

NEUBERGER	BERMAN
-----------	--------



NEUBERGER BERMAN INVESTMENT FUNDS PLC INFORME SEMESTRAL 2024

CUENTAS ABREVIADAS NO AUDITADAS
PERIODO FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

Índice

	PÁGINA
DIRECCIÓN Y ADMINISTRACIÓN	1
INFORMACIÓN GENERAL	3
INFORME DEL GESTOR DE INVERSIONES	5
CARTERA DE INVERSIONES	
Neuberger Berman 5G Connectivity Fund (o «5G Connectivity») – Cartera de inversiones	58
Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (o «Absolute Return Multi Strategy») – Cartera de inversiones	64
Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (o «China A-Share Equity») – Cartera de inversiones	65
Neuberger Berman China Bond Fund (o «China Bond») – Cartera de inversiones	68
Neuberger Berman China Equity Fund (o «China Equity») – Cartera de inversiones	71
Neuberger Berman Climate Innovation Fund (o «Climate Innovation») – Cartera de inversiones	74
Neuberger Berman CLO Income Fund (o «CLO Income») – Cartera de inversiones	76
Neuberger Berman Commodities Fund (o «Commodities») – Cartera de inversiones	83
Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (o «Corporate Hybrid Bond») – Cartera de inversiones	86
Neuberger Berman Developed Market FMP - 2027 (o «Developed Market FMP – 2027») – Cartera de inversiones	91
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (o «Emerging Market Debt - Hard Currency») – Cartera de inversiones	94
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (o «Emerging Market Debt - Local Currency») – Cartera de inversiones	106
Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (o «Emerging Market Debt Blend») – Cartera de inversiones	122
Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (o «Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend») – Cartera de inversiones	149
Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (o «Emerging Markets Equity») – Cartera de inversiones	163
Neuberger Berman Euro Bond Fund (o «Euro Bond») – Cartera de inversiones	169
Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (o «Euro Bond Absolute Return») – Cartera de inversiones	175
Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (o «European High Yield Bond») – Cartera de inversiones	183

Índice (cont.)

	PÁGINA
Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (o «European Sustainable Equity») – Cartera de inversiones	191
Neuberger Berman Event Driven Fund (o «Event Driven») – Cartera de inversiones	193
Neuberger Berman Global Bond Fund (o «Global Bond») – Cartera de inversiones	197
Neuberger Berman Global Diversified Income FMP – 2024 (o «Global Diversified Income FMP – 2024») – Cartera de inversiones	220
Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund (o «Global Equity Megatrends») – Cartera de inversiones	222
Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund (o «Global Flexible Credit Income») – Cartera de inversiones	224
Neuberger Berman Global High Yield SDG Engagement Fund (o «Global High Yield SDG Engagement») – Cartera de inversiones	242
Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund (o «Global Investment Grade Credit») – Cartera de inversiones	264
Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (o «Global Opportunistic Bond») – Cartera de inversiones	273
Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (o «Global Real Estate Securities») – Cartera de inversiones	296
Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund (o «Global Sustainable Equity») – Cartera de inversiones	300
Neuberger Berman Global Sustainable Value Fund (o «Global Sustainable Value») – Cartera de inversiones	302
Neuberger Berman High Yield Bond Fund (o «High Yield Bond») – Cartera de inversiones	311
Neuberger Berman InnovAsia 5G Fund (o «InnovAsia 5G») – Cartera de inversiones	331
Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (o «Japan Equity Engagement») – Cartera de inversiones	335
Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund (o «Next Generation Mobility») – Cartera de inversiones	339
Neuberger Berman Next Generation Space Economy Fund (o «Next Generation Space Economy») – Cartera de inversiones	342
Neuberger Berman Responsible Asian Debt - Hard Currency Fund (o «Responsible Asian Debt - Hard Currency») – Cartera de inversiones	345
Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (o «Short Duration Emerging Market Debt») – Cartera de inversiones	353
Neuberger Berman Short Duration High Yield SDG Engagement Fund (o «Short Duration High Yield SDG Engagement») – Cartera de inversiones	364

Índice (cont.)

	PÁGINA
Neuberger Berman Strategic Income Fund (o «Strategic Income») – Cartera de inversiones	376
Neuberger Berman Sustainable Asia High Yield Fund (o «Sustainable Asia High Yield») – Cartera de inversiones	421
Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Corporate Debt Fund (o «Sustainable Emerging Market Corporate Debt») – Cartera de inversiones	425
Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (o «Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency») – Cartera de inversiones	437
Neuberger Berman Tactical Macro Fund (o «Tactical Macro») – Cartera de inversiones	444
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund (o «Ultra Short Term Euro Bond») – Cartera de inversiones	447
Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (o «Uncorrelated Strategies») – Cartera de inversiones	460
Neuberger Berman US Equity Fund (o «US Equity») – Cartera de inversiones	572
Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund (o «US Equity Index PutWrite») – Cartera de inversiones	575
Neuberger Berman US Large Cap Value Fund (o «US Large Cap Value») – Cartera de inversiones	578
Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (o «US Long Short Equity») – Cartera de inversiones	582
Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (o «US Multi Cap Opportunities») – Cartera de inversiones	590
Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (o «US Real Estate Securities») – Cartera de inversiones	593
Neuberger Berman US Small Cap Fund (o «US Small Cap») – Cartera de inversiones	597
Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund (o «US Small Cap Intrinsic Value») – Cartera de inversiones	602
BALANCES	606
CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS	621
ESTADO DE VARIACIONES DEL PATRIMONIO NETO ATRIBUIBLE A LOS TITULARES DE ACCIONES DE PARTICIPACIÓN REEMBOLSABLES	636
INFORME DE COMPRAS Y VENTAS SIGNIFICATIVAS	644
NOTAS DE LAS CUENTAS ABREVIADAS NO AUDITADAS	
Principales políticas contables	752
Efectivo y equivalentes de efectivo	754
Descubierto bancario	754
Capital social	754
Comisiones de gestión, administración, distribución y depósito	755
Honorarios y gastos de los Administradores	777

Índice (cont.)

	PÁGINA
Otras comisiones y gastos	777
Transacciones con partes relacionadas	778
Comparativa del Patrimonio neto y del Valor liquidativo	800
Instrumentos financieros: comunicación de datos	879
Tipos de cambio	929
Ajuste de conversión de divisas	930
Acuerdos de comisiones en especie	931
Separación de pasivos	931
Gestión eficiente de la cartera	931
Línea de crédito	931
Compromiso no financiado	932
Cifras comparativas	932
Acontecimientos significativos durante el período	932
Acontecimientos significativos ocurridos desde el cierre del período	932
Aprobación de las cuentas	932
ANEXO I – RATIOS DE GASTOS TOTALES	933
ANEXO II - REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES	963
ANEXO III – GLOSARIO DE ÍNDICES	991
ANEXO IV – GESTORES DE INVERSIONES, GESTORES DELEGADOS DE INVERSIONES Y SUBASESORES	998

5G Connectivity – Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre analizado, finalizado el 30 de junio de 2024, ascendió al 29,38%. Durante el mismo período, el índice de referencia, el MSCI All Country World Index (rentabilidad total en USD, neta de impuestos) (el «Índice») rindió un 11,30%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. En la rentabilidad total mostrada se han descontado todas las comisiones y los gastos, y se incluye la reinversión de ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Situación macroeconómica, del mercado y de las clases de activos en el periodo analizado

- El contexto económico fue de volatilidad, aunque mostró resiliencia debido a la inflación persistente, los buenos datos económicos y las expectativas de rebajas de tipos por parte de la Reserva Federal.
- Con este trasfondo, el mercado mundial de renta variable obtuvo rentabilidades positivas gracias a las grandes tecnológicas en un contexto de sólidos beneficios empresariales y perspectivas optimistas para la IA.
- Las empresas con exposición a la IA tuvieron un comportamiento superior al de otros segmentos del mercado. La excelente temporada de resultados de las empresas tecnológicas hizo que las acciones growth fuesen una de las clases de activos que mejor se comportaron.

