52 % 0,77 % 0,68 % Clase de acciones 1ºS² (Clase cubierta en EUR)   USD   1 de octubre de 2019   0,52 % 0,77 % 0,68 % Clase de acciones 1ºS² (Clase cubierta en EUR)   USD   1 de octubre de 2019   0,52 % 0,77 % 0,68 % Clase de acciones de acumulación denominación en EUR)   USD   1 de octubre de 2019   0,52 % 0,77 % 0,68 % Clase de acciones de acumulación 1º (Clase cubierta en EUR)   USD   1 de octubre de 2019   0,52 %						
Clase de acciones 1rt (Clase cubierta en EUR)						
Clase de acciones TP (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones TP (Clase cubierta en GBP) (Clase cubierta en CHF)   Clase de acciones de accumiación TP (Clase cubierta en CHF)   Clase de acciones de accumiación TP (Clase cubierta en CHF)   Clase de acciones de accumiación TP (Clase cubierta en CHF)   Clase de acciones de accumiación TP (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones TP (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones TP (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones TP (Clase cubierta en GBP)   Clase de acciones de accumiación denominada en la divisa de referencia   USD   Clase de acciones denominada en la divisa de referencia   USD   Clase de acciones denominada en la divisa de referencia   USD   Clase de acciones de accumiación de TP (Clase cubierta en EUR)   EUR   6 de enero de 2019   1,00 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1						
Clase de acciones Tr. (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones Tr. (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones Tr. (Clase cubierta en SGD) Clase de acciones Tr. (Clase cubierta en SGD) Clase de acciones de acumulación TR.) Clase de acciones TR. Clase de acciones TR.) Clase de acciones TR. Clase de acciones de acumulación de nontrada de tan divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en ortras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación Tr. Clase de acciones Tr. Clase cubierta e						
Clase de acciones N° (Clase cubierta en GBP) (Clase cubierta en duración)   GBP   Sof diciembre de 2012   0,75 % 1,00 % 0.88 %   Clase de acciones de acumulación 'RS' (Clase cubierta en EUR)   USD   1 de octubre de 2019   0,52 % 0,77 % 0,66 %   Clase de acciones de acumulación 'RS' (Clase cubierta en EUR)   EUR   1 de octubre de 2019   0,52 % 0,77 % 0,66 %   Clase de acciones de acumulación 'RS' (Clase cubierta en EUR)   EUR   1 de octubre de 2019   0,52 % 0,77 % 0,66 %   Clase de acciones 'RS' (Clase cubierta en EUR)   EUR   1 de octubre de 2019   0,52 % 0,77 % 0,66 %   Clase de acciones 'RS' (Clase cubierta en GBP)   EUR   1 de octubre de 2019   0,52 % 0,77 % 0,66 %   Clase de acciones 'RS' (Clase cubierta en GBP)   USD   USD   Clase de acciones 'RS' (Clase cubierta en GBP)   USD   USD   Clase de acciones de acumulación de notarionis de referencia   USD   Se enero de 2019   0,52 % 0,77 % 0,66 %   Clase de acciones de acumulación en tras divisas (Clase cubierta en EUR)   USD   Se enero de 2019   1,00 % 1,19 % 1,19 %   Clase de acciones de acumulación en tras divisas (Clase cubierta en EUR)   USD   Se enero de 2019   1,00 % 1,19 % 1,19 %   Clase de acciones de acumulación en tras divisas (Clase cubierta en EUR)   EUR   Se enero de 2019   1,00 % 1,19 % 1,19 %   Clase de acciones de acumulación en EUR)   EUR   Se enero de 2019   1,00 % 1,19 % 1,19 %   Clase de acciones de acumulación en EUR)   EUR   Se enero de 2019   1,00 % 1,19 % 1,19 %   Clase de acciones de acumulación en EUR)   EUR   Se enero de 2019   1,00 % 1,44 %   1,44 %   Clase de acciones de acumulación en EUR)   EUR   Se enero de 2019   1,00 % 1,44 %   1,44 %   Clase de acciones de acumulación en EUR)   EUR   Se enero de 2019   1,00 % 1,44 %   1,44 %   Clase de acciones de acumulación en EUR)   EUR   Se enero de 2019   1,00 % 1,44 %   1,44 %   Clase de acciones de acumulación en EUR)   EUR   Se enero de 2019   1,00 % 1,65 %   Clase de acciones de acumulación en EUR)   EUR   Se enero de 2019   1,00 % 1,65 %   Clase de acciones de acumulación en EUR)						
Clase de acciones / (Clase cubierta en SGD)   Clase de acciones de acumulación (*T85") (Clase cubierta en CHF)   Clase de acciones de acumulación (*T85") (Clase cubierta en CHF)   CHF						
Clase de acciones de acumulación 'RS' (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación 'RS' (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones 'RS' (Clase cubierta en GBP)   Clase de acciones 'RS' (Clase cubierta en GBP)   Clase de acciones de acciones de acciones de acciones 'RS' (Clase cubierta en GBP)   Clase de acciones de acciones de nativalisad de referencia   USD   USD   Clase de acciones de nativalisad en la divisa de referencia   USD   USD   Se de enero de 2019   1,00 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,1		SGD	23 de octubre de 2015			
Clase de acciones de acumulación "RS" (Clase cubierta en EUR)						
Clase de acciones 'RS' (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (RS' (Clase cubierta en CBP) Clase de acciones (RS' (Clase cubierta en CBP) Clase de acciones (RS' (Clase cubierta en CBP) Clase de acciones de merging Markets Short Duration Bond Portfolio(s) Clase de acciones de merging Markets Short Duration Bond Portfolio(s) Clase de acciones de acumulación de ni la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en Crisa divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en EUR) Clase de acciones de acumulación ("Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación ("Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación ("Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación ("Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación ("Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación ("Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación ("Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación ("Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación ("Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación ("Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación ("Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación ("Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación ("Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación ("Clase cubierta en EUR) Clase de acciones ("Clase cubierta en EUR) Clase						
Clase de acciones R'S' (Clase cubierta en EUR)   USD						
Clase de acciones *R** ("Clase cubierta en GBP)   Clase de acciones de acumulación de normanda en la divisa de referencia   USD   Se de enero de 2019   1,00 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % 1,						
September   Sept						
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   USD   8 de enero de 2019   1,00 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % Clase de acciones de normalada en la divisa de referencia   USD   8 de enero de 2019   1,00 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)   EUR   8 de enero de 2019   1,00 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)   EUR   8 de enero de 2019   1,00 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)   EUR   8 de enero de 2019   1,00 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 % 1,44 %				-,	-,	5,55 /5
Clase de acciones de acumulación en dras divisas (Clase cubierta en EUR)   USD   8 de enero de 2019   1,00 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % Clase de acciones de acumulación en EUR)   EUR   8 de enero de 2019   1,00 % 1,19 % 1,19 % 1,19 % Clase de acciones de acumulación "F" (Clase cubierta en EUR)   EUR   8 de enero de 2019   1,00 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14 % 1,14			8 de enero de 2019	1 00 %	1 19 %	1 19 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)   Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)   Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación "P" (Elle "B")   EUR 15 de entre de 2019 (0.50 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0.69 % 0						
Clase de acciones de acumulación "F" (Clase cubierta en EUR)   EUR 8 de enero de 2019   1,00 %   1,19 %   1,19 %   1,19 %   Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)   USD 8 de enero de 2019   0,50 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65 %   0,65						
Clase de acciones de acumulación 1" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación 1" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación 1" (Clase cubierta en GBP)   GBP 8 de enero de 2019   0,50 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 % 0,65 %	Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	8 de enero de 2019	1,00 %	1,19 %	1,19 %
Clase de acciones de acumulación "1" (Clase cubierta en EUR)   Slae de acciones de acumulación "1" (Clase cubierta en GBP)   Slae de acciones de acumulación "1" (Clase cubierta en EUR)   USD 8 de enero de 2019   0.50 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % Clase de acciones "1" (Clase cubierta en EUR)   USD 8 de enero de 2019   0.50 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.65 % 0.						
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)   Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)   USD 8 de enero de 2019   0,50 % 0,65 % 0,65 % 0,65 %   Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)   USD 26 de febrero de 2020   0,70 % 0,89 % 0,89 %   Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)   USD 15 de octubre de 2019   0,70 % 0,89 % 0,89 %   Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)   USD 15 de octubre de 2019   0,70 % 0,89 % 0,89 %   Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)   USD 15 de octubre de 2019   0,70 % 0,89 % 0,89 %   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   USD 15 de octubre de 2019   0,70 % 0,89 % 0,89 %   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   USD 15 de octubre de 2019   0,50 % 0,69 % 0,89 %   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   USD 15 de octubre de 2019   0,50 % 0,69 % 0,89 %   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)   USD 15 de octubre de 2019   0,50 % 0,69 % 0,69 %   Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)   USD 15 de octubre de 2019   0,50 % 0,69 % 0,69 %   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)   USD 15 de octubre de 2019   0,50 % 0,69 % 0,69 %   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)   USD 15 de octubre de 2019   0,50 % 0,69 % 0,69 %   Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)   USD 15 de octubre de 2019   0,50 % 0,69 % 0,69 %   Clase de acciones de acumulación "R"   USD 15 de octubre de 2019   0,50 % 0,69 % 0,69 %   Clase de acciones de acumulación "R"   USD 15 de octubre de 2019   0,50 % 0,69 % 0,69 %   Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   USD 15 de octubre de 2019   0,50 % 0,69 % 0,69 %   Clase de acciones de acumulación "R"   USD 15 de octubre de 2014   0,50 % 0,64 % 0,64 %   USD 15 de enero de 2014   0,50 % 0,69 % 0,69 %   USD 15 de enero de 2014   0,50 % 0,69 % 0,69 %   USD 15 de enero de 2014   0,50 % 0,69 % 0,69 %   USD 15 de enero de 2014   0,50 % 0,69 % 0,69 %   USD 15 de						
Clase de acciones " (Clase cubierta en EUR)   USD   8 de enero de 2019   0,50 %   0,65 %   0,65 %   Clase de acciones de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)   USD   15 de centro de 2020   0,70 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0						
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)						
Clase de acciones de acumulación "P" Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "R" Clase de acciones "R" Clase de acciones "R" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "R" Clase de acciones "R" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "R" Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "P" Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones de						
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)   GBP   15 de octubre de 2019   0,70 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0,89 %   0						
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)   Clase de acciones de acciumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acciumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   EUR   8 de enero de 2019   0,50 % 0,69 % 0,69 % 0,69 %   Clase de acciones de acciumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   EUR   8 de enero de 2019   0,50 % 0,69 % 0,69 %   Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)   USD   15 de octubre de 2019   0,50 % 0,69 % 0,69 %   Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)   USD   15 de octubre de 2019   0,50 % 0,69 % 0,69 %   Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)   GBP   8 de enero de 2019   0,50 % 0,69 % 0,69 %   Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)   GBP   8 de enero de 2019   0,50 % 0,69 % 0,69 %   Clase de acciones de accimalación denominada en la divisa de referencia   EUR   15 de enero de 2014   0,50 % 0,69 %   Clase de acciones de accimalación "E"   EUR   15 de enero de 2014   0,50 % 0,64 % 0,64 %   Clase de acciones de accimalación "E"   EUR   15 de enero de 2014   0,50 % 0,69 %   0,89 %   Clase de acciones de accimalación "E"   EUR   15 de enero de 2014   0,50 % 0,89 %   0,89 %   Clase de acciones de accimalación "F"   EUR   15 de enero de 2014   0,50 % 0,89 %   0,89 %   Clase de acciones de accimalación "F"   EUR   15 de enero de 2014   0,25 % 0,35 %   0,35 %   Clase de acciones de accimalación "F"   EUR   15 de enero de 2014   0,25 % 0,35 %   0,35 %   Clase de acciones de accimalación "R"   EUR   13 de mayo de 2014   0,25 % 0,39 % 0,39 %   0,39 %   Clase de acciones de accimalación "R"   EUR   15 de enero de 2014   0,25 % 0,35 %   0,39 %   0,39 %   Clase de acciones de accimalación denominada en la divisa de referencia   EUR   15 de enero de 2014   0,25 % 0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %						
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)			15 de octubre de 2019			
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)						
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)						
Clase de acciones "R"   USD   15 de octubre de 2019   0,50 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,69 % 0,						
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR) (Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) (Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) (Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase de acciones de acumulación "E" (Clase de acciones de acumulación "I" (Clase de acciones de acumulación "P" (Clase de acciones de acumulación "R" (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD) (Clase de acciones de acumulación "C" (Clase cubierta en PLN) (Clase de acciones de acumulación "C" (Clase cubierta en PLN) (Clase de acciones de acumulación "C" (Clase cubierta en USD) (Clase de acciones de acumulación "C" (Clase cubierta en USD) (Clase de acciones de acumulación "C" (Clase cubierta en USD) (Clase de acciones de acumulación "Clase cubierta en USD) (Clase de acciones de acumulación "Clase cubierta en USD) (Clase de acciones de acumulación "Clase cubierta en USD) (Clase de acciones de acumulación "Clase cubierta en USD) (Clase de acciones de acumulación "Clase cubierta en USD) (Clase de acciones de acumulación "Clase cubierta en USD) (Clase de acciones de acumulación "Clase cubierta en USD) (Clase de acciones de acumulación "Clase cubierta en USD) (Clase de acciones de acumulación "Clase cubierta en USD) (Clase de acciones de acumulación "Cl						
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)   ESG-Enhanced Euro Short Duration Bond Plus Portfolio(c)   EUR   15 de enero de 2014   0,50 % 0,69 % 0,69 % 0,64 % 0,64 % Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   EUR   15 de enero de 2014   0,50 % 0,64 % 0,64 % Clase de acciones de acumulación "E"   EUR   15 de enero de 2014   0,50 % 0,64 % 0,64 % Clase de acciones de acumulación "I"   EUR   15 de enero de 2014   0,50 % 0,89 % 0,89 % Clase de acciones de acumulación "I"   EUR   15 de enero de 2014   0,25 % 0,35 % 0,35 % Clase de acciones de acumulación "P"   EUR   15 de enero de 2014   0,25 % 0,35 % 0,35 % Clase de acciones de acumulación "P"   EUR   15 de enero de 2014   0,25 % 0,35 % 0,35 % Clase de acciones de acumulación "P"   EUR   13 de mayo de 2014   0,25 % 0,35 % 0,49 % 0,49 % Clase de acciones de acumulación "R"   EUR   13 de mayo de 2014   0,25 % 0,39 % 0,39 % Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   EUR   15 de enero de 2014   0,25 % 0,39 % 0,39 % Clase de acciones de acumulación "R"   EUR   13 de mayo de 2014   0,25 % 0,39 % 0,39 % Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   EUR   15 de enero de 2014   0,25 % 0,39 % 0,39 % Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   EUR   15 de enero de 2014   0,25 % 0,39 % 0,39 % Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   EUR   15 de enero de 2014   1,00 % 1,25 % 1,29 % Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   EUR   17 de junio de 2014   1,00 % 1,25 % 1,29 % Clase de acciones de acumulación "I"   EUR   17 de junio de 2014   1,00 % 1,25 % 1,29 % Clase de acciones de acumulación "I"   EUR   17 de junio de 2014   1,00 % 1,85 % 1,89 % Clase de acciones de acumulación "I"   EUR   17 de junio de 2014   1,00 % 1,85 % 1,89 % Clase de acciones de acumulación "I"   EUR   17 de junio de 2014   0,50 % 0,71 % 0,74 % Clase de acciones de acumulación "I"   Clase cubierta en USD)   USD   17 de junio d				.,		
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   EUR   15 de enero de 2014   0,50 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   Clase de acciones de acumulación "E"   EUR   15 de enero de 2014   0,50 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64						
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   EUR   15 de enero de 2014   0,50 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   Clase de acciones de acumulación "E"   EUR   15 de enero de 2014   0,50 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64 %   0,64	ESG-Enhanced Euro Short Duration Bond Plus Portfolio <sup>(c)</sup>					
Clase de acciones de acumulación "E"   EUR 15 de enero de 2014   0,25 % 0,35 % 0,35 % Clase de acciones de acumulación "I"   EUR 15 de enero de 2014   0,25 % 0,35 % 0,35 % Clase de acciones de acumulación "P"   EUR 15 de enero de 2014   0,25 % 0,35 % 0,35 % Clase de acciones de acumulación "P"   EUR 13 de mayo de 2014   0,35 % 0,49 % 0,49 % 0,49 % Clase de acciones de acumulación "R"   EUR 13 de mayo de 2014   0,25 % 0,39 % 0,39 % Clase de acciones de acumulación "R"   EUR 13 de mayo de 2014   0,25 % 0,39 % 0,39 % Clase de acciones de acumulación "R"   EUR 15 de enero de 2014   0,25 % 0,39 % 0,39 % Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   EUR 15 de enero de 2014   0,25 % 0,39 % 0,39 % Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   EUR 15 de enero de 2014   0,25 % 0,39 % 0,39 % Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   EUR 17 de junio de 2014   1,00 % 1,25 % 1,29 % Clase de acciones de acumulación en orras divisas (Clase cubierta en SEK)   EUR 17 de junio de 2014   1,00 % 1,25 % 1,29 % Clase de acciones de acumulación "I"   EUR 17 de junio de 2016   1,00 % 1,55 % 1,89 % Clase de acciones de acumulación "I"   EUR 17 de junio de 2014   1,00 % 1,55 % 1,89 % Clase de acciones de acumulación "I"   EUR 17 de junio de 2014   1,00 % 1,55 % 1,89 % Clase de acciones de acumulación "I"   EUR 17 de junio de 2014   1,00 % 1,55 % 1,89 % Clase de acciones de acumulación "I"   EUR 17 de junio de 2014   1,00 % 1,55 % 1,89 % Clase de acciones de acumulación "I"   EUR 17 de junio de 2014   1,00 % 1,55 % 1,89 % Clase de acciones de acumulación "I"   EUR 17 de junio de 2014   1,00 % 1,55 % 1,89 % Clase de acciones de acumulación "I"   EUR 17 de junio de 2014   1,00 % 1,55 % 1,89 % Clase de acciones de acumulación "I"   EUR 17 de junio de 2014   1,00 % 1,55 % 1,89 % Clase de acciones de acumulación "I"   EUR 17 de junio de 2014   1,00 % 1,55 % 1,89 % Clase de acciones de acumulación "I"   EUR 17 de junio de 2014   1,00 % 1,55 % 1,89 % Clase de	Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia					
Clase de acciones de acumulación "l"   EUR   15 de enero de 2014   0,25 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   Clase de acciones "l"   EUR   15 de enero de 2014   0,25 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,35 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %						
Clase de acciones "I"   EUR   15 de enero de 2014   0,25 %   0,35 %   0,35 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   0,4						
Clase de acciones de acumulación "P"						
Clase de acciones de acumulación "R"   EUR   13 de mayo de 2014   0,35 %   0,49 %   0,49 %   0,49 %   Clase de acciones de acumulación "R"   EUR   15 de enero de 2014   0,25 %   0,39 %   0,39 %   EUR   15 de enero de 2014   0,25 %   0,39 %   0,39 %   EUR   15 de enero de 2014   0,25 %   0,39 %   0,39 %   EUR   15 de enero de 2014   0,25 %   0,39 %   0,39 %   EUR   15 de enero de 2014   0,25 %   0,39 %   0,39 %   EUR   15 de enero de 2014   0,25 %   0,39 %   0,39 %   EUR   15 de enero de 2014   0,25 %   0,39 %   0,39 %   EUR   15 de enero de 2014   0,25 %   0,39 %   0,39 %   EUR   15 de enero de 2014   0,25 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39 %   0,39						
Clase de acciones "R"  ESG-Enhanced Europe High Yield Bond Portfolio(c)  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación en dras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación en dras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN) Clase de acciones de acumulación "E" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acum	Clase de acciones "P"	EUR			0,49 %	0,49 %
ESG-Enhanced Europe High Yield Bond Portfolio <sup>(c)</sup> Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de nominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de nominada en la divisa de referencia Clase de acciones de nominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN) Clase de acciones de acumulación "E" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones (mensual) (Dis) "P" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones (mensual) (Dis) "P" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "I" (Diso "D" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones (mensual) (Dis) "P" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "P"						
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN) Clase de acciones de acumulación "E" Clase de acciones de acumulación "E" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones (mensual) (Dis) "P" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "P"			15 de enero de 2014	0,25 %	0,39 %	0,39 %
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD) Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación = notras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN) Clase de acciones de acumulación "E" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones ("I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "P" Clase de acciones de acumulación "P			17 de junio de 2014	1.00.0/	1 25 0/	1 20 0/
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK)  Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)  Clase de acciones de acumulación "E"  EUR 17 de junio de 2014  1,00 % 1,25 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28 % 1,28						
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK)   SEK 6 de marzo de 2018   1,00 % 1,25 % 1,28 % Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)   PLN 27 de mayo de 2016   1,00 % 1,50 % 1,54 % Clase de acciones de acumulación "E"   EUR 17 de junio de 2014   1,00 % 1,85 % 1,89 % Clase de acciones de acumulación "I"   EUR 17 de junio de 2014   0,50 % 0,71 % 0,74 % Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)   USD 24 de noviembre de 2020   0,50 % 0,71 % 0,73 % Clase de acciones "I"   Clase de acciones "I"   Clase de acciones (mensual) (Dis) "P" (Clase cubierta en USD)   USD 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 % Clase de acciones de acumulación "P"   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 % Clase de acciones de acumulación "P"   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 % Clase de acciones de acumulación "P"   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70 % 0,95 % 0,99 %   EUR 17 de junio de 2014   0,70						
Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)   PLN   27 de mayo de 2016   1,00 %   1,50 %   1,54 %						
Clase de acciones de acumulación "I"   EUR 17 de junio de 2014   0,50 % 0,71 % 0,74 %	Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)	PLN	27 de mayo de 2016	1,00 %	1,50 %	1,54 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)						
Clase de acciones "I"       EUR 17 de junio de 2014       0,50 % 0,71 % 0,76 %         Clase de acciones (mensual) (Dis) "P" (Clase cubierta en USD)       USD 17 de junio de 2014       0,70 % 0,95 % 0,99 %         Clase de acciones de acumulación "P"       EUR 17 de junio de 2014       0,70 % 0,95 % 0,99 %						
Clase de acciones (mensual) (Dis) "P" (Clase cubierta en USD)         USD 17 de junio de 2014         0,70 % 0,95 % 0,99 %           Clase de acciones de acumulación "P"         EUR 17 de junio de 2014         0,70 % 0,95 % 0,99 %						
Clase de acciones de acumulàción "P"   EUR 17 de junio de 2014 0,70 % 0,95 % 0,99 %						
Totase de acciones de acumulación i i folase cubiena en obbj 17 de junio de 2014 0.70 % 0.93 % 0.99 %	Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD)	USD	17 de junio de 2014	0,70 %	0,95 %	0,99 %
Clase de acciones "P" EUR 17 de junio de 2014 0,70 % 0,95 % 0,99 %		EUR		0,70 %	0,95 %	
Clase de acciones de acumulación "R"         EUR         17 de junio de 2014         0,50 %         0,75 %         0,79 %						