Factores que afectaron al comportamiento de la cartera durante el periodo analizado

- Contribuyentes a la rentabilidad relativa:
 - Sobreponderación en semiconductores frente al Índice
 - La selección de valores en hardware y equipos tecnológicos e industria a nivel de sectores, así como la selección en Asia por regiones.
 - La exposición a los máximos exponentes en infraestructuras de IA, como empresas del ámbito de la computación de alto rendimiento, la gestión térmica o eléctrica y las redes de alta velocidad
- Detractores de la rentabilidad relativa:
 - La selección de valores en software
 - Exposición a empresas con unas perspectivas más débiles de crecimiento a corto plazo

Resumen de la actividad de inversión durante el periodo analizado

- Se incrementó la exposición a los semiconductores ante las tendencias favorables para la IA y debido a que el ciclo de mercado ha tocado fondo
- Aumento de la exposición tanto a los habilitadores como a los beneficiarios de la IA debido a las tendencias de fuerte demanda y de crecimiento de los beneficios
- Menor exposición al software a causa de un deterioro de la confianza
- Realización oportunista de beneficios sobre los valores más destacados durante los repuntes para asegurarse las rentabilidades en un contexto de volatilidad del mercado

Pese a que nos encontramos al final del ciclo de subidas de los tipos, podría continuar la incertidumbre macroeconómica. Dado que persiste la volatilidad, seguimos centrados en aquellos segmentos que registran sólidas tendencias favorables de beneficios, al tiempo que mantenemos nuestra disciplina de valoración. La conectividad de última generación sigue siendo la base de las innovaciones tecnológicas actuales y futuras. Somos optimistas con respecto a los beneficiarios de la aceleración en la adopción de la IA, que es el sector estratégico de los semiconductores, así como por la proliferación del Internet de las Cosas («IoT») industrial.

Climate Innovation – Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre analizado, finalizado el 30 de junio de 2024, ascendió al 8,35%. Durante el mismo período, el índice de referencia, el MSCI All Country World Index (rentabilidad total en USD, neta de impuestos) (el «Índice») rindió un 11,30%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. En la rentabilidad total mostrada se han descontado todas las comisiones y los gastos, y se incluye la reinversión de ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Situación macroeconómica, del mercado y de las clases de activos en el periodo analizado

- En el primer semestre de 2024, el sector estadounidense de las energías limpias experimentó una combinación de señales macroeconómicas y avances en sectores concretos. La dinámica del mercado fue diversa, en la que contrastó la demanda solar a escala de los suministros públicos en los Estados Unidos con las dificultades del mercado residencial europeo.
- El papel de los cambios normativos siguió siendo fundamental, con nuevas normas sobre emisiones e incentivos para las inversiones verdes, sumadas a una ley del Senado estadounidense para agilizar la concesión de permisos para reactores nucleares. Otros hechos destacados fueron el acuerdo de Google en materia de energía geotérmica y las perspectivas positivas de Bloomberg NEF con respecto a la energía eólica a nivel mundial. Sin embargo, la energía solar se enfrenta a posibles perturbaciones, ya que los productores de energía solar fotovoltaica estadounidenses han presentado una solicitud de medidas antielusión y compensatorias dirigida a los productores del Sudeste Asiático.
- En general, en el período se puso de relieve una confluencia fundamental entre intervención política, avance tecnológico y oportunidades de inversión que impulsan las iniciativas de descarbonización a nivel mundial.

Factores que afectaron al comportamiento de la cartera durante el periodo analizado

- Contribuyentes a la rentabilidad relativa:
 - La infraponderación en los sectores de consumo básico, atención sanitaria e inmobiliario con respecto al Índice
 - La selección de valores en el sector industrial
- Detractores de la rentabilidad relativa:
 - La sobreponderación en el sector industrial y de materiales frente al Índice
 - La selección de valores en el sector de tecnología de la información

Resumen de la actividad de inversión durante el periodo analizado

- Adiciones y apertura de nuevas posiciones en empresas de distintos sectores, entre ellos las energías renovables, la industria y las industrias pesadas, con especial atención a las empresas que ofrecen innovaciones tecnológicas, así como a las que creemos que se beneficiarán del hecho de que los ciclos industrial y de la automoción estén tocando fondo y aprovechan el crecimiento generalizado gracias al apoyo normativo.
- Se cerraron posiciones en aquellas empresas en las que se consideró menos favorable el riesgo/remuneración relativo o en las que siguieron presentando problemas específicos de mercado o sectoriales.

Seguimos pensando que este constituye un punto crítico para la descarbonización a nivel mundial, en el que confluyen la intervención política, las costumbres sociales y la capacidad tecnológica para impulsar importantes oportunidades de inversión. En muchos sectores, las tecnologías de captura eficaces y la diferenciación comercial contribuyen a determinar qué empresas prosperan y cuáles se quedarán atrás. Esta Cartera pretende invertir en los líderes mundiales de la descarbonización a lo largo de toda la curva de madurez tecnológica.

Developed Market FMP – 2027 – Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre analizado, finalizado el 30 de junio de 2024, fue del 1,54%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. En la rentabilidad total mostrada se han descontado todas las comisiones y los gastos, y se incluye la reinversión de ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Situación macroeconómica, del mercado y de las clases de activos en el periodo analizado

- Los tipos de interés a corto plazo de los mercados desarrollados subieron durante el período, en parte debido a la inquietud en torno a las finanzas públicas, la ralentización de los avances para controlar la inflación y el retraso en la flexibilización de la política de tipos por parte de la mayoría de los principales bancos centrales.
- Los diferenciales del crédito global con y sin grado de inversión se comprimieron durante el período, lo que refleja la sólida demanda de los activos de crédito.
- El comportamiento del mercado de renta fija fue dispar durante el período, y los valores sensibles a los tipos de interés ofrecieron, en términos generales, rentabilidades relativas inferiores como consecuencia de la subida de los tipos.

Factores que afectaron al comportamiento de la cartera durante el periodo analizado

- Contribuyentes a la rentabilidad absoluta:
 - La exposición a crédito con grado de inversión de mercados desarrollados.
 - La exposición al alto rendimiento de mercados desarrollados
- Detractores de la rentabilidad absoluta:
 - No hubo detractores importantes desde la perspectiva sectorial.

Resumen de la actividad de inversión durante el periodo analizado

- En sintonía con el lema «comprar y mantener» de la Cartera, no se realizaron cambios de posicionamiento significativos durante el período.
- La cartera invierte en una combinación diversa de crédito de alto rendimiento y con grado de inversión de mercados desarrollados.

De cara al futuro, preveemos una ralentización del crecimiento mundial, ya que los consumidores y las empresas continúan sintiendo el efecto de la subida de los precios y del endurecimiento de la política de los bancos centrales. En lo que al crédito se refiere, aunque es justo afirmar que los diferenciales se han mantenido ajustados y se ha descontado plenamente el riesgo para el mercado de deuda corporativa, mantener unos tipos de interés más elevados durante más tiempo ha generado tensiones en algunos emisores y sectores en dificultades, lo que ha brindado a los gestores activos la oportunidad de añadir valor.

Euro Bond Absolute Return – Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I EUR en el semestre analizado, finalizado el 30 de junio de 2024, ascendió al 3,25%. Durante el mismo periodo, el índice ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government (rentabilidad total, en EUR) (el «Índice») registró una rentabilidad del 1,69%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. En la rentabilidad total mostrada se han descontado todas las comisiones y los gastos, y se incluye la reinversión de ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Situación macroeconómica, del mercado y de las clases de activos en el periodo analizado

- Los mercados de renta fija tuvieron unas rentabilidades dispares en el primer semestre de 2024, ya que los mercados de tipos de interés se reajustaron tras la escalada de finales de 2023, a medida que entre los principales bancos centrales ganó peso el argumento de mantenerlos altos durante más tiempo y los datos económicos mantuvieron su resiliencia, conservando unos diferenciales ajustados.

Factores que afectaron al comportamiento de la cartera durante el periodo analizado

- Contribuyentes a la rentabilidad absoluta:
 - Nuestra exposición al crédito sigue siendo positiva para la rentabilidad (288 puntos básicos de la rentabilidad total en el primer semestre del año), los diferenciales se mantienen ajustados y algunas exposiciones idiosincráticas añaden rentabilidades en comparación con el conjunto de los mercados. La recuperación del conjunto del sector inmobiliario fue lo que más impulsó la rentabilidad, a través de empresas como Arountown, SBB y Heimstaden BoStad. Tenemos aproximadamente el 35% de la Cartera invertida en crédito y seguimos dando prioridad al análisis *bottom-up* para identificar oportunidades de rentabilidad total superiores en todo el universo de inversión.
- Detractores de la rentabilidad absoluta:
 - En lo que a la curva de tipos se refiere, nuestra posición en valores que se benefician cuando esta se pronuncia lastró la rentabilidad del primer semestre del año, mientras que nuestras adiciones a la duración también han sido perjudiciales dado el contexto del mercado de tipos en general.

Resumen de la actividad de inversión durante el periodo analizado

- En respuesta a la corriente vendedora causada por los tipos, hemos vuelto a añadir gradualmente alguna duración en el primer semestre. Seguimos creyendo que se han infravalorado ligeramente las bajadas de los tipos de interés por parte del Banco Central Europeo y que se producirá cierta corrección en el segundo semestre.
- Seguimos aumentando de forma oportunista las posiciones en los mercados de crédito, cuyas valoraciones son atractivas, aprovechando el mercado primario y la estrecha relación con los operadores para obtener asignaciones favorables.

Nos centramos en la selección fundamental del crédito, con el apoyo de la gestión activa de la duración y de la actividad en el mercado primario, todos ellos aspectos esenciales de nuestra filosofía y nuestro proceso de inversión, que seguirán teniendo un papel fundamental en este contexto de mercado en constante evolución. En general, creemos que una combinación de rendimientos elevados y fundamentales sólidos constituye un punto de entrada atractivo para los inversores en el mercado en euros, y la gestión activa proporciona la base para sobrellevar los periodos de volatilidad.

Global Bond – Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre analizado, finalizado el 30 de junio de 2024, fue del -3,02%. En el mismo período, el índice de referencia, el Bloomberg Global Aggregate Index (rentabilidad total en USD, sin cobertura) (el «Índice»), rindió un -3,16%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. En la rentabilidad total mostrada se han descontado todas las comisiones y los gastos, y se incluye la reinversión de ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Situación macroeconómica, del mercado y de las clases de activos en el periodo analizado

- Los tipos de interés de los mercados desarrollados subieron durante el período, en parte debido a la inquietud en torno a las finanzas públicas, la ralentización de los avances para controlar la inflación y el retraso en la flexibilización de la política de tipos por parte de la mayoría de los principales bancos centrales.
- Los diferenciales del crédito global con y sin grado de inversión se comprimieron durante el período, lo que refleja la sólida demanda de los activos de crédito.
- El comportamiento del mercado de renta fija fue dispar durante el período, y los valores sensibles a los tipos de interés ofrecieron, en términos generales, rentabilidades relativas inferiores como consecuencia de la subida de los tipos.

Factores que afectaron al comportamiento de la cartera durante el periodo analizado

- Contribuyentes a la rentabilidad relativa:
 - La selección de valores en crédito global con grado de inversión y en valores con garantía hipotecaria de agencias.
 - Exposición sobreponderada en el crédito titulizado.
 - Asignación al alto rendimiento mundial.
- Detractores de la rentabilidad relativa:
 - Exposición infraponderada a China, los países centrales de Europa y los tipos de interés del Reino Unido.
 - Exposición sobreponderada en bonos de titulización hipotecaria de agencias.
 - Exposición a la deuda de mercados emergentes.

Resumen de la actividad de inversión durante el periodo analizado

- Durante el período aumentamos la exposición al crédito titulizado y la deuda soberana de mercados desarrollados.
- Hemos reducido la exposición al crédito con grado de inversión, la deuda de mercados emergentes y los bonos de titulización hipotecaria de agencias.
- Debido a estas operaciones, la duración de la Cartera se redujo ligeramente.

De cara al futuro, prevemos una ralentización del crecimiento mundial, ya que los consumidores y las empresas continúan sintiendo el efecto de la subida de los precios y del endurecimiento de la política de los bancos centrales. En lo que al crédito se refiere, aunque es justo afirmar que los diferenciales se han mantenido ajustados y se ha descontado plenamente el riesgo para el mercado de deuda corporativa, mantener unos tipos de interés más elevados durante más tiempo ha generado tensiones en algunos emisores y sectores en dificultades, lo que ha brindado a los gestores activos la oportunidad de añadir valor. Al mismo tiempo, otros segmentos del ámbito crediticio, como los productos estructurados, pueden ofrecer más oportunidades.

Global Diversified Income FMP – 2024* – Informe del Gestor de inversiones

Desde el 1 de enero de 2024 hasta el cierre de la Cartera el 28 de junio de 2024, la rentabilidad total de la Clase de Acumulación USD I fue del 2,79%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. En la rentabilidad total mostrada se han descontado todas las comisiones y los gastos, y se incluye la reinversión de ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Situación macroeconómica, del mercado y de las clases de activos en el periodo analizado

- Los tipos de interés de los mercados desarrollados a corto plazo aumentaron durante el período, en parte debido a la ralentización de los avances para controlar la inflación y el retraso en la flexibilización de la política de tipos por parte de la mayoría de los principales bancos centrales.
- Los diferenciales del crédito global con y sin grado de inversión se comprimieron durante el período, lo que refleja la sólida demanda de activos de crédito.
- El comportamiento del mercado de renta fija fue dispar durante el período, y los valores sensibles a los tipos de interés ofrecieron, en términos generales, rentabilidades relativas inferiores como consecuencia de la subida de los tipos.

Factores que afectaron a su comportamiento durante el periodo analizado

- Contribuyentes a la rentabilidad absoluta:
 - La exposición a crédito con grado de inversión de mercados desarrollados
 - La exposición a bonos corporativos de mercados emergentes
 - La exposición al alto rendimiento de mercados desarrollados
- Detractores de la rentabilidad absoluta:
 - No hubo detractores importantes desde la perspectiva sectorial.

Resumen de la actividad de inversión durante el periodo analizado

- El ciclo de vida de la Cartera finalizó el 28 de junio de 2024.
- Antes de que finalizase el ciclo de vida de la Cartera, esta invertía en una combinación diversa de crédito de alto rendimiento y con grado de inversión de mercados desarrollados, así como en crédito corporativo de mercados emergentes.

De cara al futuro, prevemos una ralentización del crecimiento mundial, ya que los consumidores y las empresas continúan sintiendo el efecto de la subida de los precios y del endurecimiento de la política de los bancos centrales. En lo que al crédito se refiere, aunque es justo afirmar que los diferenciales se han mantenido ajustados y se ha descontado plenamente el riesgo para el mercado de deuda corporativa, mantener unos tipos de interés más elevados durante más tiempo ha generado tensiones en algunos emisores y sectores en dificultades, lo que ha brindado a los gestores activos la oportunidad de añadir valor.

* La Cartera se liquidó el 28 de junio de 2024.

Global Equity Megatrends – Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre analizado, finalizado el 30 de junio de 2024, ascendió al 13,82%. Durante el mismo periodo, el índice de referencia, el MSCI World Index (rentabilidad total en USD, neto de impuestos) (el «Índice»), registró una rentabilidad del 11,75%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. En la rentabilidad total mostrada se han descontado todas las comisiones y los gastos, y se incluye la reinversión de ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Situación macroeconómica, del mercado y de las clases de activos en el periodo analizado

- Hacia finales del primer semestre de 2024 se moderó la preocupación por la persistencia de la inflación y los mercados mundiales de renta variable siguieron recuperándose de forma desigual.
- La economía estadounidense mantuvo su resiliencia durante el primer semestre de 2024, debido en buena parte a la solidez del mercado laboral y al aumento de los beneficios empresariales.
- Europa da señales de recuperación gradual, aunque las elecciones en el Reino Unido y Francia podrían ser motivo de preocupación para los inversores.
- El Gobierno chino parece decidido a mantener sus estímulos.
- Pese a que no tratamos de predecir los mercados ni el contexto macroeconómico del mercado, prevemos que se mantendrá la volatilidad asociada a la incertidumbre macroeconómica y a los actuales riesgos geopolíticos. Son muchas las «incógnitas conocidas».

Factores que afectaron al comportamiento de la cartera durante el periodo analizado

- Contribuyentes a la rentabilidad relativa:
 - Vistra (infraestructuras de energía), Zeta Global (sistemas inteligentes) y Despegar.com (evolución del consumo mundial)
- Detractores de la rentabilidad relativa:
 - ModivCare (salud y bienestar), Pets at Home (humanización de las mascotas) y Perrigo (salud y bienestar)

Resumen de la actividad de inversión durante el periodo analizado

- En el último año iniciamos una nueva posición en Chart Industries (infraestructuras de energía) y asignamos más capital a NICE (sistemas inteligentes), Perrigo (salud y bienestar) y Amdocs (personalización de medios de comunicación).
- Para financiar estas operaciones principalmente abandonamos nuestra posición en TE Connectivity y moderamos nuestra exposición a Vistra.