	Divisa	Fecha de creación	Porcentaje de comisión de asesoramiento	Límite de gastos <sup>(a)</sup>	Ratio de gastos netos totales <sup>(b)</sup>
ESG-Enhanced Europe High Yield Bond Portfolio <sup>(c)</sup> (continuación)					
Clase de acciones "R"	EUR	17 de junio de 2014	0,50 %	0,75 %	0,81 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)  ESG-Enhanced Global Income Bond Portfolio <sup>(c)</sup>	GBP USD	17 de junio de 2014	0,50 %	0,75 %	0,79 %
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	16 de septiembre de 2020	1,00 %	1,25 %	1,25 %
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	16 de octubre de 2020	1,00 %	1,25 %	1,25 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	16 de septiembre de 2020		1,25 %	1,25 %
Clase de acciones (estable mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	16 de octubre de 2020	1,00 %	1,25 %	1,25 %
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis)	HKD	16 de octubre de 2020	1,00 %	1,25 %	1,25 %
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase cubierta en AUD)	AUD	16 de octubre de 2020	1,00 %	1,25 % 1,25 %	1,25 %
Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en SGD)	EUR SGD	16 de septiembre de 2020 16 de octubre de 2020	1,00 % 1,00 %	1,25 %	1,25 % 1,25 %
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Clase cubierta en SGD)  Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	16 de septiembre de 2020		1,25 %	1,25 %
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	9 de octubre de 2020	1,00 %	1,75 %	1,75 %
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	16 de septiembre de 2020		1,75 %	1,75 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) "I"	USD	16 de septiembre de 2020		0,71 %	0,71 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	16 de septiembre de 2020		0,71 %	0,71 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	9 de octubre de 2020	0,50 %	0,71 %	
Clase de acciones (mensual) (Dis) "P" Clase de acciones de acumulación "P"	USD	16 de septiembre de 2020 16 de septiembre de 2020		0,95 % 0,95 %	0,95 % 0,95 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R"	USD	16 de septiembre de 2020		0,75 %	
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	16 de septiembre de 2020		0,75 %	0,75 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	16 de septiembre de 2020	0,50 %	0,75 %	0,75 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	16 de septiembre de 2020	0,50 %	0,75 %	0,75 %
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio <sup>(c)</sup>	GBP	40 de distanta 1 0000	0.00.0	4.05.01	4.05.07
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones "!"	GBP GBP	18 de diciembre de 2008 18 de diciembre de 2008	0,80 % 0,40 %	1,05 % 0,61 %	1,05 % 0,61 %
Clase de acciones "P"	GBP	18 de diciembre de 2008	0,40 %	0,61 %	0,61 %
Clase de acciones de acumulación "R"	GBP	3 de diciembre de 2012	0,40 %	0,65 %	0,65 %
Clase de acciones "R"	GBP	10 de diciembre de 2012	0,40 %	0,65 %	0,65 %
Global Credit Portfolio (Hedged)	USD		•		
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	26 de enero de 2006	1,00 %	1,25 %	1,16 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	26 de enero de 2006	1,00 %	1,25 %	1,16 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones "A"	SEK	11 de abril de 2014	1,00 %	1,25 %	1,16 %
Clase de acciones A  Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	26 de enero de 2006 19 de febrero de 2009	1,00 % 1,00 %	1,50 % 1,50 %	1,41 % 1,41 %
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en duración)	USD	23 de octubre de 2013	0,40 %	0,61 %	0,49 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	23 de abril de 2012	0,40 %	0,61 %	0,49 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF)	CHF	13 de julio de 2010	0,40 %	0,61 %	0,49 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	16 de noviembre de 2007	0,40 %	0,61 %	0,49 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	23 de julio de 2013	0,40 %	0,61 %	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) (Clase cubierta en duración) <sup>(c)</sup>	GBP GBP	15 de diciembre de 2015	0,40 %	0,61 %	0,42 %
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	8 de abril de 2013 17 de septiembre de 2013	0,40 % 0,00 %	0,61 % 0,21 %	0,49 % 0,09 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP) (Clase cubierta en duración)(c)	GBP	29 de mayo de 2015	0,00 %	0,21 %	0,08 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en SEK)(c)	SEK	13 de agosto de 2021	0,00 %	0,21 %	0,11 %
Clase de acciones "IO"	USD	30 de junio de 2014	0,00 %	0,21 %	0,09 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO"	USD	7 de marzo de 2017	0,00 %	0,21 %	0,09 %
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	8 de septiembre de 2008	0,50 %	0,75 %	
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en duración) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)	USD	11 de septiembre de 2013 28 de octubre de 2008	0,50 % 0,50 %	0,75 % 0,75 %	0,64 % 0,64 %
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	29 de octubre de 2003	0,50 %	0,75 %	
Clase de acciones "P"	USD	8 de septiembre de 2008	0,50 %	0,75 %	
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	5 de agosto de 2014	0,50 %	0,75 %	
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)	GBP	19 de octubre de 2010	0,50 %	0,75 %	
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	10 de diciembre de 2012	0,40 %	0,65 %	
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en duración)	USD	29 de octubre de 2013	0,40 %	0,65 %	
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	5 de diciembre de 2012 11 de septiembre de 2013	0,40 % 0.40 %	0,65 % 0.65 %	
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EDR) (Clase cubierta en duración)  Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	15 de noviembre de 2017	0,40 %	0,65 %	0,56 %
Clase de acciones "R"	USD	10 de diciembre de 2012	0,40 %	0,65 %	0,56 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	27 de agosto de 2014	0,40 %	0,65 %	0,55 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	5 de diciembre de 2012	0,40 %	0,65 %	0,56 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) (Clase cubierta en duración)	GBP	3 de octubre de 2013	0,40 %	0,65 %	0,56 %
Global Fixed Income Portfolio	USD	44 de manifembre de 0005	4.00.0/	4.05.0/	4.05.0/
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	14 de noviembre de 2005	1,00 %	1,25 %	1,25 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones "A"	USD	26 de febrero de 1993 17 de enero de 2001	1,00 % 1,00 %	1,25 % 1,50 %	1,25 % 1,50 %
Clase de acciones 'B''(c)	USD	5 de marzo de 2001	1,00 %	2,50 %	2.50 %
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	31 de julio de 2001	1,00 %	1,50 %	1,50 %
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	31 de octubre de 2007	0,35 %	0,56 %	0,56 %
Clase de acciones de acumulación "I"(c)	USD	30 de abril de 2021	0,35 %	0,56 %	0,56 %
Clase de acciones "I"	USD	5 de diciembre de 2001	0,35 %	0,56 %	0,56 %
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	26 de septiembre de 2007	0,00 %	0,21 %	
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	29 de mayo de 2009	0,40 %	0,65 %	0,65 %
Clase de acciones "P" Clase de acciones de acumulación "R"	USD	29 de mayo de 2009 10 de diciembre de 2012	0,40 % 0,35 %	0,65 % 0,60 %	0,65 % 0,60 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	10 de diciembre de 2012 10 de diciembre de 2012	0,35 %	0,60 %	0,60 %
Global Fixed Income Portfolio (Hedged)	EUR	to de dicientible de 2012	0,35 %	0,00 %	0,00 %
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	EUR	14 de noviembre de 2005	1,00 %	1,25 %	1,16 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	EUR	17 de diciembre de 2001	1,00 %	1,25 %	1,16 %
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	18 de junio de 2007	1,00 %	1,50 %	1,41 %
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	28 de septiembre de 2007			

	Divisa	Fecha de creación	Porcentaje de comisión de asesoramiento		Ratio de gastos netos totales <sup>(b)</sup>
Global Fixed Income Portfolio (Hedged) (continuación)					
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en NOK)	NOK	26 de enero de 2018	0,35 %	0,56 %	0,45 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones "I"	USD EUR	23 de noviembre de 2018 17 de diciembre de 2001	0,35 % 0,35 %	0,56 % 0,56 %	0,45 % 0,45 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)	GBP	21 de junio de 2019	0,00 %	0,36 %	0,45 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD)	USD	2 de enero de 2013	0,00 %	0,21 %	0,10 %
Clase de acciones "IO" (Clase cubierta en USD)	USD	30 de junio de 2014	0,00 %	0,21 %	0,10 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO" (Clase cubierta en USD)	USD	21 de abril de 2015	0,00 %	0,21 %	0,09 %
Clase de acciones de acumulación "P"	EUR	29 de mayo de 2009	0,40 %	0,65 %	0,54 %
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en CHF)	CHF	31 de julio de 2013	0,40 %	0,65 %	0,55 %
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD)	USD	16 de julio de 2020	0,40 %	0,65 %	0,55 %
Clase de acciones "P" Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)	EUR GBP	29 de mayo de 2009 31 de diciembre de 2010	0,40 % 0,40 %	0,65 % 0,65 %	0,54 % 0,54 %
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en USD)	USD	31 de diciembre de 2010	0,40 %	0,65 %	0,53 %
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	3 de diciembre de 2012	0,35 %	0,60 %	0,52 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en USD)	USD	17 de octubre de 2014	0,35 %	0,60 %	0,52 %
Clase de acciones "R" Clase de acciones "R" (Clase cubierta en CHF)	EUR CHF	3 de diciembre de 2012 10 de marzo de 2017	0,35 % 0,35 %	0,60 % 0,60 %	0,52 % 0,52 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	5 de diciembre de 2012	0,35 %	0,60 %	0,51 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD)	USD	5 de diciembre de 2012	0,35 %	0,60 %	0,52 %
Global High Yield Portfolio	USD	14 de noviembre de 200E	4.40.0/	1 25 0/	1 24 0/
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)	USD	14 de noviembre de 2005 13 de julio de 2011	1,10 % 1,10 %	1,35 % 1,35 %	1,24 % 1,24 %
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en SEK)	SEK	10 de noviembre de 2010	1,10 %	1,35 %	1,24 %
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	1 de diciembre de 2017	1,10 %	1,35 %	1,24 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	15 de abril de 2011	1,10 %	1,35 %	1,23 %
Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en duración)	USD	25 de octubre de 2013	1,10 %	1,35 %	1,24 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	27 de enero de 1998	1,10 %	1,35 %	1,24 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en duración)	USD HKD	13 de julio de 2011	1,10 %	1,35 % 1,35 %	1,24 %
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en AUD)	AUD	30 de enero de 2019 27 de marzo de 2015	1,10 % 1,10 %	1,35 %	1,24 % 1,24 %
Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en HKD) (Clase cubierta en duración) <sup>(c)</sup>	HKD	8 de noviembre de 2013	1,10 %	1,35 %	1,24 %
Clase de acciones en otras divisas (trimestral) (Dis) (Clase cubierta en CHF) (Clase cubierta en duración)	CHF	4 de octubre de 2013	1,10 %	1,35 %	1,24 %
Clase de acciones en otras divisas (trimestral) (Dis) (Clase cubierta en SGD) (Clase cubierta en duración)	SGD	16 de agosto de 2013	1,10 %	1,35 %	1,24 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF) (Clase cubierta en duración)	CHF	4 de octubre de 2013	1,10 %	1,35 %	1,24 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	18 de diciembre de 2008	1,10 %	1,35 %	1,24 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en CHF)	EUR CHF	13 de julio de 2011 7 de agosto de 2014	1,10 % 1,10 %	1,35 % 1,35 %	1,24 % 1,23 %
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en GBP)	GBP	9 de diciembre de 2009	1,10 %	1,35 %	1,24 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"	USD	5 de mayo de 2011	1,10 %	1,60 %	1,49 %
Clase de acciones "A"	USD	5 de marzo de 2001	1,10 %	1,60 %	1,49 %
Clase de acciones "B"	USD	5 de marzo de 2001	1,10 %	2,60 %	2,49 %
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR EUR	21 de abril de 2011	1,10 %	1,85 %	1,74 %
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración) Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	13 de julio de 2011 31 de julio de 2001	1,10 % 1,10 %	1,85 % 1,85 %	1,74 % 1,74 %
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	4 de mayo de 2010	1,10 %	1,85 %	1,74 %
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	13 de julio de 2011	1,10 %	1,85 %	1,74 %
Clase de acciones "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	7 de mayo de 1999	1,10 %	1,35 %	1,24 %
Clase de acciones "G"(c)	USD	30 de noviembre de 2018	0,00 %	0,25 %	0,09 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" Clase de acciones (mensual) (Dis) "I" (Clase cubierta en EUR)	USD EUR	17 de enero de 2014 7 de diciembre de 2017	0,60 % 0,60 %	0,86 % 0,86 %	0,67 % 0,67 %
Clase de acciones (mensual) (bis) 1 (clase cubierta en Euro)  Clase de acciones de acumulación "I"	USD	13 de septiembre de 2007		0,86 %	0,67 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en duración)	USD	17 de agosto de 2011	0,60 %	0,86 %	0,67 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	26 de octubre de 2007	0,60 %	0,86 %	0,67 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	3 de junio de 2009	0,60 %	0,86 %	0,67 %
Clase de acciones "I"	EUR	1 de abril de 2014	0,60 %	0,86 %	0,67 %
Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	USD EUR	3 de mayo de 2001 27 de julio de 2009	0,60 % 0,60 %	0,86 % 0,86 %	0,67 % 0,67 %
Clase de acciones " (Clase cubierta en CBP)	GBP	25 de octubre de 2007	0,60 %	0,86 %	0,67 %
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP) (Clase cubierta en duración)	GBP	28 de julio de 2011	0,60 %	0,86 %	0,67 %
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "IO" (Clase cubierta en AUD)	AUD	25 de marzo de 2013	0,00 %	0,26 %	0,07 %
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	26 de septiembre de 2007		0,26 %	0,07 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en EUR)	EUR	10 de diciembre de 2007	0,00 %	0,26 %	0,07 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en JPY)	GBP JPY	30 de abril de 2008 25 de agosto de 2016	0,00 % 0,00 %	0,26 % 0,26 %	0,07 % 0,07 %
Clase de acciones "IO"	USD	20 de junio de 2006	0,00 %	0,26 %	0,07 %
Clase de acciones de acumulación "IS"	USD	9 de mayo de 2014	0,48 %	0,58 %	0,55 %
Clase de acciones de acumulación "IS" (Clase cubierta en CHF)	CHF	9 de mayo de 2014	0,48 %	0,58 %	0,55 %
Clase de acciones de acumulación "IS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	9 de mayo de 2014	0,48 %	0,58 %	0,55 %
Clase de acciones de acumulación "IS" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "IS"	GBP USD	9 de mayo de 2014 22 de julio de 2014	0,48 %	0,58 %	0,55 %
Clase de acciones "IS" (Clase cubierta en GBP)	GBP	12 de julio de 2014 12 de agosto de 2014	0,48 % 0,48 %	0,58 % 0,58 %	0,55 % 0,55 %
Clase de acciones 13 (Clase cubierta en GBP)  Clase de acciones de accimulación "P"	USD	3 de mayo de 2017	0,48 %	1,15 %	1,03 %
Clase de acciones "P"	USD	3 de mayo de 2017	0,90 %	1,15 %	1,03 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en AUD)	AUD	27 de octubre de 2015	0,60 %	0,85 %	0,74 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	3 de diciembre de 2012	0,60 %	0,85 %	0,74 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF)	CHF	4 de noviembre de 2013	0,60 %	0,85 %	0,74 %