A medida que se aproximan las elecciones del 5 de noviembre en Estados Unidos, somos conscientes de que esto suma otra incógnita a la lista de incertidumbres y somos conscientes de que la incertidumbre suele generar volatilidad. Pese a las nubes en el horizonte, creemos que la Cartera está bien posicionada y los inversores pacientes deberían obtener buenos resultados en los próximos años. Es importante señalar que para conservar la paciencia resulta fundamental invertir con convicción. Esta convicción se debe a que nos concentramos en gestionar el riesgo, invirtiendo de forma selectiva en (i) empresas con perspectivas de crecimiento visibles y predecibles porque cada una de ellas está respaldada por fuertes megatendencias y es posible gracias a estas, (ii) empresas con un equipo líder con las que nos entusiasma colaborar, y (iii) empresas que se negocian con atractivas valoraciones plurianuales.

Global Flexible Credit Income – Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre analizado, finalizado el 30 de junio de 2024, fue del 3,54%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. En la rentabilidad total mostrada se han descontado todas las comisiones y los gastos, y se incluye la reinversión de ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Situación macroeconómica, del mercado y de las clases de activos en el periodo analizado

- Los tipos de interés de los mercados desarrollados subieron durante el período, en parte debido a la inquietud en torno a las finanzas públicas, la ralentización de los avances para controlar la inflación y el retraso en la flexibilización de la política de tipos por parte de la mayoría de los principales bancos centrales.
- Los diferenciales del crédito global con y sin grado de inversión se comprimieron durante el período, lo que refleja la sólida demanda de los activos de crédito.
- El comportamiento del mercado de renta fija fue dispar durante el período, y los valores sensibles a los tipos de interés ofrecieron, en términos generales, rentabilidades relativas inferiores como consecuencia de la subida de los tipos.

Factores que afectaron al comportamiento de la cartera durante el periodo analizado

- Contribuyentes a la rentabilidad absoluta:
 - La exposición a la deuda de mercados emergentes en moneda fuerte y de alto rendimiento mundial.
 - La exposición a obligaciones garantizadas por préstamos (CLO) y préstamos preferentes de tipo variable.
 - La exposición al crédito titulado
- Detractores de la rentabilidad absoluta:
 - La exposición al crédito con grado de inversión de EE. UU.

Resumen de la actividad de inversión durante el periodo analizado

- Aumentamos la exposición a las obligaciones garantizadas por préstamos (CLO) y al crédito titulado.
- Redujimos la exposición al crédito global con grado de inversión y al alto rendimiento.
- Hemos incrementado ligeramente la duración de la Cartera durante el período, con la subida de los tipos de interés.

De cara al futuro, prevemos una ralentización del crecimiento mundial, ya que los consumidores y las empresas continúan sintiendo el efecto de la subida de los precios y del endurecimiento de la política de los bancos centrales. En lo que al crédito se refiere, aunque es justo afirmar que los diferenciales se han mantenido ajustados y se ha descontado plenamente el riesgo para el mercado de deuda corporativa, mantener unos tipos de interés más elevados durante más tiempo ha generado tensiones en algunos emisores y sectores en dificultades, lo que ha brindado a los gestores activos la oportunidad de añadir valor. Al mismo tiempo, otros segmentos del ámbito crediticio, como los productos estructurados, pueden ofrecer más oportunidades.

Global Opportunistic Bond – Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre analizado, finalizado el 30 de junio de 2024, fue del -0,17%. En el mismo período, el índice de referencia, el Bloomberg Global Aggregate Index (rentabilidad total en USD, con cobertura), rindió un 0,13%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. En la rentabilidad total mostrada se han descontado todas las comisiones y los gastos, y se incluye la reinversión de ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Situación macroeconómica, del mercado y de las clases de activos en el periodo analizado

- Los tipos de interés de los mercados desarrollados subieron, en parte debido a la inquietud con respecto a las finanzas públicas, la ralentización de los avances para controlar la inflación y el retraso en la flexibilización de la política de tipos por parte de la mayoría de los principales bancos centrales.
- Los diferenciales del crédito global con y sin grado de inversión se comprimieron, lo que refleja la sólida demanda de los activos de crédito.
- El comportamiento del mercado de renta fija fue dispar, y los valores sensibles a los tipos de interés ofrecieron, en términos generales, rentabilidades relativas inferiores como consecuencia de la subida de los tipos.

Factores que afectaron al comportamiento de la cartera durante el periodo analizado

- Contribuyentes a la rentabilidad relativa:
 - Exposición a la deuda de mercados emergentes y de alto rendimiento europea
 - La selección de valores en crédito global con grado de inversión y en crédito titulado
 - El *overlay* de divisas activo de la Cartera.
- Detractores de la rentabilidad relativa:
 - Exposición sobreponderada a los tipos de interés de EE. UU. y Canadá
 - Exposición infraponderada en bonos garantizados y títulos con garantía hipotecaria comercial
 - Exposición sobreponderada en bonos de titulización hipotecaria de agencias

Resumen de la actividad de inversión durante el periodo analizado

- Aumentamos la exposición al alto rendimiento y la deuda soberana de mercados desarrollados.
- Redujimos la exposición a crédito con grado de inversión, los bonos de titulización hipotecaria de agencias y la deuda de mercados emergentes.
- Hemos incrementado ligeramente la duración de la Cartera a medida que subían los tipos de interés.

De cara al futuro, prevemos una ralentización del crecimiento mundial, ya que los consumidores y las empresas continúan sintiendo el efecto de la subida de los precios y del endurecimiento de la política de los bancos centrales. En lo que al crédito se refiere, aunque es justo afirmar que los diferenciales se han mantenido ajustados y se ha descontado plenamente el riesgo para el mercado de deuda corporativa, mantener unos tipos de interés más elevados durante más tiempo ha generado tensiones en algunos emisores y sectores en dificultades, lo que ha brindado a los gestores activos la oportunidad de añadir valor. Al mismo tiempo, otros segmentos del ámbito crediticio, como los productos estructurados, pueden ofrecer más oportunidades.

Macro Opportunities FX* – Informe del Gestor de inversiones

Desde el 1 de enero de 2024 hasta el cierre de la Cartera el 8 de febrero de 2024, la rentabilidad total de la Clase de Acumulación EUR I fue del 1,17%. En el mismo periodo, el índice de referencia, el ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (rentabilidad total en EUR) (el «Índice»), rindió un 0,27%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. En la rentabilidad total mostrada se han descontado todas las comisiones y los gastos, y se incluye la reinversión de ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Situación macroeconómica, del mercado y de las clases de activos en el periodo analizado

- El mercado de divisas mostró una escasa volatilidad durante el período.
- Los rangos de negociación fueron reducidos.
- El mercado mostró una beta elevada con respecto a las perspectivas de la política monetaria estadounidense.

Factores que afectaron al comportamiento de la cartera durante el periodo analizado

- Contribuyentes a la rentabilidad relativa:
 - Las oportunidades de negociación a corto plazo y tácticas fueron las que generaron más resultados positivos en el período.
- Detractores de la rentabilidad relativa:
 - Factores a más largo plazo, como la valoración, lastraron ligeramente la rentabilidad.

Resumen de la actividad de inversión durante el periodo analizado

- La Cartera se cerró el 8 de febrero de 2024. Le agradecemos la oportunidad que nos brindó para ayudarle a satisfacer sus necesidades financieras.

* La Cartera se liquidó el 8 de febrero de 2024.

Strategic Income – Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre analizado, finalizado el 30 de junio de 2024, fue del 0,82%. En el mismo período, el índice de referencia, el Bloomberg US Aggregate Bond (rentabilidad total en USD) (el «Índice»), rindió un -0,71%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. En la rentabilidad total mostrada se han descontado todas las comisiones y los gastos, y se incluye la reinversión de ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Situación macroeconómica, del mercado y de las clases de activos en el periodo analizado

- Los tipos de interés de los mercados desarrollados subieron durante el período, en parte debido a la inquietud en torno a las finanzas públicas, la ralentización de los avances para controlar la inflación y el retraso en la flexibilización de la política de tipos por parte de la mayoría de los principales bancos centrales.
- Los diferenciales del crédito global con y sin grado de inversión se comprimieron durante el período, lo que refleja la sólida demanda de activos de crédito.
- El comportamiento del mercado de renta fija fue dispar durante el período, y los valores sensibles a los tipos de interés ofrecieron, en términos generales, rentabilidades relativas inferiores como consecuencia de la subida de los tipos.

Factores que afectaron al comportamiento de la cartera durante el periodo analizado

- Contribuyentes a la rentabilidad relativa:
 - El posicionamiento en tipos de interés.
 - La asignación al alto rendimiento, las obligaciones de préstamos garantizados (CLO), los préstamos preferentes de tipo variable y el crédito titulado.
 - La selección de valores en crédito corporativo con grado de inversión, valores con garantía hipotecaria y crédito titulado.
- Detractores de la rentabilidad relativa:
 - Asignación a deuda de mercados emergentes en moneda local.
 - La infraponderación en crédito con grado de inversión.
 - La sobreponderación en bonos de titulización hipotecaria de agencias.

Resumen de la actividad de inversión durante el periodo analizado

- Durante el período incrementamos la exposición al crédito titulado.
- Redujimos la exposición a alto rendimiento y al crédito corporativo con grado de inversión.
- Hemos incrementado gradualmente la duración de la Cartera durante el período, con la subida de los tipos de interés.

De cara al futuro, prevemos una ralentización del crecimiento mundial, ya que los consumidores y las empresas continúan sintiendo el efecto de la subida de los precios y del endurecimiento de la política de los bancos centrales. En lo que al crédito se refiere, aunque es justo afirmar que los diferenciales se han mantenido ajustados y se ha descontado plenamente el riesgo para el mercado de deuda corporativa, mantener unos tipos de interés más elevados durante más tiempo ha generado tensiones en algunos emisores y sectores en dificultades, lo que ha brindado a los gestores activos la oportunidad de añadir valor. Al mismo tiempo, otros segmentos del ámbito crediticio, como los productos estructurados, pueden ofrecer más oportunidades.

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Número de Acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 2,92% (31 de diciembre de 2023: 4,75%)			
Dólar estadounidense			
684	AbbVie Inc	117.320	0,01
1.419	Alibaba Group Holding Ltd ADR	102.168	0,01
3.367	APA Corp	99.124	0,01
786	Apple Inc	165.547	0,02
798	ArcBest Corp	85.450	0,01
1.289	Autodesk Inc	318.963	0,04
191	Axon Enterprise Inc	56.200	0,01
3.384	Best Buy Co Inc	285.237	0,03
465	BlackRock Inc Class A	366.104	0,04
2.941	Boston Scientific Corp	226.486	0,03
69	Boyd Gaming Corp	3.802	0,00
880	Brink's Co	90.112	0,01
2.420	Bunge Global SA	258.383	0,03
877	Cardinal Health Inc	86.227	0,01
900	CarMax Inc	66.006	0,01
5.418	CDW Corp	1.212.765	0,14
2.597	Charles Schwab Corp	191.373	0,02
12.932	Chemours Co	291.875	0,03
1.900	Chipotle Mexican Grill Inc Class A	119.035	0,01
153	Cintas Corp	107.140	0,01
2.736	Cleveland-Cliffs Inc	42.107	0,00
2.772	Commercial Metals Co	152.432	0,02
1.980	ConocoPhillips	226.472	0,03
770	Constellation Brands Inc Class A	198.106	0,02
11.000	Corning Inc	427.350	0,05
3.441	Coterra Energy Inc	91.771	0,01
440	Crocs Inc	64.214	0,01
5.654	CSX Corp	189.126	0,02
1.850	Darden Restaurants Inc	279.942	0,03
16.472	Devon Energy Corp	780.773	0,09
924	Diamondback Energy Inc	184.976	0,02
517	Dick's Sporting Goods Inc	111.077	0,01
582	Enovis Corp	26.306	0,00
1.716	EOG Resources Inc	215.993	0,02
5.515	EQT Corp	203.945	0,02
895	FedEx Corp	268.357	0,03
2.140	Fiserv Inc	318.946	0,04
3.983	Freeport-McMoRan Inc	193.574	0,02
2.817	Halliburton Co	95.158	0,01

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Número de Acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 2,92% (31 de diciembre de 2023: 4,75%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
108.704	Herbalife Ltd	1.129.435	0,13
7.369	HF Sinclair Corp	393.062	0,04
577	Hilton Worldwide Holdings Inc	125.901	0,01
33.365	HP Inc	1.168.442	0,13
1.264	Insulet Corp	255.075	0,03
7.960	Kraft Heinz Co	256.471	0,03
1.386	Lear Corp	158.295	0,02
380	Lowe's Cos Inc	83.775	0,01
5.804	LyondellBasell Industries NV Class A	555.211	0,06
2.860	ManpowerGroup Inc	199.628	0,02
10.788	Marathon Oil Corp	309.292	0,03
132	Martin Marietta Materials Inc	71.518	0,01
330	Mastercard Inc Class A	145.583	0,02
2.200	Matador Resources Co	131.120	0,01
143	Meta Platforms Inc Class A	72.103	0,01
1.140	Morgan Stanley	110.797	0,01
3.520	Murphy Oil Corp	145.165	0,02
288	Netflix Inc	194.365	0,02
10.457	Neurocrine Biosciences Inc	1.439.615	0,16
2.667	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	50.113	0,01
1.534	NRG Energy Inc	119.437	0,01
4.533	Nucor Corp	716.577	0,08
8.822	ON Semiconductor Corp	604.748	0,07
23.969	ONEOK Inc	1.954.672	0,22
6.221	Peabody Energy Corp	137.608	0,02
24.206	PG&E Corp	422.637	0,05
1.498	Prudential Financial Inc	175.551	0,02
19.134	Range Resources Corp	641.563	0,07
660	Reliance Inc	188.496	0,02
1.452	Ross Stores Inc	211.005	0,02
616	Ryder System Inc	76.310	0,01
3.080	SEI Investments Co	199.245	0,02
5.402	Semtech Corp	161.412	0,02
2.511	ServiceNow Inc	1.975.328	0,22
10.853	Sibanye Stillwater Ltd ADR	47.211	0,01
1.497	Skyworks Solutions Inc	159.550	0,02
1.299	State Street Corp	96.126	0,01
2.377	T Rowe Price Group Inc	274.092	0,03
618	Take-Two Interactive Software Inc	96.093	0,01
2.561	Targa Resources Corp	329.806	0,04

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Número de Acciones	Descripción de los valores		Valor razonable USD	% del Patrimonio neto		
Valores de renta variable 2,92% (31 de diciembre de 2023: 4,75%) (cont.)						
Dólar estadounidense (cont.)						
220	TD SYNEX Corp		25.388	0,00		
594	Tenet Healthcare Corp		79.020	0,01		
330	Texas Roadhouse Inc Class A		56.664	0,01		
608	Thor Industries Inc		56.818	0,01		
3.864	Trip.com Group Ltd ADR		181.608	0,02		
3.116	Unum Group		159.259	0,02		
8.512	Viatis Inc		90.483	0,01		
3.503	Voya Financial Inc		249.238	0,03		
2.602	Western Digital Corp		197.154	0,02		
190	Wingstop Inc		80.305	0,01		
11.533	Winnebago Industries Inc		625.089	0,07		
1.311	Wynn Resorts Ltd		117.334	0,01		
17.968	Xerox Holdings Corp		208.788	0,02		
Total valores de renta variable *			26.029.523	2,92		
Fondos de inversión inmobiliaria 0,16% (31 de diciembre de 2023: 0,07%)						
Dólar estadounidense						
8.447	Simon Property Group Inc		1.282.255	0,14		
4.600	Tanger Inc		124.706	0,02		
Total fondos de inversión inmobiliaria *			1.406.961	0,16		
Número de Acciones	Descripción de los valores		Fecha de vencimiento	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto	
Certificados de participación 0,02 % (31 de diciembre de 2023: 0,00%)						
Dólar estadounidense						
150	BNP Paribas Issuance BV		08/08/2025	145.624	0,02	
Total certificados de participación **			145.624	0,02		
Importe principal	Descripción de los valores		Cupón	Fecha de vencimiento	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Bonos del Tesoro 45,36% (31 de diciembre de 2023: 43,48%)						
Dólar estadounidense						
15.000.000	United States Treasury Bill	0,00%	11/07/2024	14.978.139	1,68	
110.000.000	United States Treasury Bill	0,00%	18/07/2024	109.727.032	12,29	
75.000.000	United States Treasury Bill	0,00%	01/08/2024	74.661.616	8,36	
75.000.000	United States Treasury Bill	0,00%	13/08/2024	74.530.882	8,35	
130.000.000	United States Treasury Bill	0,00%	20/08/2024	129.053.437	14,46	
2.000.000	United States Treasury Bill	0,00%	22/08/2024	1.984.922	0,22	
Total bonos del Tesoro **				404.936.028	45,36	