	Divisa	Fecha de creación	Porcentaje de comisión de asesoramiento	Límite de gastos <sup>(a)</sup>	Ratio de gastos netos totales <sup>(b)</sup>
Global High Yield Portfolio (continuación)					
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF) (Clase cubierta en duración)	CHF	4 de octubre de 2013	0,60 %	0,85 %	
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en duración) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	USD	16 de marzo de 2015	0,60 % 0,60 %	0,85 %	
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR) (Clase cubierta en duración)	EUR	5 de diciembre de 2012 4 de abril de 2013	0,60 %	0,85 % 0,85 %	
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EEK)	SEK	27 de octubre de 2015	0,60 %	0,85 %	
Clase de acciones "R"	USD	3 de diciembre de 2012	0,60 %	0,85 %	
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en CHF)	CHF	13 de marzo de 2015	0,60 %	0,85 %	
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en duración)	USD	21 de mayo de 2013	0,60 %	0,85 %	0,74 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	5 de diciembre de 2012	0,60 %	0,85 %	
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	5 de diciembre de 2012	0,60 %	0,85 %	0,74 %
Global Sovereign Bond Portfolio	USD	00 de de 0045	4.40.0/	4.05.0/	4 00 0/
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	22 de mayo de 2015 22 de mayo de 2015	1,10 % 1,10 %	1,35 % 1,35 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	22 de mayo de 2015 22 de mayo de 2015	0,55 %	0,76 %	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	22 de mayo de 2015	0,55 %	0,76 %	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	23 de julio de 2015	0,55 %	0,76 %	
Clase de acciones "I"	USD	22 de mayo de 2015	0,55 %	0,76 %	0,70 %
Clase de acciones "I" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	23 de octubre de 2015	0,55 %	0,76 %	0,71 %
Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio	USD	4 1 1 1 1 2 2 2 2	4.50.0/	4 75 0/	4 75 0/
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	4 de abril de 2012	1,50 % 1,50 %	1,75 % 1,75 %	1,75 % 1,75 %
Clase de acciones (trimestral) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	4 de abril de 2012 4 de abril de 2012	1,50 %	1,75 %	
Clase de acciones en otras divisas (trimestral) (Dis) (Clase cubierta en EUR)	EUR	4 de abril de 2012	1,50 %	1,75 %	
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	4 de abril de 2012	1,50 %	1,75 %	
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "A"	USD	4 de abril de 2012	1,50 %	2,25 %	2,25 %
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	8 de agosto de 2012	1,50 %	2,25 %	
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	13 de noviembre de 2019		2,25 %	
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones (trimestral) (Dis) "I" (Clase cubierta en GBP)	EUR GBP	4 de abril de 2012 4 de abril de 2012	1,50 % 0,70 %	2,25 % 0,91 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	23 de octubre de 2019	0,70 %	0,91 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	4 de abril de 2012	0,70 %	0,91 %	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	4 de abril de 2012	0,70 %	0,91 %	
Clase de acciones "I"	USD	4 de abril de 2012	0,70 %	0,91 %	
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO"(c)	USD	30 de mayo de 2014	0,00 %	0,21 %	
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "P"	USD	1 de agosto de 2012	1,00 % 1,00 %	1,25 % 1,25 %	
Clase de acciones de acumulación "P" Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	4 de abril de 2012 4 de abril de 2012	1,00 %	1,25 %	
Clase de acciones "P"	USD	4 de abril de 2012	1,00 %	1,25 %	
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	4 de abril de 2012	1,00 %	1,25 %	
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)	GBP	4 de abril de 2012	1,00 %	1,25 %	
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "R"	USD	13 de diciembre de 2012	0,70 %	0,95 %	
Clase de acciones de acumulación "R" Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	USD	13 de diciembre de 2012 5 de diciembre de 2012	0,70 % 0,70 %	0,95 % 0,95 %	
Clase de acciones de acumulación R (Clase cubierta en EOR)  Clase de acciones "R"	USD	13 de diciembre de 2012	0,70 %	0,95 %	
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	5 de diciembre de 2012	0,70 %	0,95 %	
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	5 de diciembre de 2012	0,70 %	0,95 %	0,95 %
US Dollar Short Duration Bond Portfolio	USD				
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	6 de junio de 2016	0,20 %	0,30 %	
Clase de acciones "I" Clase de acciones de acumulación "P"	USD	6 de junio de 2016 6 de junio de 2016	0,20 % 0,30 %	0,30 % 0,44 %	
Clase de acciones "P"	USD	6 de junio de 2016	0,30 %	0,44 %	
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	15 de marzo de 2018	0,20 %	0,34 %	
Clase de acciones "R"	USD	6 de junio de 2016	0,20 %	0,34 %	0,34 %
US Fixed Income Portfolio	USD				
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	14 de noviembre de 2005		1,25 %	
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	5 de mayo de 2011 27 de julio de 1998	1,00 % 1,00 %	1,25 % 1,25 %	
Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"	USD	5 de mayo de 2011	1.00 %		1,50 %
Clase de acciones "A"	USD	5 de marzo de 2001	1,00 %	1,50 %	1,50 %
Clase de acciones "B"	USD	5 de marzo de 2001	1,00 %	2,50 %	2,50 %
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	31 de julio de 2001	1,00 %	1,50 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	15 de febrero de 2007	0,35 %	0,56 %	
Clase de acciones "I"  Clase de acciones (mansual) (Dis) "P"	USD	13 de noviembre de 2001		0,56 %	
Clase de acciones (mensual) (Dis) "P" Clase de acciones de acumulación "P"	USD	5 de mayo de 2011 29 de mayo de 2009	0,45 % 0,45 %	0,70 % 0,70 %	
Clase de acciones de acumulación P  Clase de acciones "P"	USD	29 de mayo de 2009 29 de mayo de 2009	0,45 %	0,70 %	
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	3 de diciembre de 2012	0,35 %	0,60 %	
Clase de acciones "R"	USD	3 de diciembre de 2012	0,35 %	0,60 %	
US Mortgage Backed Securities Portfolio	USD		_		, _
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	14 de noviembre de 2005		1,05 %	
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)	USD	30 de septiembre de 2002 26 de mayo de 2016	2 0,80 % 0,80 %	1,05 % 1,30 %	
Clase de acciones de accimiliación A (Clase cubierta en PLN)  Clase de acciones "A"	USD	19 de febrero de 2003	0,80 %	1,30 %	
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	19 de octubre de 2012	0,80 %	1,30 %	
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	20 de enero de 2016	0,30 %	0,46 %	0,43 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	31 de octubre de 2007	0,30 %	0,46 %	
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	20 de mayo de 2009	0,30 %	0,46 %	
Clase de acciones "I" Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IO"	USD	30 de septiembre de 2002 14 de junio de 2016	2 0,30 % 0,00 %	0,46 % 0,16 %	
Clase de acciones (mensuar) (Dis) (Cap) 10  Clase de acciones "IO"	USD	3 de julio de 2016	0,00 %	0,16 %	
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	29 de mayo de 2009	0,45 %	0,70 %	
Clase de acciones "P"	USD	29 de mayo de 2009	0,45 %	0,70 %	

	Divisa	Fecha de creación	Porcentaje de comisión de asesoramiento	Límite de gastos <sup>(a)</sup>	Ratio de gastos netos totales <sup>(b)</sup>
US Mortgage Backed Securities Portfolio (continuación)				<b>J</b>	
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	3 de diciembre de 2012	0,30 %	0,55 %	0,49 %
Clase de acciones "R"	USD	3 de diciembre de 2012	0,30 %	0,55 %	0,47 %
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio  Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	14 de diciembre de 2017	1,40 %	1,80 %	1,80 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) denominada en la divisa de referencia	USD	14 de diciembre de 2017	1,40 %	1,80 %	1,80 %
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	14 de diciembre de 2017	1,40 %	1,80 %	1,80 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	17 de enero de 2018	1,40 %	1,80 %	1,80 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	14 de diciembre de 2017	1,40 %	1,80 %	1,80 %
Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Cap) (Clase parcialmente cubierta en AUD)	AUD	14 de diciembre de 2017	1,40 %	1,80 %	1,80 %
Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Cap) (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	9 de marzo de 2018	1,40 %	1,80 %	1,80 %
Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Cap) (Clase parcialmente cubierta en GBP) Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Cap) (Clase parcialmente cubierta en SGD)	GBP SGD	14 de diciembre de 2017	1,40 % 1,40 %	1,80 % 1,80 %	1,80 % 1,80 %
Clase de acciones en otras divisas (friensual) (Dis) (Cap) (Clase parcialmente cubierta en 30D)  Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis)	HKD	14 de diciembre de 2017 28 de junio de 2019	1,40 %	1,80 %	1,80 %
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase parcialmente cubierta en AUD)	AUD	14 de diciembre de 2017	1,40 %	1,80 %	1,80 %
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	14 de diciembre de 2017	1,40 %	1,80 %	1,80 %
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase parcialmente cubierta en SGD)	SGD	14 de diciembre de 2017	1,40 %	1,80 %	1,80 %
Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	17 de enero de 2018	1,40 %	2,40 %	2,40 %
Clase de acciones "E"	EUR	17 de enero de 2018	1,40 %	2,40 %	2,40 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	14 de diciembre de 2017	0,70 %	1,06 %	1,06 %
Clase de acciones "I"	USD	14 de diciembre de 2017	0,70 % 1,20 %	1,06 % 1,60 %	1,06 %
Clase de acciones de acumulación "P" Clase de acciones "P"	USD	14 de diciembre de 2017 14 de diciembre de 2017	1,20 %	1,60 %	1,60 % 1,60 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	14 de diciembre de 2017	0,70 %	1,10 %	1,10 %
Clase de acciones "R"	USD	14 de diciembre de 2017	0,70 %	1,10 %	1,10 %
ESG-Enhanced Global Multi-Asset Balanced Portfolio <sup>(c)</sup>	USD		-, /0	,,0	,,0
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	30 de junio de 2014	1,35 %	1,60 %	1,60 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	30 de junio de 2014	1,35 %	1,60 %	1,60 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	11 de febrero de 2019	1,35 %	1,60 %	1,60 %
Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	30 de junio de 2014	1,35 %	1,60 %	1,60 %
Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	30 de junio de 2014	1,35 % 1.35 %	1,60 %	1,60 %
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase parcialmente cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I"	EUR USD	30 de junio de 2014 30 de junio de 2014	0,65 %	2,10 % 0,86 %	2,10 % 0,86 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	6 de febrero de 2018	0,65 %	0,86 %	0,86 %
Clase de acciones "I"	USD	30 de junio de 2014	0,65 %	0,86 %	0,86 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	6 de febrero de 2018	0,65 %	0,90 %	0,90 %
Clase de acciones "R" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	30 de junio de 2014	0,65 %	0,90 %	0,90 %
Global Multi-Asset Conservative Portfolio	USD				
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	30 de junio de 2014	1,25 %	1,50 %	1,39 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	30 de junio de 2014	1,25 %	1,50 %	1,39 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR EUR	11 de febrero de 2019	1,25 % 1,25 %	1,50 % 1,50 %	1,39 % 1,38 %
Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	30 de junio de 2014 30 de junio de 2014	1,25 %	1,50 %	1,36 %
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	30 de junio de 2014	1,25 %	2,00 %	1,89 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	30 de junio de 2014	0,60 %	0,81 %	0,70 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	6 de febrero de 2018	0,60 %	0,81 %	0,70 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	31 de mayo de 2019	0,60 %	0,81 %	0,70 %
Clase de acciones "I"	USD	30 de junio de 2014	0,60 %	0,81 %	0,70 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR GBP	6 de febrero de 2018	0,60 %	0,85 %	0,74 %
Clase de acciones "R" (Clase parcialmente cubierta en GBP)  Global Multi-Asset Growth Portfolio	USD	30 de junio de 2014	0,60 %	0,85 %	0,74 %
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	30 de junio de 2014	1,50 %	1,75 %	1,71 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	30 de junio de 2014	1.50 %	1,75 %	1,72 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	11 de febrero de 2019	1,50 %	1,75 %	1,72 %
Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	30 de junio de 2014	1,50 %	1,75 %	1,71 %
Clase de acciones en otras divisas (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	30 de junio de 2014	1,50 %	1,75 %	1,71 %
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	30 de junio de 2014	1,50 %	2,25 %	2,22 %
Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	USD	30 de junio de 2014 6 de febrero de 2018	0,75 % 0,75 %	0,96 % 0,96 %	
Clase de acciones "I"	USD	30 de junio de 2014	0,75 %	0,96 %	0,92 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase parcialmente cubierta en EUR)	EUR	6 de febrero de 2018	0,75 %	1,00 %	0,92 %
Clase de acciones "R" (Clase parcialmente cubierta en GBP)	GBP	30 de junio de 2014	0,75 %	1,00 %	0,97 %
Global Multi-Asset Income Portfolio	USD	•	, - ,-		
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	18 de marzo de 2014	1,25 %	1,55 %	1,55 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) denominada en la divisa de referencia	USD	2 de mayo de 2018	1,25 %	1,55 %	1,55 %
Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	18 de marzo de 2014	1,25 %	1,55 %	1,55 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	18 de marzo de 2014	1,25 %	1,55 %	1,55 %
Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis) (Clase cubierta en AUD)	HKD AUD	28 de junio de 2019 28 de junio de 2019	1,25 % 1,25 %	1,55 % 1,55 %	1,55 % 1,55 %
Clase de acciones en otras divisas (ordia mensual) (Dis) (Clase cubierta en AOD)  Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en EUR)	EUR	19 de abril de 2016	1,25 %	1,55 %	1,55 %
Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en SGD) <sup>(c)</sup>	SGD	1 de diciembre de 2020	1,25 %	1,55 %	1,55 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	30 de agosto de 2016	1,25 %	1,55 %	1,55 %
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	18 de marzo de 2014	1,25 %	1,55 %	1,55 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) "A"	USD	10 de abril de 2015	1,25 %	2,05 %	2,05 %
Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	13 de enero de 2016	1,25 %	2,15 %	2,15 %
Clase de acciones (trimestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	25 de abril de 2014	1,25 %	2,15 %	2,15 %
Clase de acciones (estable mensual) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	19 de abril de 2016	1,25 %	2,15 %	2,15 %
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación "I"	EUR USD	18 de marzo de 2014 18 de marzo de 2014	1,25 % 0,60 %	2,15 % 0,86 %	2,15 % 0,86 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	9 de julio de 2014	0,60 %	0,86 %	0,86 %
Clase de acciones "I"	USD	18 de marzo de 2014	0,60 %	0,86 %	0,86 %
	USD	18 de marzo de 2014	1,00 %	1,30 %	1,30 %
Clase de acciones de acumulación "P"					

	Divisa	Fecha de creación	Porcentaje de comisión de asesoramiento		Ratio de gastos netos totales <sup>(b)</sup>
Global Multi-Asset Income Portfolio (continuación)	ODD	44	0.00.0/	0.00.0/	0.00.0/
Clase de acciones "R" (bruta mensual) (Dis) (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	GBP EUR	11 de abril de 2014 18 de marzo de 2014	0,60 % 0,60 %	0,90 % 0,90 %	0,90 % 0,90 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	18 de marzo de 2014	0,60 %	0,90 %	0,90 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	18 de marzo de 2014	0,60 %	0,90 %	0,90 %
US Real Estate Balanced Portfolio	USD				
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	2 de octubre de 2012	1,50 %	1,90 %	1,76 %
Clase de acciones (Cap) (bruta mensual MBS) (Dis) denominada en la divisa de referencia Clase de acciones (mensual MBS) (Dis) (Cap) denominada en la divisa de referencia	USD	26 de mayo de 2016 2 de octubre de 2012	1,50 % 1,50 %	1,90 % 1,90 %	1,76 % 1,76 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	12 de febrero de 2013	1,50 %	1,90 %	1,78 %
Clase de acciones en otras divisas (Cap) (bruta mensual MBS) (Dis) (Clase cubierta en SGD)	SGD	26 de mayo de 2016	1,50 %	1,90 %	1,76 %
Clase de acciones en otras divisas (Cap) (mensual MBS) (Dis) (Clase cubierta en SGD)	SGD	2 de octubre de 2012	1,50 %	1,90 %	1,76 %
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	2 de octubre de 2012	1,50 %	2,40 %	2,26 %
Clase de acciones (mensual MBS) (Dis) (Cap) "I"	USD	31 de octubre de 2012	0,70 %	1,06 %	0,89 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) "!" Clase de acciones de acumulación "!"	USD	12 de febrero de 2013 2 de octubre de 2012	0,70 % 0,70 %	1,06 % 1,06 %	0,89 % 0,89 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	15 de febrero de 2013	0,70 %	1,06 %	0,89 %
Clase de acciones (mensual MBS) (Dis) (Cap) "P"	USD	2 de octubre de 2012	1,00 %	1,40 %	1,24 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) "P"	USD	12 de febrero de 2013	1,00 %	1,40 %	1,24 %
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	2 de octubre de 2012	1,00 %	1,40 %	1,24 %
Clase de acciones (mensual MBS) (Dis) (Cap) "R"	USD	15 de noviembre de 2017		1,10 %	0,96 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" Clase de acciones (mensual) (Dis) "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	17 de agosto de 2016 17 de agosto de 2016	0,70 % 0,70 %	1,10 % 1,10 %	0,96 % 0,97 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	13 de diciembre de 2012	0,70 %	1,10 %	0,96 %
Clase de acciones "R"	USD	13 de diciembre de 2012	0,70 %	1,10 %	0,96 %
Emerging Markets Total Return Bond Portfolio <sup>(d)</sup>	USD				
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	21 de noviembre de 2017		1,45 %	1,49 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	21 de noviembre de 2017		1,45 %	1,57 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR EUR	21 de noviembre de 2017 21 de noviembre de 2017		1,45 % 1,45 %	1,55 % 1,55 %
Clase de acciones en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	21 de noviembre de 2017 21 de noviembre de 2017		1,95 %	1,98 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	21 de noviembre de 2017		0,81 %	0,99 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	16 de abril de 2019	0,60 %	0,81 %	1,00 %
Clase de acciones "I"	USD	21 de noviembre de 2017		0,81 %	1,03 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en AUD)	AUD	21 de noviembre de 2017		0,21 %	0,21 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	GBP EUR	20 de noviembre de 2019 21 de noviembre de 2017	.,	0,21 %	0,21 % 0,99 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EDR)  Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	21 de noviembre de 2017 21 de noviembre de 2017		0,85 % 0,85 %	1,05 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	21 de noviembre de 2017		0,85 %	1,03 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	21 de noviembre de 2017		0,85 %	1,05 %
Global Absolute Return Portfolio	USD				
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	27 de agosto de 2015	1,25 %	1,50 %	1,50 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	USD	27 de agosto de 2015 27 de agosto de 2015	1,25 % 1,25 %	1,50 % 1,50 %	1,50 % 1,50 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK)	SEK	9 de octubre de 2015	1,25 %	1,50 %	1,50 %
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	27 de agosto de 2015	1,25 %	2,00 %	2,00 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	27 de agosto de 2015	0,60 %	0,81 %	0,81 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	27 de agosto de 2015	0,60 %	0,81 %	0,81 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	27 de agosto de 2015	0,60 %	0,81 %	0,81 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en JPY)	JPY	29 de junio de 2018	0,60 %	0,81 %	0,81 %
Clase de acciones "I" Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	USD	27 de agosto de 2015 27 de agosto de 2015	0,60 % 0,60 %	0,81 % 0,81 %	0,81 % 0,81 %
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	3 de noviembre de 2017	0,60 %	0,81 %	0,81 %
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	27 de agosto de 2015	0,00 %	0,21 %	0,21 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)(c)	GBP	8 de septiembre de 2021	0,00 %	0,21 %	0,21 %
Clase de acciones "IO"	USD	27 de agosto de 2015	0,00 %	0,21 %	0,21 %
Clase de acciones de acumulación "P"(c)	USD	27 de agosto de 2015	0,80 %	1,05 %	1,05 %
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR) <sup>(c)</sup> Clase de acciones "P" <sup>(c)</sup>	EUR	27 de agosto de 2015 27 de agosto de 2015	0,80 % 0,80 %	1,05 % 1,05 %	1,05 % 1,05 %
Clase de acciones P (4)  Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	27 de agosto de 2015 27 de agosto de 2015	0,60 %	0,85 %	0,85 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	27 de agosto de 2015 27 de agosto de 2015	0,60 %	0,85 %	0,85 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	27 de agosto de 2015	0,60 %	0,85 %	0,85 %
Global Dynamic Bond Portfolio <sup>(d)(c)</sup>	USD				
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	28 de junio de 2006	0,60 %	0,85 %	0,82 %
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR)	EUR USD	28 de junio de 2006	0,60 %	0,85 % 0,85 %	0,82 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR)	EUR	28 de junio de 2006 28 de junio de 2006	0,60 % 0,60 %	0,85 %	0,82 % 0,81 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en CBP)	GBP	18 de septiembre de 2006		0,85 %	0,81 %
Clase de acciones "A"	USD	30 de marzo de 2007	0,60 %	1,10 %	1,07 %
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	16 de julio de 2007	0,60 %	1,10 %	1,07 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	19 de julio de 2007	0,25 %	0,40 %	0,40 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD)(c)	AUD	12 de marzo de 2021	0,25 %	0,40 %	0,38 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR EUR	23 de noviembre de 2007 5 de septiembre de 2006	0,25 % 0,25 %	0,40 % 0,40 %	0,40 % 0,39 %
Clase de acciones 1 (Clase cubierta en EUR)  Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)	GBP	16 de julio de 2007	0,25 %	0,40 %	0,39 %
Clase de acciones "IO" (Clase cubierta en AUD)	AUD	19 de marzo de 2015	0,00 %	0,15 %	0,14 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	3 de diciembre de 2012	0,25 %	0,50 %	0,47 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	5 de diciembre de 2012	0,25 %	0,50 %	0,47 %
		3 de diciembre de 2012	0,25 %	0,50 %	0,52 %
Clase de acciones "R"	USD				
Clase de acciones "R" Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	5 de diciembre de 2012	0,25 %	0,50 %	0,47 %
Clase de acciones "R"					

## Goldman Sachs Funds Anexo II—Porcentajes de la comisión de asesoramiento, Límites de gastos y Ratios de gastos netos totales (sin auditar) A 30 de noviembre de 2021