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Importe principal	Descripción de los valores	Cupón	Fecha de vencimiento	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Bonos de empresa 7,40% (31 de diciembre de 2023: 7,41%)					
Euro					
500.000	BNP Paribas SA**	0,00%	03/01/2025	726.164	0,08
Total euro				726.164	0,08
Yen japonés					
100.000.000	INFRONEER Holdings Inc*	0,00%	30/03/2029	612.645	0,07
120.000.000	Nippon Steel Corp*	0,00%	05/10/2026	1.031.705	0,11
200.000.000	Taiyo Yuden Co Ltd*	0,00%	18/10/2030	1.401.840	0,16
Total yen japonés				3.046.190	0,34
Dólar estadounidense					
1.500.000	Alamo Re Ltd**	6,00%	07/06/2027	1.473.825	0,16
3.000.000	Alamo Re Ltd**	13,76%	07/06/2026	2.992.875	0,34
2.250.000	Atlas Capital Reinsurance 2022 Designated Activity Co**	15,05%	06/06/2025	2.214.394	0,25
2.250.000	Blue Halo Re Ltd*	15,11%	24/02/2025	2.051.662	0,23
750.000	Blue Ridge Re Ltd**	13,36%	08/01/2027	739.144	0,08
3.000.000	Bonanza RE Ltd**	13,81%	08/01/2026	3.025.125	0,34
1.400.000	Cape Lookout Re Ltd**	13,37%	05/04/2027	1.386.210	0,16
750.000	Cape Lookout Re Ltd**	13,79%	28/04/2026	754.012	0,08
2.400.000	Cape Lookout Re Ltd**	14,96%	28/03/2025	2.337.600	0,26
2.750.000	Gateway Re II Ltd**	14,26%	27/04/2026	2.848.175	0,32
1.500.000	Herbie Re Ltd**	14,66%	08/07/2024	1.497.750	0,17
2.000.000	Herbie Re Ltd**	15,07%	08/01/2025	1.890.400	0,21
1.500.000	Herbie Re Ltd**	23,65%	06/06/2025	1.192.500	0,13
2.000.000	Hestia Re Ltd**	15,43%	22/04/2025	1.932.900	0,22
3.000.000	Hestia Re Ltd**	16,10%	07/04/2026	2.938.275	0,33
3.800.000	Kilimanjaro III Re Ltd**	10,61%	25/06/2025	3.768.840	0,42
1.420.000	Montoya Re Ltd*	12,45%	07/04/2025	1.391.636	0,16
1.500.000	Pelican IV Re Ltd**	5,85%	07/05/2027	26.363	0,00
2.500.000	Purple Re Ltd**	18,16%	24/04/2026	2.554.875	0,29
1.685.000	Residential Reinsurance 2021 Ltd**	9,25%	06/06/2025	1.612.924	0,18
1.425.000	Residential Reinsurance 2021 Ltd**	10,88%	06/06/2025	1.334.370	0,15
1.000.000	Residential Reinsurance 2021 Ltd*	15,30%	06/06/2025	912.750	0,10
3.000.000	Residential Reinsurance 2022 Ltd**	15,72%	06/12/2026	3.017.025	0,34
2.450.000	Sanders Re III Ltd**	11,11%	07/04/2028	2.418.885	0,27
3.000.000	Sanders Re III Ltd*	18,36%	07/04/2026	2.714.625	0,30
3.250.000	Sussex Capital UK Pcc Ltd**	13,71%	08/01/2025	3.118.781	0,35
3.000.000	Tailwind RE Ltd*	14,31%	08/01/2025	2.825.475	0,32
2.000.000	Titania RE Ltd**	17,89%	27/02/2026	2.051.300	0,23
1.000.000	Ursa Re II Ltd**	10,36%	16/06/2025	998.850	0,11

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Importe principal	Descripción de los valores	Cupón	Fecha de vencimiento	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Bonos de empresa 7,40% (31 de diciembre de 2023: 7,41%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
2.000.000	Ursa Re II Ltd**	12,36%	06/12/2025	2.063.850	0,23
2.250.000	Veraison Re Ltd**	10,11%	08/03/2027	2.248.031	0,25
Total dólar estadounidense				62.333.427	6,98
Total bonos de empresa				66.105.781	7,40
Total inversiones				498.623.917	55,86