Clase de acciones denominada en la divasa di referencia   USD   28 de marzo de 2011   1,20 %   1,45 %   1,37		Divisa	Fecha de creación	Porcentaje de comisión de asesoramiento		Ratio de gastos netos totales <sup>(b)</sup>
Clase de acciones denominade en la divisa de referencia   USD   28 de marzo de 2011   1,20 % 1,45 % 1,33						
Clase de acciones en oras divisas (trimestral) (Dis) (Clase cuberta en SGD)   SGD   13 de aspettembre de 2013   1.2 %   1.45 %   1.38						1,38 %
Clase de acciones de accumiación en otras divisas (Clase cuberta en CHF)   Chef   5 de julio de 2013   1,2 %   1,45 %   1,38						
Clase de acciones de accumiación en orbas divisas (Clase cubierta en EUR)   EUR   6 de abrid de 2011   1,20 %   1,45 %   1,37						1,37 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SEK)   SEK   20 de septiembre de 2013   1,2%   1,45 %   1,38						1,38 %
Clase de acciones en ords divisas (Clase cubierta en GBP)   GBP   Ge abril de 2011   1.20 %   1.45 %   1.38						1,37 %
Clase de acciones en oras divisas (Clase cubierta en GBP)   Clase de acciones (nemaula) (Dis) *\footnotes (Parama) (Dis) *\foot						1,38 %
Clase de acciones (mensual) (bis) "A"   1.20 % 1.70 % 1.63						1,38 %
Clase de acciones (**   1.20 %   1.70 %   1.50						
Clase de acciones (timestral) (Dis) "E" (Clase cubierta en EUR)   EUR						1,63 %
Clase de acciones de accumisación "E" (Clase cubierta en CBP)						1,88 %
Clase de acciones (mensual) (Dis )** (Clase cubierta en GBP)						1,88 %
Clase de acciones (semestral) (Dis) 1" (Clase cubierta en JPY)   JPY   7 de agosto de 2014   0,60 % 0,81 % 0,77   Clase de acciones de acumulación 1" (Clase cubierta en CHF)   USD   28 de marzo de 2011   0,60 % 0,81 % 0,77   Clase de acciones de acumulación 1" (Clase cubierta en CHF)   Clase de acciones de acumulación 1" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación 1" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación 1" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación 1" (Clase cubierta en JPY)   JPY   3 de marzo de 2014   0,60 % 0,81 % 0,77   Clase de acciones de acumulación 1" (Clase cubierta en JPY)   JPY   3 de marzo de 2014   0,60 % 0,81 % 0,77   Clase de acciones de acumulación 1" (Clase cubierta en JPY)   JPY   3 de marzo de 2014   0,60 % 0,81 % 0,77   Clase de acciones 1" (Clase cubierta en EUR)   USD   28 de marzo de 2014   0,60 % 0,81 % 0,77   Clase de acciones 1" (Clase cubierta en GBP)   USD   28 de marzo de 2014   0,60 % 0,81 % 0,77   Clase de acciones 1" (Clase cubierta en GBP)   USD   28 de marzo de 2014   0,60 % 0,81 % 0,77   Clase de acciones 1" (Clase cubierta en GBP)   GBP						0,16 %
Clase de acciones de acumulación "Ir"   Clase cubierta en CHF)						
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK) Clase de acciones "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones (mensual) (Dis) (Da) "A'D' Clase de acciones (mensual) (Dis) (Da) "A'D' Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de ac						0,71 %
Clase de acciones de acumulación "1" (Clase cubierta en EUR)   EUR   28 de marzo de 2011   0.60 % 0.81 % 0.71   Clase de acciones de acumulación "1" (Clase cubierta en IPY)   IPY   3 de marzo de 2014   0.60 % 0.81 % 0.71   Clase de acciones de acumulación "1" (Clase cubierta en IPY)   IPY   3 de marzo de 2014   0.60 % 0.81 % 0.71   Clase de acciones "1"   Clase de acciones "1"   EUR   11 de julido de 2014   0.60 % 0.81 % 0.71   Clase cubierta en EUR)   EUR   11 de julido de 2014   0.60 % 0.81 % 0.71   Clase de acciones "1"   EUR   11 de julido de 2014   0.60 % 0.81 % 0.71   Clase de acciones "1"   EUR   11 de julido de 2014   0.60 % 0.81 % 0.71   Clase de acciones "1"   Clase cubierta en EUR)   EUR   28 de marzo de 2011   0.60 % 0.81 % 0.71   Clase de acciones "1"   Clase cubierta en EUR   EUR   28 de marzo de 2011   0.60 % 0.81 % 0.71   Clase de acciones "1"   Clase cubierta en GBP   Clase de acciones de acumulación "10" (Clase cubierta en GBP)   GBP   13 de febrero de 2015   0.60 % 0.21 % 0.71 % 0.61   Clase de acciones de acumulación "10" (Clase cubierta en GBP)   GBP   4 de diciembre de 2015   0.50 % 0.71 % 0.61   Clase de acciones ("1"   Clase de acciones "1"   Clase cubierta en GBP)   GBP   4 de diciembre de 2017   0.50 % 0.71 % 0.61   Clase de acciones ("1"   Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)   USD   5 de marzo de 2011   0.80 % 1.05 % 0.85   Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)   USD   28 de marzo de 2011   0.80 % 1.05 % 0.85   Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)   USD   28 de marzo de 2011   0.80 % 1.05 % 0.85   Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)   USD   28 de marzo de 2011   0.80 % 1.05 % 0.85   Clase de a						0,71 %
Clase de acciones de acumulación 1" (Clase cubierta en GBP)						0,71 %
Clase de acciones de acumulación 1" (Clase cubierta en SEK)						0,71 %
Clase de acciones de acumulación 1" (Clase cubierta en SEK)   SEK   28 de mayor de 2014   0,60 % 0,81 % 0,71   Clase de acciones 1" (Clase cubierta en AUD)   USD   28 de marzo de 2011   0,60 % 0,81 % 0,71   Clase de acciones 1" (Clase cubierta en EUR)   EUR   1 de julio de 2014   0,60 % 0,81 % 0,71   Clase de acciones 1" (Clase cubierta en EUR)   EUR   28 de marzo de 2011   0,60 % 0,81 % 0,71   Clase de acciones 1" (Clase cubierta en EUR)   EUR   28 de marzo de 2011   0,60 % 0,81 % 0,71   Clase de acciones 4 excumulación 1"S"   USD   30 de septiembre de 2015   0,60 % 0,81 % 0,77   Clase de acciones 4 de acumulación 1"S"   USD   40 de idiciembre de 2015   0,50 % 0,71 % 0,61   Clase de acciones 4 de acumulación 1"S"   USD   40 de idiciembre de 2015   0,50 % 0,71 % 0,61   Clase de acciones 4 de acumulación 1"S"   USD   40 de idiciembre de 2017   0,50 % 0,77 % 0,61   Clase de acciones 4 de acumulación 1"S"   USD   40 de idiciembre de 2017   0,50 % 0,77 % 0,61   Clase de acciones 4 de acumulación 1"C   Clase cubierta en EUR   USD						0,71 %
Clase de acciones 1"   Clase cubierta en AUD    Clase de acciones 1" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones 1" (Clase cubierta en EUR)   AUD   6 de febrero de 2014   0.60 % 0.81 % 0.71   Clase de acciones 1" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones 1" (Clase cubierta en GBP)   GBP   6 de abril de 2011   0.60 % 0.81 % 0.71   Clase de acciones de accumilación "10" (Clase cubierta en GBP)   GBP   6 de abril de 2011   0.60 % 0.81 % 0.71   Clase de acciones de accumilación "10" (Clase cubierta en GBP)   GBP   6 de abril de 2011   0.60 % 0.81 % 0.71   Clase de acciones de accumilación "10" (Clase cubierta en GBP)   USD   8 de septiembre de 2015   0.00 % 0.21 % 0.71   Clase de acciones ("15" (Clase cubierta en GBP)   GBP   4 de diciembre de 2017   0.50 % 0.71 % 0.61   Clase de acciones ("15" (Clase cubierta en GBP)   GBP   4 de diciembre de 2017   0.50 % 0.71 % 0.61   Clase de acciones (enersual) (Dis) ("2")   VISD   5 de mayor de 2011   0.80 % 1.05 % 0.98   Clase de acciones de accumilación "10" (Clase cubierta en EUR)   USD   2 de marzo de 2011   0.80 % 1.05 % 0.98   Clase de acciones de accumilación "10" (Clase cubierta en EUR)   USD   2 de marzo de 2011   0.80 % 1.05 % 0.98   Clase de acciones ("10" (Clase cubierta en GBP)   USD   2 de marzo de 2011   0.80 % 1.05 % 0.98   Clase de acciones de accumilación "10" (Clase cubierta en GBP)   USD   2 de marzo de 2011   0.80 % 1.05 % 0.98   Clase de acciones de accumilación "10" (Clase cubierta en GBP)   USD   2 de marzo de 2011   0.80 % 1.05 % 0.98   Clase de acciones de accumilación "10" (Clase cubierta en GBP)   USD   2 de marzo de 2011   0.80 % 1.05 % 0.98   Clase de acciones de accumilación "10" (Clase cubierta en CBP)   USD   2 de marzo de 2011   0.80 % 1.05 % 0.98   Clase de acciones de accumilación "10" (Clase cubierta en CBP)   USD   2 de marzo de 2011   0.80 % 1.05 % 0.98   Clase de acciones de accumilación "10" (Clase cubierta en EUR)   USD   2 de marzo de 2011   0.80 % 0.85 % 0.78   Clase de acciones de accumilación "10" (Clase cubierta en EUR)   USD						0,71 %
Clase de acciones "1"   USD   28 de marzo de 2011   0,60 % 0,81 % 0,71						0,71 %
Clase de acciones 1" (Clase cubierta en EUR)	Clase de acciones "I"		28 de marzo de 2011	0,60 %	0,81 %	0,71 %
Clase de acciones s' (Clase cubierta en GBP)   GBP   6 de abril de 2011   0.60 % 0.81 % 0.71 % 0.61						0,71 %
Clase de acciones de acumulación "10" (Clase cubierta en GBP)   GBP   13 de febrero de 2015   0,00 % 0,21 % 0,71 Clase de acciones de acumulación "15"   USD   4 de diciembre de 2017   0,50 % 0,71 % 0,61 Clase de acciones "15"   USD   4 de diciembre de 2017   0,50 % 0,71 % 0,61 Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO"   USD   30 de septiembre de 2013   0,00 % 0,21 % 0,11 Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO"   USD   30 de septiembre de 2011   0,80 % 0,21 % 0,11 Clase de acciones de acumulación "P"   USD   5 de mayo de 2011   0,80 % 1,05 % 0,96 Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)   USD   28 de marzo de 2011   0,80 % 1,05 % 0,96 Clase de acciones de acumulación "P"   USD   28 de marzo de 2011   0,80 % 1,05 % 0,96 Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)   USD   28 de marzo de 2011   0,80 % 1,05 % 0,95 Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)   USD   28 de marzo de 2011   0,80 % 1,05 % 0,95 Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)   USD   28 de marzo de 2011   0,80 % 1,05 % 0,95 Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)   USD   28 de marzo de 2011   0,80 % 1,05 % 0,95 Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)   USD   28 de marzo de 2011   0,80 % 1,05 % 0,95 Clase de acciones "P" (Clase cubierta en CHF)   USD   28 de marzo de 2011   0,80 % 1,05 % 0,95 Clase de acciones de acumulación "R"   USD   20 de mayo de 2015   0,80 % 0,85 % 0,78 Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   USD   13 de diciembre de 2012   0,80 % 0,85 % 0,78 Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   USD   13 de diciembre de 2012   0,80 % 0,85 % 0,78 Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   USD   14 de diciembre de 2012   0,80 % 0,85 % 0,78 Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en USD)   USD   14 de diciembre de 2012   0,80 % 0,85 % 0,78 Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en USD)   USD   14 de noviembre de 2001   0,00 % 1,25 % 1,15 Clase de acciones de acumulación "Er" (USA de referencia (Cla						0,71 %
Clase de acciones de acumulación "S" ("Clase cubierta en GBP)						0,71 %
Clase de acciones "IS" (Clase cubierta en GBP)						0,57 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO"   USD 30 de septiembre de 2013   0,00 % 0,21 % 0,11   Clase de acciones (mensual) (Dis) "P"   USD 5 de marzo de 2011   0,80 % 1,05 % 0,96   Clase de acciones de accumulación "P" (Clase cubierta en EUR)   USD 28 de marzo de 2011   0,80 % 1,05 % 0,96   Clase de acciones P" (Clase cubierta en EUR)   USD 28 de marzo de 2011   0,80 % 1,05 % 0,95   Clase de acciones P" (Clase cubierta en EUR)   USD 28 de marzo de 2011   0,80 % 1,05 % 0,95   Clase de acciones P" (Clase cubierta en GBP)   GBP 28 de marzo de 2011   0,80 % 1,05 % 0,95   Clase de acciones (mensual) (Dis) "R"   USD 20 de mayo de 2015   0,80 % 1,05 % 0,95   Clase de acciones (mensual) (Dis) "R"   USD 20 de mayo de 2015   0,60 % 0,85 % 0,78   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   USD 20 de mayo de 2015   0,60 % 0,85 % 0,78   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   USD 13 de diciembre de 2012   0,60 % 0,85 % 0,78   Clase de acciones ("Clase cubierta en EUR)   USD 13 de diciembre de 2012   0,60 % 0,85 % 0,78   Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)   USD 13 de diciembre de 2012   0,60 % 0,85 % 0,78   Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)   USD 13 de diciembre de 2012   0,60 % 0,85 % 0,78   Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)   USD 13 de diciembre de 2012   0,60 % 0,85 % 0,78   Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   USD   USD 13 de novembre de 2012   0,60 % 0,85 % 0,78   Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   USD   USD 13 de novembre de 2012   0,60 % 0,85 % 0,78   Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   USD   USD 13 de novembre de 2006   1,00 % 1,25 % 1,15   Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   USD   USD 13 de novembre de 2006   1,00 % 1,25 % 1,15   Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)   USD 13 de novembre de 2006   1,00 % 1,25 % 1,15   Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubi						0,61 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) "P"   Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)   EUR   28 de marzo de 2011   0,80 %   1,05 %   0,98   Clase de acciones P" (Clase cubierta en EUR)   EUR   28 de marzo de 2011   0,80 %   1,05 %   0,98   Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)   EUR   28 de marzo de 2011   0,80 %   1,05 %   0,98   Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)   EUR   28 de marzo de 2011   0,80 %   1,05 %   0,98   Clase de acciones (mensual) (Dis) "R"   USD   20 de mayo de 2015   0,60 %   0,85 %   0,78   0,78   0,98   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF)   USD   20 de mayo de 2015   0,60 %   0,85 %   0,78   0,98   0,78   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,98   0,9						0,61 %
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)   USD   28 de márzo de 2011   0,80 %   1,05 %   0,95						0,11 %
Clase de acciones de accimes   Pr (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones   Pr (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación   Pr (Clase cubierta en CHF)   Clase de acciones de acumulación   Pr (Clase cubierta en CHF)   Clase de acciones de acumulación   Pr (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación   Pr (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación   Pr (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones   Pr (Clase cubierta en CBP)   Clase de acciones   Pr (Clase cubierta en Clase   Pr (Clase cubierta en CBP)   Clase de acciones   Pr (Clase cubierta en Clase   Pr (Clase cubie						0,96 %
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)						0,96 %
Clase de acciones 'P' (Clase cubierta en CBP)						0,95 %
Clase de acciones (mensual) (Dis) "R"   Clase cubierta en CHF)   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF)   CHF   13 de marzo de 2015   0,60 %   0,85 %   0,78   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   CHF   13 de marzo de 2015   0,60 %   0,85 %   0,78   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)   Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)   Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   Clase de acciones denominada en la divisa de referencia   Clase de acciones denominada en la divisa de referencia   Clase de acciones denominada en la divisa de referencia   Clase de acciones denominada en la divisa de referencia   Clase de acciones denominada en la divisa de referencia   Clase cubierta en USD)   USD   18 de septiembre de 2006   1,00 %   1,25 %   1,15   Clase de acciones denominada en la divisa de referencia   Clase cubierta en USD)   USD   18 de septiembre de 2006   1,00 %   1,25 %   1,15   Clase de acciones "A"   Clase cubierta en USD)   USD   31 de octubre de 2006   1,00 %   1,55 %   1,41   Clase de acciones de acumulación "E"   EUR   25 de enero de 2006   1,00 %   1,55 %   1,41   Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)   USD   11 de marzo de 2021   0,50 %   0,71 %   0,59   Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)   USD   11 de marzo de 2021   0,50 %   0,71 %   0,59   Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)   USD   10 de diciembre de 2007   0,50 %   0,71 %   0,59   Clase de acciones de acumulación "O" (Clase cubierta en USD)   USD   10 de diciembre de 2007   0,00	Clase de acciones "P" (Clase cubierta en EUR)			0,80 %		0,96 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF)   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   EUR   5 de diciembre de 2012   0,60 % 0,85 % 0,78						0,96 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF)   Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones "R" (Clase cubierta en BPP)   Glabal Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)   Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)   Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)   Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)   Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)   Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)   Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)   Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)   Clase de acciones "A" (Clase cubierta en USD)   Clase de acciones "A" (Clase cubierta en USD)   Clase de acciones "A" (Clase cubierta en USD)   Clase de acciones de acumulación "E"   EUR 25 de enero de 2006   1,00 % 1,25 % 1,15     Clase de acciones de acumulación "E"   EUR 25 de enero de 2006   1,00 % 1,25 % 1,15     Clase de acciones de acumulación "E"   EUR 25 de enero de 2006   1,00 % 1,50 % 1,41     Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)   Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)   Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)   USD 31 de octubre de 2007   0,50 % 0,71 % 0,59     Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)   USD 30 de noviembre de 2007   0,50 % 0,71 % 0,59     Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)   USD 30 de noviembre de 2007   0,00 % 0,21 % 0,00						0,78 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)   Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)   Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)   Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia   Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)   Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)   Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)   Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)   Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)   Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)   Clase de acciones "A" (Clase cubierta en USD)   Clase de acciones "A" (Clase cubierta en USD)   Clase de acciones "A" (Clase cubierta en USD)   USD 31 de octubre de 2006						
Clase de acciones "R"   USD 13 de diciembre de 2012   0,60 % 0,85 % 0,78						0,77 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)   GBP   5 de diciembre de 2012   0,60 % 0,85 % 0,77						0,78 %
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)   USD   25 de enero de 2006   1,00 %   1,25 %   1,15						0,78 %
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD) Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD) Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD) Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD) Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD) Clase de acciones "A" Clase de acciones "A" Clase de acciones "A" Clase de acciones de acumulación "E" Clase de acciones de acumulación "E" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD)(c) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD)(c) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en BP) Clase de acciones de acumulación "I" Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en SEK)(c) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta			5 de diciembre de 2012	0,60 %	0,85 %	0,77 %
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD) Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD) Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "Los de de acciones "A" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones "A" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD)(c) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones (semestral) (Dis) "IO"(c) Clase de acciones (semestral) (Dis) "IO"(c) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD) Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubier			25 de enero de 2006	1.00 %	1 25 %	1 15 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en USD)   USD 18 de septiembre de 2006   1,00 % 1,25 % 1,15						1,16 %
Clase de acciones "A" (Clase cubierta en USD)   1,41						1,15 %
Clase de acciones "A" (Clase cubierta en USD)						1,15 %
Clase de acciones de acumulación "E"   EUR 28 de septiembre de 2007   1,00 % 1,50 % 1,41						1,41 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD)(c)						
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD) (c)   USD   31 de octubre de 2021   0,50 %   0,71 %   0,59						0,59 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)						0,59 %
Clase de acciones (semestral) (Dis) "IO" (Clase cubierta en GBP)   EUR   10 de diciembre de 2020   0,00 %   0,21 %   0,09	Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en USD)					0,59 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)   EUR   10 de diciembre de 2007   0,00 %   0,21 %   0,03						0,59 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)						0,09 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en SEK)(c)   SEK 31 de agosto de 2021   0,00 % 0,21 % 0,11						0,03 %
Clase de acciones "IO" (Clase cubierta en USD)						0,11 %
Clase de acciones de acumulación "P"   EUR 11 de junio de 2007   0,80 % 1,05 % 0,93				0,00 %	0,21 %	0,08 %
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en USD)						0,09 %
Clase de acciones "P" (Clase cubierta en GBP)   GBP   11 de junio de 2007   0,80 %   1,05 %   0,94						0,93 %
Clase de acciones de acumulación "R" EUR 3 de diciembre de 2012 0,50 % 0,75 % 0,66 Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en USD) 5 de diciembre de 2012 0,50 % 0,75 % 0,66						0,94 %
						0,66 %
Olera de restaura IIDII	Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en USD)	USD	5 de diciembre de 2012	0,50 %	0,75 %	0,66 %
	Clase de acciones "R"	EUR	3 de diciembre de 2012	0,50 %	0,75 %	0,66 %
						0,65 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en USD)  Global Strategic Macro Bond Portfolio <sup>(d)</sup> USD 12 de enero de 2018 0,50 % 0,75 % 0,65  USD			r∠ de enero de 2018	0,50 %	0,75 %	0,65 %
			22 de octubre de 2014	1.00 %	1,25 %	1,27 %
						1,25 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia USD 22 de octubre de 2014 1,00 % 1,25 % 1,25	Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	22 de octubre de 2014	1,00 %	1,25 %	1,25 %
						1,26 %
						1,25 % 1,25 %
						1,25 %
Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)  PLN 26 de mayo de 2016 1,00 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1,50 % 1	Clase de acciones de acumulación "A" (Clase cubierta en PLN)	PLN				1,50 %
		EUR		1,00 %		1,75 %

## Goldman Sachs Funds Anexo II—Porcentajes de la comisión de asesoramiento, Límites de gastos y Ratios de gastos netos totales (sin auditar) A 30 de noviembre de 2021