Contratos de divisas a plazo 2,39% (31 de diciembre de 2023: 5,65%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
760.000 AUD	79.281.102 JPY	18/09/2024	Barclays Bank Plc	14	9.716	0,00
2.160.000 AUD	1.440.770 USD	18/09/2024	Barclays Bank Plc	22	4.714	0,00
1.370.000 AUD	906.253 USD	18/09/2024	BNP Paribas	1	10.559	0,00
9.870.000 AUD	1.013.033.909 JPY	18/09/2024	Citibank NA	19	230.497	0,03
1.380.000 AUD	919.766 USD	18/09/2024	Citibank NA	11	3.737	0,00
1.040.000 AUD	107.813.251 JPY	18/09/2024	JPMorgan Chase Bank	11	17.553	0,00
34.000.000 AUD	3.552.323.792 JPY	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	10	600.846	0,06
33.100.000 AUD	22.045.236 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	8	64.753	0,00
19.807.919 AUD	12.242.187 EUR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	9	105.796	0,01
48.400.000 AUD	52.615.737 NZD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	5	268.672	0,04
36.800.000 AUD	33.391.354 CAD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	4	174.272	0,03
3.815.024 AUD	2.000.000 GBP	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	6	20.021	0,00
230.000 AUD	153.634 USD	18/09/2024	Royal Bank of Canada	1	284	0,00
290.000 AUD	30.040.450 JPY	18/09/2024	Royal Bank of Scotland	4	5.039	0,00
1.080.000 AUD	717.646 USD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	6	5.095	0,00
760.000 AUD	78.370.315 JPY	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	6	15.445	0,00
370.000 AUD	247.095 USD	18/09/2024	UBS AG	3	512	0,00
170.000 AUD	17.567.053 JPY	18/09/2024	UBS AG	3	3.222	0,00
2.803.939 BRL	500.000 USD	02/08/2024	JPMorgan Chase Bank	3	2.928	0,00
19.233.555 BRL	3.459.957 USD	02/07/2024	UBS AG	1	2.772	0,00
400.000 CAD	291.347 USD	18/09/2024	Barclays Bank Plc	3	1.524	0,00
180.000 CAD	131.607 USD	18/09/2024	Citibank NA	4	187	0,00
30.000 CAD	21.920 USD	02/07/2024	Goldman Sachs International	1	4	0,00
22.100.000 CAD	16.091.587 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	4	62.285	0,01
15.715.968 CAD	10.625.000 EUR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	8	95.952	0,00
32.837.413 CAD	3.752.813.899 JPY	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	10	644.119	0,07
700.000 CAD	512.242 USD	18/09/2024	Royal Bank of Canada	3	283	0,00
770.000 CAD	563.762 USD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	3	16	0,00
4.250.000 CHF	4.717.477 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	16.653	0,00
4.234.029 CHF	3.708.333 GBP	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	7	28.413	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo 2,39% (31 de diciembre de 2023: 5,65%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
9.500.000 CHF	1.641.855.473 JPY	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	3	362.965	0,05
9.308.814 CHF	9.625.000 EUR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	4	49.808	0,00
95.087.407 CLP	100.000 USD	01/08/2024	JPMorgan Chase Bank	1	704	0,00
417.263.549 COP	100.000 USD	22/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	297	0,00
418.448.547 COP	100.000 USD	02/08/2024	JPMorgan Chase Bank	1	396	0,00
23.350.000 EUR	3.955.706.199 JPY	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	12	413.561	0,06
125.000 EUR	119.795 CHF	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	577	0,00
875.000 EUR	1.280.644 CAD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	2.048	0,00
15.000.000 EUR	16.045.288 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	36.899	0,01
900.000 EUR	3.866.416 PLN	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	4	3.215	0,00
125.000 EUR	1.400.971 SEK	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.677	0,00
3.200.000 EUR	2.704.561 GBP	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	3	11.869	0,00
800.000 EUR	314.746.284 HUF	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	4	3.833	0,00
50.822 EUR	220.000 PLN	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	1	4	0,00
60.000 EUR	64.506 USD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	1	46	0,00
687.500 GBP	868.806 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	304	0,00
567.504 GBP	638.261 CHF	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	6.449	0,00
14.375.000 GBP	2.865.820.182 JPY	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	10	334.910	0,05
31.414.168 GBP	36.855.000 EUR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	5	198.609	0,03
36.869.280 HUF	100.000 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	24	0,00
46.210.000 INR	552.761 USD	18/09/2024	BNP Paribas	3	234	0,00
647.090.000 INR	7.728.740 USD	18/09/2024	Citibank NA	12	14.997	0,00
55.770.000 INR	666.858 USD	18/09/2024	HSBC Bank Plc	3	543	0,00
8.352.748 INR	100.000 USD	01/08/2024	JPMorgan Chase Bank	1	117	0,00
58.526.836 INR	700.000 USD	22/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	1.764	0,00
8.345.437 INR	100.000 USD	03/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	85	0,00
169.815.104 INR	2.031.976 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	3	5.079	0,00
42.387.858 INR	507.994 USD	08/07/2024	JPMorgan Chase Bank	3	474	0,00
1.135.702.797 INR	13.583.739 USD	05/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	37.767	0,01
6.160.000 INR	73.631 USD	18/09/2024	Royal Bank of Scotland	1	86	0,00
304.670.000 INR	3.641.721 USD	18/09/2024	UBS AG	13	4.272	0,00
1.970.000 JPY	12.386 USD	18/09/2024	Citibank NA	1	10	0,00
14.880.000 KRW	10.815 USD	19/09/2024	BNP Paribas	1	30	0,00
834.938.094 KRW	600.000 USD	18/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	6.299	0,00
416.597.390 KRW	300.000 USD	12/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	2.415	0,00
827.796.512 KRW	600.000 USD	02/08/2024	JPMorgan Chase Bank	8	1.621	0,00
138.859.384 KRW	100.000 USD	15/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	817	0,00
137.807.373 KRW	100.000 USD	22/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	93	0,00
138.951.384 KRW	100.000 USD	25/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	941	0,00
139.039.384 KRW	100.000 USD	01/08/2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.044	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo 2,39% (31 de diciembre de 2023: 5,65%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
138.885.060 KRW	100.000 USD	11/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	813	0,00
13.851.302.485 KRW	10.000.000 USD	03/07/2024	JPMorgan Chase Bank	3	61.339	0,01
4.016.148.949 KRW	2.900.000 USD	05/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	16.472	0,00
138.893.012 KRW	100.000 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	813	0,00
553.935.237 KRW	400.000 USD	29/07/2024	JPMorgan Chase Bank	5	2.494	0,00
25.310.000 KRW	18.348 USD	19/09/2024	Royal Bank of Scotland	1	97	0,00
3.810.000 MXN	202.304 USD	18/09/2024	Deutsche Bank AG	1	3.495	0,00
41.000.000 MXN	2.176.265 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	4	63.250	0,01
66.966.240 MXN	3.574.860 USD	18/09/2024	Royal Bank of Canada	1	42.341	0,01
880.000 NOK	82.692 USD	18/09/2024	Citibank NA	2	120	0,00
33.043.952 NOK	2.875.000 EUR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	3	21.682	0,00
31.000.000 NOK	30.578.712 SEK	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	6	23.509	0,00
20.293.569 NOK	1.900.000 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	4	6.349	0,00
2.710.000 NOK	254.303 USD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	3	719	0,00
3.410.000 NOK	318.764 USD	18/09/2024	UBS AG	1	2.132	0,00
19.800.000 NZD	1.894.518.062 JPY	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	9	273.281	0,03
640.000 PHP	10.850 USD	18/09/2024	UBS AG	1	93	0,00
3.040.000 PLN	699.704 EUR	18/09/2024	Barclays Bank Plc	4	2.697	0,00
3.800.000 PLN	937.305 USD	18/09/2024	BNP Paribas	3	7.051	0,00
2.020.000 PLN	466.343 EUR	18/09/2024	Deutsche Bank AG	1	278	0,00
650.000 PLN	161.481 USD	18/09/2024	Deutsche Bank AG	1	54	0,00
230.000 PLN	57.119 USD	18/09/2024	HSBC Bank Plc	1	40	0,00
1.726.122 PLN	400.000 EUR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	3	492	0,00
5.790.000 PLN	1.326.061 EUR	18/09/2024	JPMorgan Chase Bank	1	12.237	0,00
1.211.259 PLN	300.000 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	1.284	0,00
600.000 PLN	148.635 USD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	3	474	0,00
1.420.000 PLN	326.609 EUR	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	2	1.504	0,00
200.000 PLN	49.570 USD	18/09/2024	UBS AG	1	134	0,00
64.848.030 RON	12.966.001 EUR	18/09/2024	UBS AG	1	1.551	0,01
2.848.396 SEK	250.000 EUR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	1.034	0,00
103.649.291 SEK	103.000.000 NOK	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	115.446	0,01
1.065.164 SEK	100.000 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	620	0,00
79.690.159 TRY	2.070.000 EUR	18/09/2024	Barclays Bank Plc	2	5.027	0,01