	Divisa	Fecha de creación	Porcentaje de comisión de asesoramiento		Ratio de gastos netos totales <sup>(b)</sup>
Global Strategic Macro Bond Portfolio <sup>(d)</sup> (continuación)	İ				
Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP) <sup>(c)</sup>	GBP	1 de diciembre de 2020	0,00 %	0,25 %	0,25 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	22 de octubre de 2014	0,50 %	0,71 %	0,71 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF)	CHF	29 de julio de 2016	0,50 %	0,71 %	1,09 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	14 de noviembre de 2014	0,50 %	0,71 %	0,73 %
Clase de acciones de acumulación "l" (Planas) (Clase cubierta en EUR)	EUR	30 de agosto de 2016	0,85 %	1,06 %	1,06 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP)(c)	GBP	21 de mayo de 2015	0,85 %	1,06 %	1,03 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK)	GBP SEK	22 de octubre de 2014 22 de diciembre de 2014	0,50 % 0,50 %	0,71 % 0,71 %	0,72 % 0,71 %
Clase de acciones de acumulación in (Clase cubierta en SER)	USD	22 de diciembre de 2014 22 de octubre de 2014	0,50 %	0,71 %	0,71 %
Clase de acciones "I"(c)	USD	13 de octubre de 2021	0,50 %	0,71 %	0,70 %
Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	14 de noviembre de 2014	0,50 %	0,71 %	0,71 %
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	21 de abril de 2015	0,00 %	0,21 %	0,21 %
Clase de acciones "IO"	USD	27 de agosto de 2015	0,00 %	0,21 %	0,21 %
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	22 de octubre de 2014	0,75 %	1,00 %	1,00 %
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en CHF)	CHF	11 de abril de 2017	0,75 %	1,00 %	1,00 %
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	22 de octubre de 2014	0,75 %	1,00 %	1,00 %
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en GBP)	GBP	11 de abril de 2017	0,75 %	1,00 %	1,00 %
Clase de acciones "P"	USD	22 de octubre de 2014	0,75 %	1,00 %	0,92 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	23 de diciembre de 2016	0,50 %	0,75 %	0,76 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en CHF)	CHF	17 de marzo de 2017	0,50 %	0,75 %	0,75 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	22 de octubre de 2014	0,50 %	0,75 %	0,76 %
Clase de acciones "R"	USD	23 de diciembre de 2016 22 de octubre de 2014	0,50 % 0.50 %	0,75 %	0,75 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR GBP	22 de octubre de 2014 22 de octubre de 2014	0,50 %	0,75 % 0,75 %	0,75 % 0,75 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones de acumulación "RS"	USD	1 de octubre de 2014	0,50 %	0,75 %	0,75 %
Clase de acciones de acumulación "RS" (Clase cubierta en CHF)	CHF	1 de octubre de 2019	0,35 %	0,60 %	0,60 %
Clase de acciones de acumulación "RS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1 de octubre de 2019	0,35 %	0,60 %	0,62 %
Clase de acciones "RS"	USD	1 de octubre de 2019	0,35 %	0,60 %	0,60 %
Clase de acciones "RS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	1 de octubre de 2019	0,35 %	0,60 %	0,60 %
Strategic Absolute Return Bond II Portfolio <sup>(d)</sup>	USD		.,	.,	.,
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	28 de junio de 2006	1,00 %	1,25 %	1,25 %
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR)	EUR	28 de junio de 2006	1,00 %	1,25 %	1,25 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	28 de junio de 2006	1,00 %	1,25 %	1,25 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en EUR)	EUR	28 de junio de 2006	1,00 %	1,25 %	1,25 %
Clase de acciones denominada en la divisa de referencia (Clase cubierta en GBP)	GBP	17 de julio de 2006	1,00 %	1,25 %	1,25 %
Clase de acciones "A"	USD	30 de marzo de 2007	1,00 %	1,50 %	1,50 %
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	16 de julio de 2007	1,00 %	1,75 %	1,75 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	31 de octubre de 2006	0,50 %	0,65 %	0,65 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	20 de noviembre de 2006	0,50 %	0,65 %	0,85 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP)	GBP GBP	15 de noviembre de 2016	1,00 %	1,15 %	1,15 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP)	!	12 de septiembre de 2008		0,15 %	0,15 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	3 de diciembre de 2012	0,50 %	0,75 %	0,75 %
Clase de acciones "R"	USD GBP	3 de diciembre de 2012	0,50 %	0,75 %	0,75 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)  Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio <sup>(e)</sup>	USD	5 de diciembre de 2012	0,50 %	0,75 %	0,75 %
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	31 de julio de 2007	0,65 %	0,95 %	1,34 %
Clase de acciones de acciminada en la divisa de referencia	USD	15 de marzo de 2006	0,65 %	0,95 %	1,34 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	31 de mayo de 2011	0,65 %	0,95 %	1,34 %
Clase de acciones "I"	USD	31 de mayo de 2011	0,30 %	0,56 %	0,92 %
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	29 de febrero de 2012	0,00 %	0,26 %	0,63 %
Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	31 de diciembre de 2012	0,00 %	0,30 %	0,70 %
Clase de acciones de acumulación "R"	USD	31 de diciembre de 2012	0,00 %	0,30 %	0,69 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	29 de septiembre de 2017	0,00 %	0,30 %	0,69 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	14 de agosto de 2017	0,00 %	0,30 %	0,69 %
Clase de acciones "R"	USD	31 de diciembre de 2012	0,00 %	0,30 %	0,69 %
Global Corporate Portfolio (Hedged)	NOK	04 1 11 1 1 22 2		0.0=0:	0.6
Clase de acciones de acumulación "I"	NOK	31 de diciembre de 2007	0,25 %	0,35 %	0,31 %
Absolute Return Tracker Portfolio	USD	10 de enere de 0045	4.05.07	4.50.07	1 50 0/
Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	13 de enero de 2015	1,35 %	1,50 %	1,50 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en CHF)	CHF	18 de agosto de 2017	1,35 %	1,50 %	1,50 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR) Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SGD)	EUR SGD	13 de enero de 2015 22 de abril de 2020	1,35 % 1,35 %	1,50 % 1,50 %	1,50 %
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en SGD)  Clase de acciones de acumulación "A"	USD	26 de mayo de 2017	1,35 %	2,00 %	1,50 % 2,00 %
Clase de acciones de acumulación "E" (Clase cubierta en EUR)	EUR	14 de enero de 2015	1,35 %	2,00 %	2,00 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	13 de enero de 2015	0,65 %	0,80 %	0,77 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD)	AUD	6 de mayo de 2015	0,65 %	0,80 %	0,77 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en CHF)	CHF	13 de enero de 2015	0,65 %	0,80 %	0,77 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	13 de enero de 2015	0,65 %	0,80 %	0,77 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	13 de enero de 2015	0,65 %	0,80 %	0,77 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en JPY)	JPY	4 de diciembre de 2017	0,65 %	0,80 %	0,77 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en SEK)	SEK	20 de marzo de 2015	0,65 %	0,80 %	0,77 %
Clase de acciones de acumulación "P"	USD	26 de mayo de 2017	1,00 %	1,15 %	1,15 %
Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	13 de enero de 2015	1,00 %	1,15 %	1,15 %
Clase de acciones de acumulación "R" (Clase cubierta en EUR)	EUR	23 de agosto de 2018	0,65 %	0,80 %	0,80 %
Clase de acciones "R"	USD	23 de enero de 2015	0,65 %	0,80 %	0,80 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	14 de enero de 2015	0,65 %	0,80 %	0,80 %
Alternative Trend Portfolio	USD				
Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en EUR)	EUR	21 de enero de 2015	1,35 %	1,60 %	1,55 %
Clase de acciones de acumulación "I"	USD	20 de enero de 2015	0,65 %	0,86 %	0,78 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	6 de marzo de 2018	0,65 %	0,86 %	0,78 %
Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	3 de enero de 2018	0,65 %	0,86 %	0,79 %
	GBP	21 de noviembre de 2018	0,65 %	0,86 %	0,78 %

# **Goldman Sachs Funds** Anexo II—Porcentajes de la comisión de asesoramiento, Límites de gastos y Ratios de gastos netos totales (sin auditar) A 30 de noviembre de 2021

	Divisa	Fecha de creación	Porcentaje de comisión de asesoramiento	Límite de gastos <sup>(a)</sup>	Ratio de gastos netos totales <sup>(b)</sup>
Alternative Trend Portfolio (continuación)					
Clase de acciones de acumulación "IO"	USD	28 de enero de 2016	0,00 %	0,21 %	0,13 %
Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en JPY)	JPY	17 de noviembre de 2017	0,00 %	0,21 %	0,13 %
Clase de acciones "IO"	USD	14 de junio de 2017	0,00 %	0,21 %	0,13 %
Clase de acciones "R" (Clase cubierta en GBP)	GBP	21 de enero de 2015	0,65 %	0,90 %	0,85 %

Los anteriores porcentajes TER constituyen un promedio de ratios durante el ejercicio anterior a 30 de noviembre de 2021. Los anteriores límites de gastos representan los porcentajes empleados en el ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021.

<sup>(</sup>b) El Ratio de gastos totales ("TER") expresa la suma de todos los gastos, comisiones varias y comisiones de rentabilidad (excluyendo las comisiones por transacción y los gastos de mercado) que se deducen regularmente de los activos de las Carteras (gastos netos de explotación) considerados retrospectivamente como porcentaje de los activos de las

de mercado) que se deducen regularmente de los activos de las Carteras (gastos netos de explotación) considerados retrospectivamente como porcentaje de los activos de Carteras, y cuyo cálculo se realizará utilizando la siguiente fórmula:

Total gastos netos de explotación en UM\*Media de los activos de las carteras en UM\* x 100 = TER %.

El TER (Ratio de gastos totales) se calcula para el ejercicio comprendido entre el 1 de diciembre de 2020 y el 30 de noviembre de 2021. Los TER se expresan en términos anualizados para Carteras con una antigüedad inferior a un año.

<sup>\*</sup> UM = unidades monetarias en la moneda de referencia de la Cartera.

<sup>(</sup>c) Consulte el Anexo III.

<sup>(</sup>d) El Límite de gastos no incluye las comisiones de rentabilidad.

<sup>(</sup>e) El límite de gastos no incluye el porcentaje de comisión de GSAMI pagado a Subasesores de inversión externos.

# Goldman Sachs Funds Anexo III—Lanzamientos, cierres y fusiones de Carteras y Clases de acciones (sin auditar) A 30 de noviembre de 2021

Durante el ejercicio, se lanzaron las siguientes Carteras:

Carteras	Divisa	Fecha de lanzamiento
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	USD	19 de octubre de 2021
Eurozone CORE® Equity Portfolio	EUR	15 de julio de 2021

Durante el ejercicio, se lanzaron las siguientes clases de acciones:

Carteras	Clases de acciones	Divisa de la clase de acciones	Fecha de lanzamiento
Emerging Markets Equity ESG Portfolio	Clase de acciones "IO"	USD	22 de febrero de 2021
Emerging Markets Equity Portfolio	Clase de acciones "G"	USD	8 de diciembre de 2020
Emerging Markets Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación "IO"	SEK	13 de agosto de 2021
Global Environmental Impact Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	22 de febrero de 2021
Global Environmental Impact Equity Portfolio	Clase de acciones "I"	AUD	16 de marzo de 2021
Global Environmental Impact Equity Portfolio	Clase de acciones "IO"	USD	22 de febrero de 2021
Global Equity Partners Portfolio	Clase de acciones de acumulación "IO"	SEK	13 de agosto de 2021
Global Future Technology Leaders Equity Portfolio	Clase de acciones "I"	GBP	6 de abril de 2021
Global Future Technology Leaders Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación "R"	USD	18 de diciembre de 2020
Japan Equity Partners Portfolio	Clase de acciones de acumulación en otras divisas	USD	24 de noviembre de 2021
Japan Equity Partners Portfolio	Clase de acciones de acumulación en otras divisas (Clase cubierta en USD)	USD	24 de noviembre de 2021
Japan Equity Partners Portfolio	Clase de acciones "R"	JPY	4 de diciembre de 2020
Japan Equity Portfolio	Clase de acciones puntuales de acumulación "IS"	EUR	18 de marzo de 2021
Japan Equity Portfolio	Clase de acciones puntuales de acumulación "IS"	JPY	30 de diciembre de 2020
Japan Equity Portfolio	Clase de acciones puntuales de acumulación "IS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	30 de diciembre de 2020
Japan Equity Portfolio	Clase de acciones puntuales de acumulación "RS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	30 de julio de 2021
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	USD	19 de octubre de 2021
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	19 de octubre de 2021
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	USD	19 de octubre de 2021
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones en otras divisas (bruta mensual) (Dis)	HKD	19 de octubre de 2021
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación en otras divisas	EUR	19 de octubre de 2021
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación en otras divisas	HKD	19 de octubre de 2021
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	19 de octubre de 2021
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones "I SD"	USD	23 de noviembre de 2021
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	19 de octubre de 2021
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación "I"	USD	19 de octubre de 2021
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones "I"	GBP	19 de octubre de 2021
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones "I"	USD	19 de octubre de 2021
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación "P"	USD	19 de octubre de 2021
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones "P"	USD	19 de octubre de 2021
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	19 de octubre de 2021
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación "R"	USD	19 de octubre de 2021
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones "R"	EUR	19 de octubre de 2021
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones "R"	GBP	19 de octubre de 2021
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones "R"	USD	19 de octubre de 2021
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	Clase de acciones puntuales "A"	USD	8 de enero de 2021
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"	JPY	23 de marzo de 2021
Europe CORE® Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación "IS"	EUR	18 de diciembre de 2020
Eurozone CORE® Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación denominada en la divisa de referencia	EUR	15 de julio de 2021

# Goldman Sachs Funds Anexo III—Lanzamientos, cierres y fusiones de Carteras y Clases de acciones (sin auditar) A 30 de noviembre de 2021

Carteras	Clases de acciones	Divisa de la clase de acciones	Fecha de lanzamiento
Eurozone CORE® Equity Portfolio	Clase de acciones denominada en la divisa de referencia	EUR	15 de julio de 2021
Eurozone CORE® Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación en otras divisas	USD	15 de julio de 2021
Eurozone CORE® Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación "E"	EUR	15 de julio de 2021
Eurozone CORE® Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación "I"	EUR	15 de julio de 2021
Eurozone CORE® Equity Portfolio	Clase de acciones "I"	EUR	15 de julio de 2021
Eurozone CORE® Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación "R"	EUR	15 de julio de 2021
Eurozone CORE® Equity Portfolio	Clase de acciones "R"	EUR	15 de julio de 2021
Global CORE® Equity Portfolio	Clase de acciones puntuales "G"	USD	7 de diciembre de 2020
Global CORE® Equity Portfolio	Clase de acciones puntuales de acumulación "I"	GBP	7 de diciembre de 2020
Global CORE® Equity Portfolio	Clase de acciones puntuales de acumulación "I"	SEK	29 de noviembre de 2021
Global CORE® Equity Portfolio	Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"	SEK	13 de agosto de 2021
Global CORE® Equity Portfolio	Clase de acciones puntuales de acumulación "IS"	EUR	21 de diciembre de 2020
Global CORE® Equity Portfolio	Clase de acciones puntuales de acumulación "IS"	USD	9 de febrero de 2021
Global CORE® Equity Portfolio	Clase de acciones puntuales de acumulación "IS" (Clase cubierta en EUR)	EUR	21 de diciembre de 2020
Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	Clase de acciones puntuales de acumulación "IO"	SEK	13 de agosto de 2021
Asia High Yield Bond Portfolio	Clase de acciones "I SD"	GBP	26 de marzo de 2021
Asia High Yield Bond Portfolio	Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) "I"	USD	9 de julio de 2021
Asia High Yield Bond Portfolio	Clase de acciones "I" (Clase cubierta en EUR)	EUR	9 de julio de 2021
Asia High Yield Bond Portfolio	Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP)	GBP	25 de febrero de 2021
Asia High Yield Bond Portfolio	Clase de acciones (bruta mensual) (Dis) "P"	USD	9 de julio de 2021
Emerging Markets Corporate Bond Portfolio	Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en BRL)	USD	8 de febrero de 2021
Global Credit Portfolio (Hedged)	Clase de acciones de acumulación IO" (Clase cubierta en SEK)	SEK	13 de agosto de 2021
Global Fixed Income Portfolio	Clase de acciones de acumulación "I"	USD	30 de abril de 2021
Global Multi-Asset Income Portfolio	Clase de acciones en otras divisas (estable mensual) (Dis) (Clase cubierta en SGD)	SGD	1 de diciembre de 2020
Global Absolute Return Portfolio	Clase de acciones de acumulación IO" (Clase cubierta en GBP)	GBP	8 de septiembre de 2021
Global Dynamic Bond Portfolio	Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD)	AUD	12 de marzo de 2021
Global Dynamic Bond Plus Portfolio	Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1 de diciembre de 2020
Global Dynamic Bond Plus Portfolio	Clase de acciones de acumulación "I"	JPY	31 de agosto de 2021
Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)	Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en AUD)	AUD	11 de marzo de 2021
Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)	Clase de acciones (semestral) (Dis) "IO"	EUR	4 de diciembre de 2020
Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)	Clase de acciones de acumulación IO" (Clase cubierta en SEK)	SEK	31 de agosto de 2021
Global Strategic Macro Bond Portfolio	Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP)	GBP	1 de diciembre de 2020
Global Strategic Macro Bond Portfolio	Clase de acciones "I"	USD	13 de octubre de 2021

Durante el ejercicio, se cerraron las siguientes clases de acciones:

Carteras	Clases de acciones	Divisa de la clase de acciones	Fecha de cierre
Global Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) denominada en la divisa de referencia	USD	18 de junio de 2021
Global Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones en otras divisas (bruta trimestral) (Dis)	EUR	18 de junio de 2021
Global Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "I"	GBP	18 de junio de 2021
Global Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "I"	USD	18 de junio de 2021
Global Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "R"	GBP	18 de junio de 2021
Global Infrastructure Equity Portfolio	Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "R"	USD	18 de junio de 2021

## Goldman Sachs Funds Anexo III—Lanzamientos, cierres y fusiones de Carteras y Clases de acciones (sin auditar) A 30 de noviembre de 2021

Carteras	Clases de acciones	Divisa de la clase de acciones	Fecha de cierre
Global Real Estate Equity Portfolio	Clase de acciones en otras divisas (bruta trimestral) (Dis)	EUR	18 de junio de 2021
Global Real Estate Equity Portfolio	Clase de acciones en otras divisas	EUR	18 de junio de 2021
Global Real Estate Equity Portfolio	Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "I"	GBP	18 de junio de 2021
Global Real Estate Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación "I"	GBP	18 de junio de 2021
Global Real Estate Equity Portfolio	Clase de acciones "I"	GBP	18 de junio de 2021
Global Real Estate Equity Portfolio	Clase de acciones (bruta trimestral) (Dis) "R"	USD	18 de junio de 2021
Global Real Estate Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación "R"	GBP	18 de junio de 2021
Global Real Estate Equity Portfolio	Clase de acciones "R"	GBP	18 de junio de 2021
Global CORE® Equity Portfolio	Clase de acciones de acumulación "IO" al cierre	GBP	21 de diciembre de 2020
Emerging Markets Debt Portfolio	Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en duración)	EUR	21 de diciembre de 2020
Emerging Markets Debt Portfolio	Clase de acciones "I" (Clase cubierta en GBP) (Clase cubierta en duración)	GBP	21 de diciembre de 2020
Emerging Markets Debt Portfolio	Clase de acciones de acumulación R" (Clase cubierta en duración)	USD	21 de diciembre de 2020
Global Credit Portfolio (Hedged)	Clase de acciones de acumulación "I" (Clase cubierta en GBP) (Clase cubierta en duración)	GBP	9 de diciembre de 2020
Global Credit Portfolio (Hedged)	Clase de acciones de acumulación "IO" (Clase cubierta en GBP) (Clase cubierta en duración)	GBP	25 de junio de 2021
Global Fixed Income Portfolio	Clase de acciones "B"	USD	21 de diciembre de 2020
Global High Yield Portfolio	Clase de acciones en otras divisas (mensual) (Dis) (Clase cubierta en HKD) (Clase cubierta en duración)	HKD	6 de octubre de 2021
Global High Yield Portfolio	Clase de acciones "G"	USD	16 de marzo de 2021
Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio	Clase de acciones (mensual) (Dis) (Cap) "IXO"	USD	10 de septiembre de 2021
Global Absolute Return Portfolio	Clase de acciones de acumulación "P"	USD	21 de diciembre de 2020
Global Absolute Return Portfolio	Clase de acciones de acumulación "P" (Clase cubierta en EUR)	EUR	21 de diciembre de 2020
Global Absolute Return Portfolio	Clase de acciones "P"	USD	21 de diciembre de 2020
Global Dynamic Bond Plus Portfolio	Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP)	GBP	8 de marzo de 2021
Global Dynamic Bond Plus Portfolio	Clase de acciones de acumulación "IS"	USD	21 de diciembre de 2020
Global Strategic Macro Bond Portfolio	Clase de acciones "G" (Clase cubierta en GBP)	GBP	8 de marzo de 2021
Global Strategic Macro Bond Portfolio	Clase de acciones de acumulación "I" (Planas) (Clase cubierta en GBP)	GBP	21 de diciembre de 2020
Global Strategic Macro Bond Portfolio	Clase de acciones "I"	USD	14 de septiembre de 2021

Durante el ejercicio, se modificó el nombre de las siguientes Carteras:

Antiguo nombre de la Cartera	Nuevo nombre de la Cartera	Fecha
China Opportunity Equity Portfolio	All China Equity Portfolio	10 de marzo de 2021
US Smaller Cap Equity Portfolio	US Small Cap Equity Portfolio	10 de marzo de 2021
Emerging Markets Short Duration Bond Portfolio	ESG-Enhanced Emerging Markets Short Duration Bond Portfolio	8 de enero de 2021
Euro Short Duration Bond Plus Portfolio	ESG-Enhanced Euro Short Duration Bond PlusPortfolio	8 de enero de 2021
Europe High Yield Bond Portfolio	ESG-Enhanced Europe High Yield Bond Portfolio	8 de enero de 2021
Global ESG Enhanced Income Bond Portfolio	ESG-Enhanced Global Income Bond Portfolio	8 de enero de 2021
Sterling Credit Portfolio	ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio	8 de enero de 2021
Global Multi-Asset Balanced Portfolio	ESG-Enhanced Global Multi-Asset Balanced Portfolio	10 de marzo de 2021
Strategic Absolute Return Bond I Portfolio	Global Dynamic Bond Portfolio	8 de octubre de 2021
Global Strategic Income Bond Portfolio	Global Dynamic Bond Plus Portfolio	8 de octubre de 2021

Las siguientes tablas presentan información de los accionistas que poseen posiciones superiores al 10 % del patrimonio neto de la Cartera a 30 de noviembre de 2021:

Carteras	% del patrimonio	Inversor / Distribuidor
Asia Equity Portfolio		
Accionista 1 <sup>1</sup>	18,31 %	Inversor
Accionista 2	13,33 %	Distribuidor
Otros Accionistas	68,36 %	
Total	100,00 %	
Emerging Markets Equity ESG Portfolio		
Accionista 1	26,09 %	Inversor
Otros Accionistas	73,91 %	
Total	100,00 %	
Emerging Markets Equity Portfolio		
Accionista 1	12,75 %	Inversor
Otros Accionistas	87,25 %	
Total	100,00 %	
Global Environmental Impact Equity Portfolio	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	
Accionista 1 <sup>1</sup>	16,42 %	Inversor
Accionista 2¹	12,53 %	Inversor
Otros Accionistas	71,05 %	
Total	100,00 %	
Global Equity Income Portfolio	133,60 %	
Accionista 1	21,34 %	Inversor
Accionista 2	10,98 %	Inversor
Otros Accionistas	67,68 %	
Total	100,00 %	
Global Equity Partners ESG Portfolio	100,00 %	
Accionista 1	12,24 %	Distribuidor
Accionista 2	10,19 %	Distribuidor
Otros Accionistas	77,57 %	Distributdor
Total	100,00 %	
Global Equity Partners Portfolio	100,00 %	
Accionista 1	12,91 %	Distribuidor
Otros Accionistas	87,09 %	Distributdor
Total	100,00 %	
Global Future Technology Leaders Equity Portfolio	100,00 %	
Accionista 1 <sup>1</sup>	65,21 %	Inversor
Accionista 1 <sup>-</sup>	22,23 %	Inversor
Otros Accionistas	12,56 %	Inversor
Total	100,00 %	
Japan Equity Portfolio	22.40.0/.	Inverser
Accionista 1 Accionista 2	22,10 %	Inversor
	13,08 %	Distribuidor
Otros Accionistas	64,82 %	
Total	100,00 %	
US Equity Portfolio	70.40.07	B
Accionista 1	76,13 %	Distribuidor
Otros Accionistas	23,87 %	
Total	100,00 %	

Carteras	% del patrimonio	Inversor / Distribuidor
US Focused Growth Equity Portfolio		
Accionista 1	23,50 %	Inversor
Accionista 2	12,52 %	Inversor
Accionista 3	12,05 %	Distribuidor
Otros Accionistas	51,93 %	
Total	100,00 %	
US Technology Opportunities Equity Portfolio		
Accionista 1	85,08 %	Inversor
Otros Accionistas	14,92 %	
Total	100,00 %	
Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	
Accionista 1 <sup>2</sup>	100,00 %	Inversor
Total	100,00 %	
Global Infrastructure Equity Portfolio		
Accionista 1	14,28 %	Distribuidor
Accionista 2	12,33 %	Inversor
Otros Accionistas	73,39 %	
Total	100,00 %	
Global Real Estate Equity Portfolio	100,00 /0	
Accionista 1	21,02 %	Distribuidor
Accionista 2	11,12 %	Inversor
Accionista 3	10,97 %	Inversor
Otros Accionistas	56,89 %	inversor
	, ,	
Total	100,00 %	
North America Energy & Energy Infrastructure Equity Portfolio	40.04.0/	Distribution
Accionista 1	16,24 %	Distribuidor
Otros Accionistas	83,76 %	
Total	100,00 %	
Eurozone CORE® Equity Portfolio		
Accionista 1 <sup>2</sup>	100,00 %	Inversor
Total	100,00 %	
Global CORE® Equity Portfolio		
Accionista 1 <sup>1</sup>	21,69 %	Inversor
Otros Accionistas	78,31 %	
Total	100,00 %	
Global Small Cap CORE® Equity Portfolio		
Accionista 1	25,57 %	Distribuidor
Accionista 2	20,71 %	Distribuidor
Otros Accionistas	53,72 %	
Total	100,00 %	
US CORE® Equity Portfolio		
Accionista 1	13,08 %	Distribuidor
Accionista 2	11,72 %	Distribuidor
Otros Accionistas	75,20 %	
Total	100,00 %	
US Small Cap CORE® Equity Portfolio		
Accionista 1 <sup>1</sup>	50,09 %	Inversor
Accionista 2 <sup>1</sup>	13,37 %	Inversor
Otros Accionistas	36,54 %	
Total	100,00 %	

Carteras	% del patrimonio	Inversor / Distribuidor
Asia High Yield Bond Portfolio		
Accionista 1	13,64 %	Distribuidor
Otros Accionistas	86,36 %	
Total	100,00 %	
Emerging Markets Debt Blend Portfolio		
Accionista 1	65,40 %	Inversor
Accionista 2	16,89 %	Inversor
Otros Accionistas	17,71 %	
Total	100,00 %	
Emerging Markets Debt Local Portfolio		
Accionista 1	12,72 %	Inversor
Accionista 2	10,27 %	Inversor
Otros Accionistas	77,01 %	
Total	100,00 %	
Emerging Markets Debt Portfolio		
Accionista 1	18,57 %	Inversor
Otros Accionistas	81,43 %	
Total	100,00 %	
ESG-Enhanced Euro Short Duration Bond Plus Portfolio	,	
Accionista 1	12,37 %	Inversor
Otros Accionistas	87.63 %	111101001
Total	100,00 %	
ESG-Enhanced Europe High Yield Bond Portfolio	100,00 /8	
Accionista 1	10,74 %	Inversor
Accionista 2	10,74 %	Inversor
Accionista 3	10,24 %	Inversor
Accionista 4	10,16 %	Inversor
Accionista 5	10,14 %	Inversor
Otros Accionistas	48,42 %	
Total  FSC Februard Clabel Income Bond Bertfelie	100,00 %	
ESG-Enhanced Global Income Bond Portfolio	40.50.0/	
Accionista 1 <sup>2</sup>	48,58 %	Inversor
Accionista 2	32,31 %	Distribuidor
Accionista 3	16,55 %	Distribuidor
Otros Accionistas	2,56 %	
Total	100,00 %	
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio		
Accionista 1	44,33 %	Inversor
Accionista 2	13,90 %	Distribuidor
Otros Accionistas	41,77 %	
Total	100,00 %	
Global Fixed Income Portfolio		
Accionista 1	23,61 %	Inversor
Accionista 2	13,43 %	Distribuidor
Accionista 3	12,29 %	Inversor
Otros Accionistas	50,67 %	
Total	100,00 %	
Global Fixed Income Portfolio (Hedged)		
Accionista 1¹	16,32 %	Inversor
Otros Accionistas	83,68 %	
Total	100,00 %	

Carteras	% del patrimonio	Inversor / Distribuidor
Global Sovereign Bond Portfolio		
Accionista 1	34,18 %	Inversor
Accionista 2	30,54 %	Inversor
Otros Accionistas	35,28 %	
Total	100,00 %	
Short Duration Opportunistic Corporate Bond Portfolio		
Accionista 1	16,25 %	Inversor
Otros Accionistas	83,75 %	
Total	100,00 %	
US Dollar Short Duration Bond Portfolio		
Accionista 1	21,62 %	Inversor
Accionista 2	12,55 %	Inversor
Otros Accionistas	65,83 %	
Total	100,00 %	
US Fixed Income Portfolio	100,00 /0	
Accionista 1	45,35 %	Inversor
Otros Accionistas	45,35 % 54,65 %	niversor
Total	100,00 %	
	100,00 /8	
US Mortgage Backed Securities Portfolio	40.04.0/	
Accionista 1 <sup>1</sup>	40,94 %	Inversor
Accionista 2	16,18 %	Inversor
Otros Accionistas	42,88 %	
Total	100,00 %	
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio		
Accionista 1	80,85 %	Distribuidor
Otros Accionistas	19,15 %	
Total	100,00 %	
ESG-Enhanced Global Multi-Asset Balanced Portfolio		
Accionista 1	21,76 %	Inversor
Accionista 2	16,52 %	Distribuidor
Otros Accionistas	61,72 %	
Total	100,00 %	
Global Multi-Asset Conservative Portfolio		
Accionista 1 <sup>1</sup>	67,37 %	Inversor
Accionista 2	13,19 %	Inversor
Otros Accionistas	19,44 %	
Total	100,00 %	
Global Multi-Asset Growth Portfolio		
Accionista 1 <sup>1</sup>	84,24 %	Inversor
Otros Accionistas	15,76 %	
Total	100,00 %	
Global Multi-Asset Income Portfolio		
Accionista 1	48,40 %	Distribuidor
Accionista 2 <sup>1</sup>	11,46 %	Distribuidor
Otros Accionistas	40,14 %	
Total	100,00 %	
Emerging Markets Total Return Bond Portfolio	100,00 /0	
Accionista 1	94,58 %	Inversor
Otros Accionistas	5,42 %	111761301
Total	100,00 %	

Carteras	% del patrimonio	Inversor Distribuidor
Global Absolute Return Portfolio		
Accionista 1 <sup>1</sup>	60,94 %	Inversor
Accionista 2	17,18 %	Inversor
Accionista 3	10,61 %	Distribuido
Otros Accionistas	11,27 %	
Total	100,00 %	
Global Dynamic Bond Portfolio		
Accionista 1 <sup>1</sup>	96,24 %	Inverso
Otros Accionistas	3,76 %	
Total	100,00 %	
Global Dynamic Bond Plus Portfolio		
Accionista 1	19,62 %	Inverso
Accionista 2	15,15 %	Inversor
Accionista 3	13,58 %	Inversor
Otros Accionistas	51,65 %	
Total	100,00 %	
Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	
Accionista 1	56,14 %	Inverso
Otros Accionistas	43,86 %	
Total	100,00 %	
Global Strategic Macro Bond Portfolio		
Accionista 1	24,87 %	Inverso
Accionista 21	12,68 %	Inverso
Accionista 3	12,10 %	Inverso
Otros Accionistas	50,35 %	
Total	100,00 %	
Strategic Absolute Return Bond II Portfolio		
Accionista 1	90,89 %	Inverso
Otros Accionistas	9,11 %	
Total	100,00 %	
Global Corporate Portfolio (Hedged)	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	
Accionista 1	100,00 %	Inverso
Total	100,00 %	
Absolute Return Tracker Portfolio	<u> </u>	
Accionista 1	17,08 %	Inverso
Accionista 2	13,25 %	Distribuido
Otros Accionistas	69,67 %	
Total	100,00 %	
Alternative Trend Portfolio	, ,,	
Accionista 1 <sup>1</sup>	28,40 %	Inverso
Accionista 2¹	14,01 %	Inverso
Accionista 3	11,49 %	Inverso
Accionista 4	10,83 %	Inverso
Otros Accionistas	35,27 %	3100
Total	100,00 %	

<sup>&</sup>lt;sup>1</sup>Parte relacionada con Goldman Sachs Funds.

A 30 de noviembre de 2021 no había concentraciones superiores al 10 % en otras Carteras.

<sup>&</sup>lt;sup>2</sup> Las participaciones son la inversión de capital inicial para establecer un historial para la Cartera.

La directiva IV sobre Organismos de Inversión Colectiva en Valores Mobiliarios ("OICVM"), en su versión modificada, exige que se informe sobre la forma en que se gestiona la exposición global a las inversiones en derivados financieros. Para ello se emplean tres métodos de gestión:

- a) El Criterio de compromiso. Este método se aplica generalmente a las Carteras que mantienen posiciones menos complejas en instrumentos financieros derivados, así como con fines de cobertura o de una gestión eficiente de la cartera.
- b) Método de Valor en Riesgo relativo ("VaR relativo"). Este método generalmente se aplica a las Carteras para las cuales es posible identificar un índice de referencia adecuado. Este método permite comparar la exposición global de la Cartera con respecto a la de un índice de referencia.
- c) Método de Valor en Riesgo absoluto ("VaR absoluto"). Este método generalmente se aplica a las Carteras para las cuales no es conveniente o posible determinar un índice de referencia (por ejemplo, una cartera de rentabilidad absoluta).

Las siguientes secciones indican qué método se emplea para las Carteras.

Para las Carteras gestionadas conforme al método VaR, se facilita información adicional sobre el modelo VaR, definido como la Cartera/Índice de referencia empleado como modelo VaR, la utilización del límite normativo VaR y el nivel de apalancamiento alcanzado.

### I. Criterio de compromiso

Las siguientes Carteras emplean el criterio de compromiso para calcular la exposición global:

Asia Equity Portfolio	US Focused Growth Equity Portfolio
All China Equity Portfolio	US Small Cap Equity Portfolio
Emerging Markets Equity ESG Portfolio	US Technology Opportunities Equity Portfolio
Emerging Markets Equity Portfolio	Global Clean Energy Infrastructure Equity Portfolio
Global Environmental Impact Equity Portfolio	Global Infrastructure Equity Portfolio
Global Equity Income Portfolio	Global Real Estate Equity Portfolio
Global Equity Partners ESG Portfolio	North America Energy & Energy Infrastructure Equity Portfolio
Global Equity Partners Portfolio	Emerging Markets CORE® Equity Portfolio
Global Future Health Care Equity Portfolio	Europe CORE® Equity Portfolio
Global Future Technology Leaders Equity Portfolio	Eurozone CORE® Equity Portfolio
Global Millennials Equity Portfolio	Global CORE® Equity Portfolio
India Equity Portfolio	Global Small Cap CORE® Equity Portfolio
Japan Equity Partners Portfolio	US CORE® Equity Portfolio
Japan Equity Portfolio	US Small Cap CORE® Equity Portfolio
US Equity Portfolio	Multi-Manager Dynamic World Equity Portfolio

### II. Método VaR

Las siguientes Carteras utilizan el método VaR para calcular la exposición global:

			como	ción del límite porcentaje d amentario de	el límite						
Carteras	Enfoque de valor en riesgo (VaR)	Límite reglamentario	Más bajo	Más alto	Medio	Cartera/ Índice de referencia	Modelo	Intervalo de confianza	Periodo de tenencia	Periodo de observación	Apalancamiento <sup>2</sup>
Asia High Yield Bond Portfolio	VaR relativo	200% del VaR de referencia	42 %	68 %	50 %	ICE3 BofA Asian Dollar High Yield Corporate Sector & Issuer Constrained Index	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	16 %
Emerging Markets Corporate Bond Portfolio	VaR relativo	200% del VaR de referencia	48 %	86 %	63 %	JPM CEMBI Broad Diversified Index	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	35 %

### II. Método VaR (continuación)

			como	ción del límite porcentaje de amentario del	el límite						
Carteras	Enfoque de valor en riesgo (VaR)	Límite reglamentario	Más bajo	Más alto	Medio	Cartera/ Índice de referencia	Modelo	Intervalo de confianza	Periodo de tenencia	Periodo de observación	Apalancamiento <sup>2</sup>
Emerging Markets Debt Blend Portfolio	VaR relativo	200% del VaR de referencia	41 %	66 %	50 %	50 % JP Morgan GBI-EM Global Diversified Index, 25 % JPM EMBI Global Diversified Index, 25 % CEMBI Broad Diversified Index	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	299 %
Emerging Markets Debt Local Portfolio	VaR relativo	200% del VaR de referencia	41 %	62 %	48 %	JP Morgan GBI-EM Global Diversified Index	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	375 %
Emerging Markets Debt Portfolio	VaR relativo	200% del VaR de referencia	45 %	65 %	54 %	JP Morgan Emerging Markets Bond Index— Global Diversified	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	215 %
ESG-Enhanced Emerging Markets Short Duration Bond Portfolio	VaR absoluto	20% del VL	3 %	9 %	5 %	LIBOR a 3 meses	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	63 %
ESG-Enhanced Euro Short Duration Bond Plus Portfolio	VaR absoluto	20% del VL	2 %	5 %	2 %	Bloomberg Barclays Euro Aggregate 500mm 1-3 yr	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	181 %
ESG-Enhanced Europe High Yield Bond Portfolio	VaR relativo	200% del VaR de referencia	41 %	66 %	51 %	ICE BofAML European Currency High Yield Constrained Index (Total Return, Hedged)	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	37 %
ESG-Enhanced Global Income Bond Portfolio	VaR absoluto	20% del VL	6 %	14 %	9 %	Bloomberg Barclays Global Aggregate Index (Total Return Gross)	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	85 %
ESG-Enhanced Sterling Credit Portfolio	VaR relativo	200% del VaR de referencia	35 %	69 %	51 %	iBoxx Sterling Non Gilts Index (Total Return, Unhedged)	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	192 %
Global Credit Portfolio (Hedged)	VaR relativo	200% del VaR de referencia	38 %	58 %	47 %	Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporate Bond Index (Hedged)	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	193 %
Global Fixed Income Portfolio	VaR relativo	200% del VaR de referencia	39 %	68 %	53 %	Gross) / 40 % MSCI World Index (USD Hedged)(Total Return Net) / 20 % Bloomberg Barclays Global Aggregate Index (Total Return Gross)	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	292 %
Global Fixed Income Portfolio (Hedged)	VaR relativo	200% del VaR de referencia	31 %	78 %	53 %	Barclays Global Aggregate – Corporate Index (EUR-hedged) (Total Return Gross)	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	338 %
Global High Yield Portfolio	VaR relativo	200% del VaR de referencia	41 %	66 %	50 %	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield Bond Index – 2 % Issuer Cap (Total Return Gross)	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	22 %
Global Sovereign Bond Portfolio	VaR relativo	200% del VaR de referencia	28 %	50 %	35 %	Bloomberg Barclays 60 % Emerging Markets Local Currency Government (USD) / 40 % Global Treasury Country (USD-Hedged) Bond Index	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	440 %

### II. Método VaR (continuación)

			como	ción del límite porcentaje de amentario del	el límite						
Carteras	Enfoque de valor en riesgo (VaR)	Límite reglamentario	Más bajo	Más alto	Medio	Cartera/ Índice de referencia	Modelo	Intervalo de confianza	Periodo de tenencia	Periodo de observación	Apalancamiento <sup>2</sup>
Short Duration Opportunistic Bonos de empresa Portfolio	VaR absoluto	20% del VL	7 %	20 %	11 %	Merrill Lynch 1 Month Constant Maturity Index	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	9 %
US Dollar Short Duration Bond Portfolio	VaR relativo	200% del VaR de referencia	51 %	87 %	68 %	Bloomberg Barclays US Govt-Credit 1-3 yr Index	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	88 %
US Fixed Income Portfolio	VaR relativo	200% del VaR de referencia	44 %	59 %	49 %	Bloomberg Barclays US Aggregate Bond Index	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	127 %
US Mortgage Backed Securities Portfolio	VaR relativo	200% del VaR de referencia	39 %	66 %	52 %	Bloomberg Barclays US Securitised Index (Total Return, Unhedged)	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	81 %
Emerging Markets Multi- Asset Portfolio	VaR relativo	200% del VaR de referencia	50 %	62 %	55 %	30 % JPMorgan GBI EM Index Global Diversified (Total Return Gross) + 15 % JPMorgan EMB Index—Global / Diversified (Total Return Gross) + 15 % JPMorgan CEMBI Index — Broad Diversified (Total Return Gross) + 40 % MSCI Emerging Markets Index (Total Return Net)	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	28 %
ESG-Enhanced Global Multi- Asset Balanced Portfolio	VaR relativo	200% del VaR de referencia	46 %	68 %	55 %	50 % Bloomberg Barclays Global Aggregate (Total Return, Hedged) y 50 % MSCI World Index (Net)	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	67 %
Global Multi-Asset Conservative Portfolio	VaR relativo	200% del VaR de referencia	37 %	63 %	54 %	70 % Bloomberg Barclays Global Aggregate (Total Return, Hedged) & 30 % MSCI World Index (Net)	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	40 %
Global Multi- Asset Growth Portfolio	VaR relativo	200% del VaR de referencia	40 %	67 %	55 %	30 % Bloomberg Barclays Global Aggregate (Total Return, Hedged) & 70 % MSCI World Index (Net)	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	49 %
Global Multi-Asset Income Portfolio	VaR relativo	200% del VaR de referencia	43 %	71 %	55 %	40 % ICE BofAML US High Yield BB-B Constrained Index (USD) Hedged) (Total Return Gross) / 40 % MSCI World Index (USD) Hedged) (Total Return Net) / 20 % Bloomberg Barclays Global Aggregate – Corporate Index (USD Hedged) (Total Return Gross)	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	63 %

### II. Método VaR (continuación)

			como	ción del límite porcentaje de amentario del	el límite						
Carteras	Enfoque de valor en riesgo (VaR)	Límite reglamentario	Más bajo	Más alto	Medio	Cartera/ Índice de referencia	Modelo	Intervalo de confianza	Periodo de tenencia	Periodo de observación	Apalancamiento <sup>2</sup>
US Real Estate Balanced Portfolio	VaR relativo	200% del VaR de referencia	45 %	74 %	55 %	35 % BoAML US High Yield Building Materials + 35 % BoAML US High Yield Homebuilders/ Real Estate + 30 % MSCI Custom Real Estate Equity Index (total return) (net)	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	22 %
Emerging Markets Total Return Bond Portfolio	VaR absoluto	20% del VL	6 %	26 %	11 %	3 meses USD LIBOR Index	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	449 %
Global Absolute Return Portfolio	VaR absoluto	20% del VL	12 %	36 %	21 %	3 meses USD LIBOR Index	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	219 %
Global Dynamic Bond Portfolio	VaR absoluto	20% del VL	4 %	16 %	7 %	3 meses USD LIBOR Index	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	574 %
Global Dynamic Bond Plus Portfolio	VaR absoluto	20% del VL	8 %	26 %	13 %	3 meses USD LIBOR Index	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	935 %
Global Fixed Income Plus Portfolio (Hedged)	VaR relativo	200% del VaR de referencia	39 %	81 %	61 %	Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return Gross) (EUR-hedged)	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	658 %
Global Strategic Macro Bond Portfolio	VaR absoluto	20% del VL	10 %	28 %	15 %	3 meses USD LIBOR Index	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	1.304 %
Strategic Absolute Return Bond II Portfolio	VaR absoluto	20% del VL	7 %	43 %	16 %	3 meses USD LIBOR Index	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	1.190 %
Global Corporate Portfolio (Hedged)	VaR relativo	200% del VaR de referencia	39 %	59 %	48 %	Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit SRI Index (Total Return) (NOK Hedged)	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	427 %
Absolute Return Tracker Portfolio	VaR absoluto	20% del VL	16 %	49 %	24 %	3 meses USD LIBOR Index	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	152 %
Alternative Trend Portfolio	VaR absoluto	20% del VL	24 %	71 %	45 %	3 meses USD LIBOR Index	VaR histórico	99 %	20 días	1 año	663 %

<sup>&</sup>lt;sup>1</sup> El porcentaje de utilización representa la proporción mínima, máxima y media del límite máximo utilizado en el periodo de referencia. Por ejemplo, una Cartera con una utilización media del 25 % y un límite máximo del 200 % (VaR relativo), representa un ratio VaR medio (VaR de Cartera dividido por VaR de referencia) del 50 %. Una Cartera con una utilización media del 25 % y un límite máximo del 20 % (VaR absoluto), representa un VaR medio de la Cartera del 5 %.

<sup>&</sup>lt;sup>2</sup> El método de la suma de importes nocionales aplicado a instrumentos financieros derivados se emplea para determinar el apalancamiento máximo previsto de la Cartera. Este cálculo incorpora los instrumentos financieros derivados mantenidos en las Carteras, la reinversión de la garantía recibida (en efectivo) a cuenta de operaciones destinadas a una gestión eficiente de la cartera, así como cualquier uso de la garantía en el marco de cualquier otra operación realizada a efectos de una gestión eficiente de la cartera, por ejemplo, préstamo de valores.

# Goldman Sachs Funds Anexo VI—Enunciados del Informe anual de la sociedad gestora (sin auditar) Correspondiente al ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021

La sociedad gestora del OICVM (la "Sociedad") debe presentar un Informe anual correspondiente al ejercicio de cada uno de sus OICVM, que contenga determinados enunciados con arreglo al Artículo 69 de la Directiva 2009/65/UE de la Comisión Europea, modificado por el Artículo 1 (13)(b) de la Directiva 2014/91/UE de la Comisión Europea (la "Directiva"). La información dispuesta a continuación cumple los requisitos de la Directiva.

#### I. Remuneración

La Sociedad tiene 29¹ empleados en Dublín y Londres, los cuales son responsables de una o más de las siguientes funciones y equipos: Gestión de riesgos, Cumplimiento, Servicios a inversores, Supervisión de proveedores y Controladores. La Sociedad ha externalizado la función de gestión de la cartera a GSAMI. La Sociedad ha identificado a miembros del personal cuyas actividades profesionales tienen un impacto significativo en el perfil de riesgo de la Sociedad ("Personal identificado de OICVM"), incluidos el equipo directivo, las personas dispuestas a asumir riesgos y los directores del departamento de control.

La siguiente información se ofrece de acuerdo con la Directiva con respecto a la Sociedad, que forma parte de The Goldman Sachs Group, Inc. ("Grupo GS"). La filosofía mundial de remuneraciones, la estructura y el proceso de establecimiento de la remuneración del Grupo GS se aplican, en general, a los empleados de la Sociedad de igual manera que a otros empleados de todo el mundo. Los términos "empresa" y "nosotros" a lo largo de este enunciado hacen referencia al Grupo GS, a la Sociedad y a cualquiera de sus subsidiarias y filiales.

### a. Filosofía del programa de remuneraciones

La filosofía de remuneraciones y los objetivos del programa de remuneraciones de la Sociedad se reflejan en la Declaración de Política de Remuneraciones adoptada por el Consejo de Administración de la Sociedad, que incluye lo siguiente:

- 1. Pagamos por rendimiento: es un requisito indispensable en nuestro programa de remuneraciones y es intrínseco a nuestra cultura.
- Estructuramos la retribución, sobre todo en los niveles superiores, para alinearnos con los intereses a largo plazo de los accionistas del Grupo GS y con los intereses de los fondos que gestiona la empresa.
- 3. Empleamos la retribución como una herramienta importante para atraer, mantener y motivar el talento.
- 4. Alineamos la retribución total con el rendimiento corporativo a lo largo del periodo.

El programa de remuneraciones de la Sociedad pretende ser lo suficientemente flexible como para permitir respuestas a los cambios en las condiciones de mercado, pero se basa en un marco que mantiene prácticas de remuneración efectivas.

### b. Gobernanza de las remuneraciones

El Consejo de Administración de la Sociedad es responsable de supervisar la planificación, la ejecución y la revisión de la política de retribución de la Sociedad, con sujeción a la supervisión del Comité de Retribución del Consejo de Administración del Grupo GS (el "Comité de Retribución del Grupo GS"), la empresa matriz de la Sociedad.

Los miembros del Comité de Retribución del Grupo GS a finales de 2020 fueron M. Michele Burns (presidente), Drew G. Faust, Ellen J. Kullman, Lakshmi N. Mittal y Adebayo O. Ogunlesi (*ex officio*). Ningún miembro del Comité de Retribución del Grupo GS era empleado de la empresa. Todos los miembros del Comité de Retribución del Grupo GS eran "independientes" en el sentido de las normas de la Bolsa de Nueva York y la Política de Independencia de los Consejeros de la empresa.

El Comité de Retribución del Grupo GS reconoce desde hace varios años la importancia de utilizar un asesor de remuneraciones independiente que esté debidamente cualificado y que preste servicios únicamente al Comité de Retribución del Grupo GS y no a la empresa. El Comité de Retribución siguió contratando a un consultor independiente en materia de remuneración en 2020.

El proceso general del Grupo GS para fijar la remuneración variable (incluido el requisito de considerar las cuestiones de riesgo y de cumplimiento) se aplica a los empleados de la Sociedad de igual manera que a los empleados de otras entidades y otras regiones y está sujeto a la supervisión de los gestores superiores de la empresa en la región.

### c. Vínculo entre remuneración y rendimiento

La remuneración anual de los empleados se compone generalmente de remuneración fija y variable. Las prácticas de remuneración de la Sociedad estipulan que las determinaciones de la remuneración variable se realicen de manera discrecional. La remuneración variable se basa en varios factores y no se establece como un porcentaje fijo de los ingresos ni por referencia a ninguna otra fórmula. El rendimiento a nivel de la empresa es un factor fundamental para determinar la remuneración variable.

# Goldman Sachs Funds Anexo VI—Enunciados del Informe anual de la sociedad gestora (sin auditar) Correspondiente al ejercicio cerrado a 30 de noviembre de 2021

### I. Remuneración (continuación)

#### d. Medición de rendimientos

La remuneración variable del cierre del ejercicio se determina a través de un proceso discrecional que se basa en determinadas métricas cualitativas y cuantitativas (entre otros factores) con las que se evalúa el rendimiento al cierre del ejercicio. No establecemos metas específicas u otros objetivos con el propósito de determinar la remuneración variable del cierre del ejercicio ni establecemos un grupo de remuneración inicial que se ajuste a dichas metas u otros objetivos. Estas métricas no son formulistas ni tienen una ponderación específica. Además, se evalúa a los empleados de forma anual como parte del proceso de respuesta de "360 grados".

### e. Ajuste del riesgo

La gestión prudente del riesgo es un distintivo tanto de la empresa como de la cultura de la Sociedad, y la sensibilidad al riesgo y la gestión del riesgo son elementos esenciales para evaluar el rendimiento de los empleados, incluido como parte del proceso de respuesta de "360 grados" mencionado anteriormente.

Tenemos en cuenta el riesgo al establecer la cantidad y la forma de la remuneración variable para los empleados. Proporcionamos pautas para ayudar a los gestores de retribución cuando aplican la capacidad discrecional durante el proceso de remuneraciones para promover la consideración coherente de las diferentes métricas o factores considerados durante el proceso de remuneración. Asimismo, para garantizar la independencia de los empleados de la función de control, la remuneración de esos empleados no está determinada por las personas en puestos que generan ingresos, sino más bien por la gestión de la función de control correspondiente.

#### f. Estructura de remuneración

- 1. Remuneración fija: formada por el salario base y las prestaciones según la función, en su caso.
- 2. Remuneración variable: para los empleados con remuneración total y variable por encima de un umbral específico, la remuneración variable generalmente se paga en una combinación de efectivo y remuneración basada en acciones. En general, la parte abonada como concesiones basadas en renta variable aumenta según lo haga la remuneración variable y, para el Personal identificado de OICVM, garantizará el cumplimiento de la Ley del Banco Central (Supervisión y Aplicación) de 2013 (artículo 48(1)) (Organismos de Inversión Colectiva en Valores Mobiliarios) de 2019.

### g. Remuneración

Remuneración del personal para el ejercicio cerrado a 31 de diciembre de 20202:

Remuneración total correspondiente al ejercicio cerrado a 31 de diciembre de 2020 abonada al personal³ de la Sociedad y al personal del delegado designado para la gestión de la cartera de la Sociedad respecto a la gestión de los OICVM	2.055.145 USD, de los cuales:     1.707.488 USD corresponden a la remuneración fija     347.657 USD corresponden a la remuneración variable
Incluye:	
(a) Remuneración abonada a altos directivos	688.149 USD
(b) Remuneración abonada a otros miembros del personal cuya actividad tiene un impacto significativo en el perfil de riesgo de los OICVM	640.339 USD

Las cifras de remuneración anteriores:

- 1. representan la proporción de la remuneración fija del personal en relación con el tiempo dedicado al trabajo de OICVM;
- 2. no se han desglosado en relación a cada uno de los OICVM en lo que respecta a la Sociedad, ya que el personal de la Sociedad ofrece sus servicios a todos los OICVM de forma colectiva en lugar de hacerlo OICVM por OICVM y, por consiguiente, no se puede acceder fácilmente a dicho desglose. Sin embargo, para los servicios delegados de gestión de la cartera prestados por GSAMI, dichos servicios se han considerado OICVM por OICVM y el cálculo anterior incorpora un desglose estimado por OICVM.

<sup>1</sup> A 30 de noviembre de 2021 y en lo que respecta únicamente a la Sociedad (sin incluir personal del delegado designado para la gestión de la cartera).

<sup>&</sup>lt;sup>2</sup> El ejercicio de Goldman Sachs Group, Inc. con fines de remuneración no se ajusta al ejercicio del OICVM. Por tanto, se presentan las cifras de remuneración correspondientes a 2020.

<sup>&</sup>lt;sup>3</sup> Se excluye a cuatro miembros del personal de la Sociedad que se incorporaron durante el año 2021 y que, por tanto, no recibieron remuneración por el ejercicio cerrado a 31 de diciembre de 2020 como personal de la Sociedad.

La Sociedad Gestora debe presentar un informe anual correspondiente al ejercicio fiscal de cada uno de sus Fondos que contenga determinados enunciados con arreglo al Artículo 13 del Reglamento 2015/2365 de la Comisión Europea sobre transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización (el "Reglamento"). La información mostrada a continuación se incluye para cumplir con los requisitos del Reglamento.

### I. Datos generales

Consulte la Nota 6 Préstamo de valores para obtener más información sobre el importe de los valores prestados expresado en términos absolutos, como proporción del total de activos disponibles y respecto al patrimonio.

Para obtener más información sobre el importe de las permutas de rendimiento total ("TRS") en términos absolutos y como porcentaje del patrimonio, consulte los distintos Estados de las inversiones.

#### II. Datos de concentración

La tabla a continuación muestra los 10 mejores emisores más importantes de las garantías no monetarias totales recibidas por la Cartera que se encuentra en circulación a 30 de noviembre de 2021. Para obtener más información sobre las garantías en efectivo, consulte la Nota 13.

Cartera	Divisa de la cartera	Emisor de garantías no monetarias	Valor de mercado de garantías recibidas	% del patrimonio de los Accionistas
Asia Equity Portfolio	USD	República Federal de Alemania	669.259	0,28 %
Emerging Markets Equity Portfolio	USD	República Federal de Alemania	18.540.963	0,36 %
Global Millennials Equity Portfolio	USD	República Federal de Alemania	4.090.788	0,14 %
Japan Equity Portfolio*	JPY	República Federal de Alemania	408.496	0,22 %
- · · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	1100	República Federal de Alemania	10.887.397	0,38 %
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	USD	Gobierno de los Países Bajos	7.720.620	0,27 %
Europe CORE® Equity Portfolio	EUR	República Federal de Alemania	7.731.538	0,44 %
Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	República Federal de Alemania	2.102.357	0,29 %
US Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	República Federal de Alemania	976.167	0,51 %
Clabal High Viold Double	LICD	República Federal de Alemania	57.211.943	1,87 %
Global High Yield Portfolio	USD	Gobierno de los Países Bajos	1.885.173	0,06 %

<sup>\*</sup> Expresado en miles.

La tabla a continuación muestra las 10 contrapartes más importantes por la Cartera en cada tipo de operación de financiación de valores ("SFT") y TRS, respecto a las operaciones en circulación a 30 de noviembre de 2021:

		Préstamos de valores		
Cartera	Divisa de la cartera	Contraparte	Valor de mercado de los valores prestados	% del patrimonio de los Accionistas
Asia Faville Dauffelia	USD	Goldman Sachs International	548.137	0,23 %
Asia Equity Portfolio	080	Nomura International Plc.	58.900	0,02 %
Emerging Markets Equity Portfolio	USD	Goldman Sachs International	16.817.200	0,33 %
Global Millennials Equity Portfolio	USD	Goldman Sachs International	3.710.466	0,13 %
Japan Equity Portfolio*	JPY	Merrill Lynch International	370.517	0,20 %
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	USD	Goldman Sachs International	9.828.353	0,35 %
Emerging Markets CORE Equity Fortions	030	Citibank N.A.	7.049.667	0,25 %
		Barclays Bank Plc.	3.872.036	0,22 %
Europe CORE® Equity Portfolio	EUR	UBS AG	1.765.721	0,10 %
Europe CORE Equity Fortiono	LOK	Goldman Sachs International	958.071	0,05 %
		Morgan Stanley & Co. International Ltd.	416.903	0,02 %
		Goldman Sachs International	1.051.232	0,15 %
Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	Merrill Lynch International	527.639	0,07 %
		Barclays Bank Plc.	328.024	0,05 %

### II. Datos de concentración (continuación)

Préstamos de valores								
Cartera	Divisa de la cartera	Contraparte	Valor de mercado de los valores prestados	% del patrimonio de los Accionistas				
US Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	Goldman Sachs International	885.413	0,46 %				
		Barclays Bank Plc.	28.961.394	0,94 %				
Global High Yield Portfolio	USD	Goldman Sachs International	22.931.526	0,75 %				
		Nomura International Plc.	1.709.907	0,06 %				

<sup>\*</sup> Expresado en miles.

Permutas de rendimiento total							
Cartera	Divisa de la cartera	Contraparte	Plusvalía/(minusvalía) latente neta USD	% del patrimonio de los Accionistas			
Global High Yield Portfolio	USD	JP Morgan Chase Bank N.A.	171.711	0,01 %			
		JP Morgan Chase Bank N.A.	177.749	0,05 %			
Global Absolute Return Portfolio	USD	Bank of America N.A.	(56.430)	(0,02 %)			
		Merrill Lynch International	(528.310)	(0,16 %)			
Absolute Return Tracker Portfolio	USD	JP Morgan Chase Bank N.A.	(591.928)	(0,05 %)			
Absolute Neturn Hacker Portiono	030	Merrill Lynch International	(1.935.692)	(0,16 %)			

### III. Datos de transacciones

La tabla a continuación muestra un resumen de los países del establecimiento de la contraparte de cada tipo de SFT y TRS por Cartera a 30 de noviembre de 2021:

		País de	Préstamo de valores	Permutas de rendimiento total	
Cartera	Divisa de la cartera	constitución de la contraparte	Valor de mercado de los valores prestados	Plusvalía/(minusvalía) latente neta	Total
Asia Equity Portfolio	USD	Reino Unido	607.037	_	607.037
Emerging Markets Equity Portfolio	USD	Reino Unido	16.817.200	_	16.817.200
Global Millennials Equity Portfolio	USD	Reino Unido	3.710.466	_	3.710.466
Japan Equity Portfolio*	JPY	Reino Unido	370.517	_	370.517
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio		Estados Unidos	7.049.667	_	7.049.667
Emerging Markets CORE Equity Portions	USD	Reino Unido	9.828.353	_	9.828.353
Curana CODE® Causta Dantalia	FUD	Suiza	1.765.722	_	1.765.722
Europe CORE® Equity Portfolio	EUR	Reino Unido	5.247.009	_	5.247.009
Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	Reino Unido	1.906.895	_	1.906.895
US Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	Reino Unido	885.413	_	885.413
Global High Yield Portfolio	USD	Reino Unido	53.602.827	171.711	53.774.538
Clabal Abadista Datum Dattelia		Reino Unido	_	(350.561)	(350.561)
Global Absolute Return Portfolio	USD	Estados Unidos	_	(56.430)	(56.430)
Absolute Return Tracker Portfolio	USD	Reino Unido	_	(2.527.620)	(2.527.620)

<sup>\*</sup> Expresado en miles.

### III. Datos de transacción (continuación)

La tabla a continuación muestra un resumen de las divisas de las garantías recibidas y pignoradas por Cartera de cada tipo de SFT y TRS a 30 de noviembre de 2021:

			Garantías no monetarias Préstamo de valores	Garantías monetarias  Derivados (OTC) <sup>1</sup>	
Cartera	Divisa de la cartera	Divisa de la garantía	Valor de mercado de la garantía recibida	Valor de mercado de la garantía recibida / (pignorada)	Total
Asia Equity Portfolio	USD	EUR	669.259	_	669.259
Emerging Markets Equity Portfolio	USD	EUR	18.540.963	_	18.540.963
Global Millennials Equity Portfolio	USD	EUR	4.090.788	_	4.090.788
Japan Equity Portfolio*	JPY	EUR	408.496	_	408.496
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	USD	EUR	18.608.017	_	18.608.017
Europe CORE® Equity Portfolio	EUR	EUR	7.731.538	_	7.731.538
Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	EUR	2.102.357	_	2.102.357
US Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	EUR	976.167	_	976.167
Global High Yield Portfolio	USD	EUR	59.097.116	(270.334)	58.826.782
Global Absolute Return Portfolio	USD	USD	_	(22.866.041)	(22.866.041)
Absolute Return Tracker Portfolio	USD	USD	_	(24.565.958)	(24.565.958)

<sup>&</sup>lt;sup>1</sup> Permutas de rendimiento total normalmente negociadas bajo un contrato maestro ISDA ("ISDA") que rige varios tipos de permutas y operaciones de divisas llevadas a cabo entre la Cartera y cada contraparte de cada permuta. Según el ISDA, la garantía se calcula a diario de forma imponible y neta en todas las operaciones y, por lo tanto, una parte de esta garantía está relacionada con las operaciones de derivados fuera del ámbito de las SFTR.

Consulte la Nota 6 Préstamo de valores para obtener más información sobre la calidad de las garantías no monetarias recibidas.

La tabla a continuación muestra un resumen del plazo de vencimiento de las garantías recibidas y pignoradas por Cartera de cada tipo de SFT y TRS a 30 de noviembre de 2021:

			Garantías no monetarias	Garantías monetarias	
			Préstamo de valores	Derivados (OTC) <sup>1</sup>	
Cartera	Divisa de la cartera	Plazo de vencimiento	Valor de mercado de la garantía recibida	Valor de mercado de la garantía recibida / (pignorada)	Total
		Menos de un día	_	_	_
		De un día a una semana	_	_	_
	USD	De una semana a un mes	_	_	_
Asia Equity Portfolio		De uno a tres meses	604.321	_	604.321
Asia Equity Fortiono		De tres meses a un año	_	_	_
		Más de un año	64.938	_	64.938
		Vencimiento abierto	_	_	_
		Total	669.259	_	669.259
		Menos de un día	_	_	_
		De un día a una semana	_	_	_
		De una semana a un mes	_	_	_
Emerging Markets Equity Portfolio	USD	De uno a tres meses	_	_	_
	030	De tres meses a un año	_	_	_
		Más de un año	18.540.963	_	18.540.963
		Vencimiento abierto	_	_	_
		Total	18.540.963	_	18.540.963

Expresado en miles.

### III. Datos de transacción (continuación)

			Garantías no monetarias	Garantías monetarias	
			Préstamo de valores	Derivados (OTC) <sup>1</sup>	
Cartera	Divisa de la cartera	Plazo de vencimiento	Valor de mercado de la garantía recibida	Valor de mercado de la garantía recibida / (pignorada)	Total
		Menos de un día	_	_	_
		De un día a una semana	_	_	_
		De una semana a un mes	_	_	_
Global Millennials Equity Portfolio	USD	De uno a tres meses	_	_	
Closal Illinoinnaic Equity i citiene	005	De tres meses a un año	_	_	
		Más de un año	4.090.788	_	4.090.788
		Vencimiento abierto		_	
		Total	4.090.788	_	4.090.788
		Menos de un día		_	
		De un día a una semana	_	_	_
		De una semana a un mes	_	_	
Japan Equity Portfolio*	JPY	De uno a tres meses	_	_	_
		De tres meses a un año		_	-
		Más de un año	408.496	_	408.496
		Vencimiento abierto		_	-
		Total	408.496	_	408.496
		Menos de un día	_	_	
		De un día a una semana	_		
		De una semana a un mes		_	
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	USD	De uno a tres meses			<u></u>
		De tres meses a un año  Más de un año	51.499 18.556.518	_	51.499 18.556.518
		Vencimiento abierto	10.556.516	_	10.556.516
		Total	18.608.017	_	18.608.017
		Menos de un día	10.000.017	_	10.000.017
		De un día a una semana		_	<u>_</u>
		De una semana a un mes			
		De uno a tres meses		_	
Europe CORE® Equity Portfolio	EUR	De tres meses a un año		_	
		Más de un año	7.731.538	_	7.731.538
		Vencimiento abierto	7.701.000	_	7.701.000
		Total	7.731.538	_	7.731.538
	+	Menos de un día		_	
		De un día a una semana		_	
		De una semana a un mes	_	_	
		De uno a tres meses	_	_	
Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	De tres meses a un año	1.158.984	_	1.158.984
		Más de un año	943.373	_	943.373
		Vencimiento abierto		_	
		Total	2.102.357	_	2.102.357

### III. Datos de transacción (continuación)

			Garantías no monetarias	Garantías monetarias	
			Préstamo de valores	Derivados (OTC) <sup>1</sup>	
Cartera	Divisa de la cartera	Plazo de vencimiento	Valor de mercado de la garantía recibida	Valor de mercado de la garantía recibida / (pignorada)	Total
		Menos de un día	_	_	_
		De un día a una semana	_	_	_
		De una semana a un mes	_	_	_
US Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	De uno a tres meses	_	_	_
So chiair sup sorte Equity i ortions	502	De tres meses a un año	_	_	_
		Más de un año	976.167	_	976.167
		Vencimiento abierto		_	
		Total	976.167	_	976.167
		Menos de un día		_	
		De un día a una semana	_	_	_
		De una semana a un mes	_	_	
Emerging Markets Debt Blend Portfolio	USD	De uno a tres meses	_	_	
		De tres meses a un año	_	_	
		Más de un año	_	_	_
		Vencimiento abierto	_	_	
		Total  Menos de un día	_	_	_
		De un día a una semana		_	
		De una semana a un mes		_	
		De uno a tres meses	<u> </u>	_	
Emerging Markets Debt Local Portfolio	USD	De tres meses a un año	_	_	
		Más de un año	_	_	
		Vencimiento abierto	_	_	
		Total	_	_	_
		Menos de un día	_	_	_
		De un día a una semana	_	_	_
		De una semana a un mes	<u> </u>	_	_
		De uno a tres meses	25.282.008	_	25.282.008
Global High Yield Portfolio	USD	De tres meses a un año	_	_	_
		Más de un año	33.815.108	_	33.815.108
		Vencimiento abierto	_	(270.334)	(270.334)
		Total	59.097.116	(270.334)	58.826.782
		Menos de un día			
		De un día a una semana	_	_	
		De una semana a un mes	_	_	_
Global Sovereign Bond Portfolio	USD	De uno a tres meses	_	_	_
Sissai Sovereigh Bond Foltions	030	De tres meses a un año	_	_	_
		Más de un año	_	_	_
		Vencimiento abierto	_	_	_
		Total	_	_	_

### III. Datos de transacción (continuación)

			Garantías no monetarias	Garantías monetarias	
			Préstamo de valores	Derivados (OTC) <sup>1</sup>	
Cartera	Divisa de la cartera	Plazo de vencimiento	Valor de mercado de la garantía recibida	Valor de mercado de la garantía recibida / (pignorada)	Total
		Menos de un día	_	_	-
		De un día a una semana	_	_	_
	USD	De una semana a un mes	_	_	_
Global Absolute Return Portfolio		De uno a tres meses	_	_	-1
Global Absolute Return Fortiono		De tres meses a un año	_	_	_
		Más de un año	_	_	_
		Vencimiento abierto	_	(22.866.041)	(22.866.041)
		Total	_	(22.866.041)	(22.866.041)
		Menos de un día	_	_	_
		De un día a una semana	_	_	_
		De una semana a un mes	_	_	_
Absolute Return Tracker Portfolio	USD	De uno a tres meses	_	_	_
ADSOIDLE RELUITI HACKEI PULLONO	030	De tres meses a un año	_	_	_
		Más de un año	_	_	_
		Vencimiento abierto	_	(24.565.958)	(24.565.958)
		Total	_	(24.565.958)	(24.565.958)

<sup>&</sup>lt;sup>1</sup> Permutas de rendimiento total normalmente negociadas bajo un contrato maestro ISDA ("ISDA") que rige varios tipos de permutas y operaciones de divisas llevadas a cabo entre la Cartera y cada contraparte de cada permuta. Según el ISDA, la garantía se calcula a diario de forma imponible y neta en todas las operaciones y, por lo tanto, una parte de esta garantía está relacionada con las operaciones de derivados fuera del ámbito de las SFTR.

La tabla a continuación muestra un resumen del plazo de vencimiento de cada tipo de SFT y TRS por Cartera a 30 de noviembre de 2021:

Cartera	Divisa de la cartera	Plazo de vencimiento	Préstamo de valores  Valor de mercado de los valores prestados	Permutas de rendimiento total  Plusvalía/ (minusvalía) latente neta	Total
		Menos de un día	_	_	_
		De un día a una semana	_	_	_
		De una semana a un mes	_	_	_
Asia Equity Portfolio	USD	De uno a tres meses	_	_	_
Asia Equity Fortiono		De tres meses a un año	_	_	_
		Más de un año	_	_	_
		Transacción abierta	607.037	_	607.037
		Total	607.037	_	607.037
		Menos de un día	_	_	_
		De un día a una semana	_	_	-
		De una semana a un mes	_	_	I
Emerging Markets Equity Portfolio	USD	De uno a tres meses	_	_	_
Emerging Markets Equity Portfolio	USD	De tres meses a un año	_	_	_
		Más de un año	_	_	_
		Transacción abierta	16.817.200	_	16.817.200
		Total	16.817.200	_	16.817.200

<sup>·</sup> Expresado en miles

### III. Datos de transacción (continuación)

			Préstamo de valores	Permutas de rendimiento total	
Cartera	Divisa de la cartera	Plazo de vencimiento	Valor de mercado de los valores prestados	Plusvalía/ (minusvalía) latente neta	Total
		Menos de un día	+	_	
		De un día a una semana	_	_	_
		De una semana a un mes	<del> </del>	_	_
		De uno a tres meses	_	_	_
Global Millennials Equity Portfolio	USD	De tres meses a un año	<u> </u>	_	_
		Más de un año	_	_	_
		Transacción abierta	3.710.466	_	3.710.466
		Total	3.710.466	_	3.710.466
		Menos de un día	_	_	_
		De un día a una semana	_	_	_
		De una semana a un mes	_	_	_
	15)	De uno a tres meses	<u> </u>	_	_
Japan Equity Portfolio*	JPY	De tres meses a un año	<u> </u>	_	_
		Más de un año	<u> </u>	_	_
		Transacción abierta	370.517	_	370.517
		Total	370.517	_	370.517
		Menos de un día	<u> </u>	_	_
		De un día a una semana	<u> </u>	_	_
		De una semana a un mes	_	_	_
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	USD	De uno a tres meses	_	_	_
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	USD	De tres meses a un año	_	_	_
		Más de un año	_	_	_
		Transacción abierta	16.878.020	_	16.878.020
		Total	16.878.020	_	16.878.020
		Menos de un día	_	_	_
		De un día a una semana	_	_	-
		De una semana a un mes	_	_	_
Europe CORE® Equity Portfolio	EUR	De uno a tres meses	_	_	_
Europe CORE- Equity Portiono	EUR	De tres meses a un año	_	_	-
		Más de un año	_	_	-
		Transacción abierta	7.012.731	_	7.012.731
		Total	7.012.731	_	7.012.731
		Menos de un día	_	_	_
		De un día a una semana	_	_	_
		De una semana a un mes	_	_	_
Clobal Small Can CODE® Equity Particles	USD	De uno a tres meses	_	_	_
Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	090	De tres meses a un año	_	_	_
		Más de un año	_	_	_
		Transacción abierta	1.906.895		1.906.895
		Total	1.906.895	_	1.906.895

### III. Datos de transacción (continuación)

Cartera	Divisa de la cartera	Plazo de vencimiento	Préstamo de valores  Valor de mercado de los valores prestados	Permutas de rendimiento total  Plusvalía/ (minusvalía) latente neta	Total
		Menos de un día	_	_	_
		De un día a una semana	_	_	_
		De una semana a un mes	_	_	_
LIC Consul Con CODE® Equity Doublelia	USD	De uno a tres meses	_	_	_
US Small Cap CORE® Equity Portfolio	090	De tres meses a un año	_	_	_
		Más de un año	_	_	_
		Transacción abierta	885.413	_	885.413
		Total	885.413	_	885.413
		Menos de un día	_	_	_
		De un día a una semana	_	_	_
		De una semana a un mes	_	171.711	171.711
Olah al I Bah Wald Dadfalla	1100	De uno a tres meses	_	_	_
Global High Yield Portfolio	USD	De tres meses a un año	_	_	_
		Más de un año	45.270.143	_	45.270.143
		Transacción abierta	8.332.684	_	8.332.684
		Total	53.602.827	171.711	53.774.538
		Menos de un día	_	_	_
		De un día a una semana	_	(392.066)	(392.066)
		De una semana a un mes	_	_	_
Olahad Ahaahata Batum Bartfalla	1100	De uno a tres meses	_	(136.244)	(136.244)
Global Absolute Return Portfolio	USD	De tres meses a un año	_	121.319	121.319
		Más de un año	_	_	_
		Transacción abierta	_	_	_
		Total	_	(406.991)	(406.991)
		Menos de un día	_	_	_
		De un día a una semana	_	(784.997)	(784.997)
		De una semana a un mes	_	(461.617)	(461.617)
Absolute Return Tracker Portfolio	USD	De uno a tres meses	_	985.186	985.186
Absolute Return Tracker Portiolio	090	De tres meses a un año	_	(2.266.192)	(2.266.192)
		Más de un año	_		_
		Transacción abierta		_	_
		Total	_	(2.527.620)	(2.527.620)

Expresado en miles

Para obtener más información sobre la liquidación y compensación de las SFT y las permutas de rendimiento total, consulte la Nota 3(d)(ii.5)(c) Contratos de permutas financieras y la Nota 6 Préstamo de valores.

Se permite el uso de garantías en determinadas clases de activos, según se indica en el Folleto. Un índice de referencia en efectivo apropiado es una alternativa fiable para estimar la rentabilidad con respecto a la reutilización de esta garantía.

Como se detalla en la Nota 3(c), los costes de transacción de las TRS no están identificados de manera separada.

### IV. Custodia de garantías

En la siguiente tabla se muestra un resumen del importe de las garantías recibidas por Cartera a 30 de noviembre de 2021:

Cartera	Divisa de la cartera	Depositario	Saldo de garantías recibidas
Asia Equity Portfolio	USD	Bank of New York Mellon Corp.	669.259
Emerging Markets Equity Portfolio	USD	Bank of New York Mellon Corp.	18.540.963
Global Millennials Equity Portfolio	USD	Bank of New York Mellon Corp.	4.090.788
Japan Equity Portfolio*	JPY	Bank of New York Mellon Corp.	408.496
Emerging Markets CORE® Equity Portfolio	USD	Bank of New York Mellon Corp.	18.608.017
Europe CORE® Equity Portfolio	EUR	Bank of New York Mellon Corp.	7.731.538
Global Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	Bank of New York Mellon Corp.	2.102.357
US Small Cap CORE® Equity Portfolio	USD	Bank of New York Mellon Corp.	976.167
		Bank of New York Mellon Corp.	59.097.116
Global High Yield Portfolio	USD	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch	4.331.819
Global Absolute Return Portfolio	USD	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch	40.534
Absolute Return Tracker Portfolio	USD	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch	1.624.042

<sup>\*</sup> Expresado en miles.

En la tabla que figura a continuación se muestra un resumen del porcentaje de las garantías pignoradas por Cartera mantenidas en cuentas segregadas o en cuentas combinadas a 30 de noviembre de 2021:

		% de las garantías mantenidas en:				
Cartera	Contraparte	Cuentas segregadas	Cuentas combinadas	Total		
	Australia and New Zealand Banking Group Ltd.	100 %	_	100 %		
Global High Yield Portfolio	BNP Paribas S.A.	100 %	_	100 %		
	Merrill Lynch International	100 %	_	100 %		
	Bank of America N.A.	100 %	_	100 %		
	Barclays Bank Plc.	100 %	_	100 %		
Olahal Abaah da Baham Bartfalla	BNP Paribas S.A.	100 %	_	100 %		
Global Absolute Return Portfolio	JP Morgan Chase Bank N.A.	100 %	_	100 %		
	Merrill Lynch International	100 %	_	100 %		
	Morgan Stanley	100 %	_	100 %		
Abachita Datum Tradica Doutfalia	JP Morgan Chase Bank N.A.	100 %	_	100 %		
Absolute Return Tracker Portfolio	Merrill Lynch International	100 %	_	100 %		

### Goldman Sachs Funds Notas adicionales (sin auditar)

### Documentación de oferta

Este material se le proporciona bajo solicitud y tiene un propósito puramente informativo; no constituye una oferta de negocio en ninguna jurisdicción en la que una oferta de este tipo sería ilegal, ni a ninguna persona a la que sería ilegal realizar dicha oferta. Solo contiene información seleccionada con respecto al fondo y no constituye una oferta para comprar acciones en el fondo. Antes de realizar una inversión, los futuros inversores deberán consultar el último Documento de datos fundamentales para el inversor, además de la documentación de oferta, entre la cual se incluye el folleto del Fondo que contiene, entre otras, una notificación exhaustiva de los riesgos aplicables. Los estatutos relevantes, el folleto, el suplemento, el Documento de datos fundamentales para el inversor y el último informe anual/ semestral se encuentran disponibles y de manera gratuita a través del agente de pagos e información o de su asesor financiero.

### Distribución de Acciones

Las acciones del Fondo pueden no estar registradas para su distribución pública en varias jurisdicciones (entre ellas, cualquier país de América Latina o África). Por ese motivo, las acciones del Fondo no deben comercializarse ni ofrecerse a los residentes de dichas jurisdicciones, a menos que dicha comercialización u oferta se realice de acuerdo con las exenciones aplicables a la emisión privada de planes de inversión colectiva y otras normas y reglamentos jurisdiccionales aplicables.

### Asesoramiento de inversión y posible pérdida

Por lo general, los asesores financieros sugieren una cartera diversificada de inversiones. El Fondo que se describe en el presente documento no representa una inversión diversificada. Este material no debe interpretarse como un asesoramiento fiscal o de inversiones. Los futuros inversores deben consultar con su asesor financiero y fiscal antes de invertir para así determinar si una inversión sería adecuada para ellos. **Un inversor debe invertir solo si cuenta con los recursos financieros necesarios para afrontar la pérdida completa de esta inversión.** 

El rendimiento pasado no es garantía de futuros beneficios, los cuales pueden variar. El valor de las inversiones y los rendimientos generados de ellas fluctuarán y pueden oscilar tanto al alza como a la baja. Es posible incurrir en pérdidas de capital.

### Índices de referencia

Cualquier referencia a índices, índices de referencia u otras medidas del rendimiento relativo del mercado en un periodo de tiempo concreto se ofrecen únicamente a título informativo y no implica que la cartera obtendrá resultados similares. La composición del índice puede no reflejar la manera en que se construye una cartera. Aunque un asesor trate de diseñar una cartera que presente un perfil adecuado de riesgo y rentabilidad, las características de la cartera podrían ser distintas a las del índice de referencia.

### Confidencialidad

Queda prohibido, sin la autorización previa por escrito de Goldman Sachs, (i) copiar, fotocopiar o duplicar cualquier parte de este documento, de ninguna manera y bajo ningún motivo, o (ii) distribuirlo a cualquier persona que no sea empleado, directivo, consejero o agente autorizado del destinatario.

### Información importante para inversores suizos

El Folleto, el Documento de datos fundamentales para el inversor, los estatutos y los informes anuales y semestrales del fondo se pueden solicitar de forma gratuita al representante en Suiza. En relación a las acciones distribuidas a inversores cualificados en Suiza, el lugar de actividad y la jurisdicción aplicable se hallan en el domicilio social del representante en Suiza.

Representante en Suiza: First Independent Fund Services AG,

Klausstrasse 33, 8008 Zúrich, Suiza.

Agente de pagos: Goldman Sachs Bank AG, Claridenstrasse 25, 8002 Zúrich, Suiza.

© 2022 Goldman Sachs. Reservados todos los derechos.