16.156.831 TRY	420.000 EUR	18/09/2024	BNP Paribas	4	678	0,00
6.592.846 TRY	170.000 EUR	18/09/2024	Citibank NA	2	1.764	0,00
5.100.000 TRY	142.783 USD	18/09/2024	Citibank NA	1	65	0,00
10.771.964 TRY	280.000 EUR	18/09/2024	Deutsche Bank AG	3	473	0,00
108.500.000 TRY	3.100.000 USD	26/08/2024	Goldman Sachs International	1	15.985	0,00
119.103.930 TRY	3.325.407 USD	18/09/2024	JPMorgan Chase Bank	1	10.621	0,00
189.997.272 TRY	5.700.000 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	8	45.615	0,00
119.173.844 TRY	3.630.000 USD	01/07/2024	UBS AG	1	5.178	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo 2,39% (31 de diciembre de 2023: 5,65%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
18.884.474 TRY	490.000 EUR	18/09/2024	UBS AG	4	1.768	0,00
6.493.025 TWD	200.000 USD	02/08/2024	JPMorgan Chase Bank	2	198	0,00
2.263.995 USD	2.100.000 EUR	18/09/2024	Barclays Bank Plc	27	4.676	0,00
705.307 USD	16.280.000 CZK	18/09/2024	Barclays Bank Plc	3	7.421	0,00
1.193.297 USD	439.860.000 HUF	18/09/2024	Barclays Bank Plc	2	2.888	0,00
315.830 USD	1.730.000 BRL	18/09/2024	Barclays Bank Plc	9	7.082	0,00
29.305 USD	40.000 CAD	18/09/2024	Barclays Bank Plc	1	18	0,00
225.147 USD	200.000 CHF	18/09/2024	Barclays Bank Plc	2	429	0,00
61.350 USD	100.000 NZD	18/09/2024	Barclays Bank Plc	1	416	0,00
759.585 USD	118.630.000 JPY	18/09/2024	Barclays Bank Plc	19	13.101	0,00
102.051 USD	95.900.000 CLP	23/09/2024	Barclays Bank Plc	2	516	0,00
1.374.054 USD	1.080.000 GBP	18/09/2024	Barclays Bank Plc	11	8.028	0,00
27.718 USD	37.880.000 KRW	19/09/2024	Barclays Bank Plc	1	112	0,00
1.960.886 USD	7.260.000 ILS	18/09/2024	BNP Paribas	5	26.878	0,00
442.692 USD	410.000 EUR	18/09/2024	BNP Paribas	4	1.585	0,00
154.589 USD	1.630.000 SEK	18/09/2024	BNP Paribas	1	43	0,00
1.508.801 USD	34.940.000 CZK	18/09/2024	BNP Paribas	13	11.005	0,00
7.041.499 USD	1.090.990.000 JPY	18/09/2024	BNP Paribas	5	176.391	0,02
82.596 USD	1.520.000 MXN	18/09/2024	BNP Paribas	2	493	0,00
798.708 USD	630.000 GBP	18/09/2024	BNP Paribas	2	1.860	0,00
1.655.666 USD	258.690.000 JPY	18/09/2024	Citibank NA	42	27.848	0,00
82.119 USD	870.000 NOK	18/09/2024	Citibank NA	1	248	0,00
460.274 USD	750.000 NZD	18/09/2024	Citibank NA	7	3.272	0,00
1.465.213 USD	33.820.000 CZK	18/09/2024	Citibank NA	14	15.429	0,00
62.740 USD	23.110.000 HUF	18/09/2024	Citibank NA	1	197	0,00
51.259 USD	70.000 CAD	18/09/2024	Citibank NA	2	7	0,00
6.319.203 USD	4.970.000 GBP	18/09/2024	Citibank NA	39	32.945	0,00
92.606 USD	1.710.000 MXN	18/09/2024	Citibank NA	2	240	0,00
553.990 USD	490.000 CHF	18/09/2024	Citibank NA	8	3.432	0,00
43.197 USD	160.000 ILS	18/09/2024	Citibank NA	1	575	0,00
23.349 USD	21.690.000 CLP	23/09/2024	Citibank NA	1	385	0,00
432.293 USD	400.000 EUR	18/09/2024	Citibank NA	4	1.945	0,00
4.073.365 USD	5.490.000 SGD	18/09/2024	Citibank NA	15	7.210	0,00
363.223 USD	3.810.000 SEK	18/09/2024	Citibank NA	2	1.982	0,00
281.270 USD	385.730.000 KRW	19/09/2024	Citibank NA	2	161	0,00
58.319 USD	610.000 SEK	18/09/2024	Deutsche Bank AG	1	483	0,00
462.375 USD	1.720.000 ILS	18/09/2024	Deutsche Bank AG	7	4.180	0,00
90.026 USD	1.650.000 ZAR	18/09/2024	Deutsche Bank AG	1	207	0,00
460.401 USD	620.000 SGD	18/09/2024	Deutsche Bank AG	3	1.199	0,00
83.186 USD	3.030.000 THB	18/09/2024	Deutsche Bank AG	1	84	0,00
56.248 USD	8.760.000 JPY	18/09/2024	Deutsche Bank AG	2	1.125	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo 2,39% (31 de diciembre de 2023: 5,65%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
123.822 USD	110.000 CHF	18/09/2024	Deutsche Bank AG	1	227	0,00
1.008.064 USD	5.520.000 BRL	18/09/2024	Deutsche Bank AG	20	22.929	0,00
11.429 USD	210.000 MXN	18/09/2024	Deutsche Bank AG	1	86	0,00
107.706 USD	100.000 EUR	18/09/2024	Deutsche Bank AG	3	120	0,00
824.561 USD	650.000 GBP	18/09/2024	Deutsche Bank AG	5	2.415	0,00
1.723.867 USD	1.360.000 GBP	18/09/2024	Goldman Sachs International	10	3.684	0,00
26.289.244 USD	24.100.000 EUR	30/09/2024	Goldman Sachs International	6	346.309	0,05
84.392 USD	1.560.000 MXN	18/09/2024	Goldman Sachs International	3	128	0,00
9.350.207 USD	1.460.000.000 JPY	05/07/2024	Goldman Sachs International	4	269.857	0,03
5.099.436 USD	4.000.000 GBP	30/09/2024	Goldman Sachs International	2	39.636	0,01
19.250.000 USD	138.703.950 CNY	19/09/2024	Goldman Sachs International	1	133.445	0,02
3.379.105 USD	18.240.000 BRL	18/09/2024	Goldman Sachs International	3	123.874	0,02
146.216 USD	3.390.000 CZK	18/09/2024	Goldman Sachs International	2	895	0,00
156.942 USD	24.440.000 JPY	18/09/2024	Goldman Sachs International	4	3.152	0,00
50.690 USD	40.000 GBP	18/09/2024	HSBC Bank Plc	1	97	0,00
600.000 USD	2.465.275.284 COP	08/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	5.959	0,00
78.255.800 USD	568.439.814 CNY	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	7	339.141	0,04
100.000 USD	137.411.626 KRW	15/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	234	0,00
100.000 USD	137.138.062 KRW	17/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	421	0,00
3.944.563 USD	5.900.000 AUD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	3.508	0,00
48.939 USD	80.000 NZD	18/09/2024	JPMorgan Chase Bank	1	192	0,00
600.000 USD	825.396.569 KRW	18/07/2024	JPMorgan Chase Bank	5	630	0,00
300.000 USD	412.855.191 KRW	12/07/2024	JPMorgan Chase Bank	3	301	0,00
100.000 USD	395.898.445 COP	12/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	4.675	0,00
2.269 USD	9.071.197 COP	15/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	86	0,00
8.500.000 USD	89.720.602 NOK	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	6	71.778	0,01
400.000 USD	376.934.162 CLP	02/08/2024	JPMorgan Chase Bank	2	803	0,00
300.000 USD	9.708.644 TWD	08/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	837	0,00
100.000 USD	136.316.961 KRW	11/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.051	0,00
100.000 USD	395.257 PLN	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.685	0,00
100.000 USD	94.219.000 CLP	25/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	209	0,00
300.000 USD	280.776.000 CLP	24/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	2.617	0,00
29.712.618 USD	40.600.000 CAD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	4	36.272	0,00
20.902.158 USD	16.463.069 GBP	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	11	90.202	0,00
100.000 USD	92.559.000 CLP	08/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.951	0,00
16.417.999 USD	14.625.000 CHF	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	10	127.018	0,01
300.000 USD	274.701.285 CLP	05/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	8.993	0,00
100.000 USD	91.671.124 CLP	03/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	2.885	0,00
56.240 USD	50.000 CHF	18/09/2024	JPMorgan Chase Bank	1	61	0,00
5.482.202 USD	39.624.899 CNY	19/09/2024	JPMorgan Chase Bank	1	20.991	0,00
100.000 USD	137.339.626 KRW	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	314	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo 2,39% (31 de diciembre de 2023: 5,65%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
535.922 USD	2.000.000 ILS	18/09/2024	JPMorgan Chase Bank	8	3.137	0,00
10.800.000 USD	14.849.356.104 KRW	03/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	13.692	0,00
13.300.000 USD	70.926.043 BRL	02/07/2024	JPMorgan Chase Bank	99	530.769	0,06
10.783 USD	10.000 EUR	18/09/2024	JPMorgan Chase Bank	1	24	0,00
111.170.462 USD	103.007.813 EUR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	8	731.071	0,09
100.000 USD	416.295.449 COP	26/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	4	0,00
100.000 USD	91.594.594 CLP	15/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	2.980	0,00
100.000 USD	414.762.445 COP	22/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	304	0,00
11.548.886 USD	205.000.000 MXN	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	4	351.309	0,04
100.000 USD	91.853.001 CLP	12/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	2.703	0,00
6.900.000 USD	223.148.600 TWD	05/07/2024	JPMorgan Chase Bank	4	22.689	0,00
200.000 USD	6.488.085 TWD	03/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	19	0,00
3.800.000 USD	14.119.582 ILS	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	4	50.895	0,01
93.932 USD	1.720.000 ZAR	18/09/2024	JPMorgan Chase Bank	1	303	0,00
2.500.000 USD	905.799.661 HUF	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	7	42.630	0,01
47.395.859 USD	7.444.602.109 JPY	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	11	1.059.285	0,13
3.100.000 USD	4.241.734.963 KRW	05/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	19.711	0,00
10.399 USD	190.000 MXN	18/09/2024	JPMorgan Chase Bank	1	136	0,00
8.063.401 USD	13.187.240 NZD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	10	27.769	0,00
6.800.000 USD	9.191.381 SGD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	4	15.321	0,00
17.902.274 USD	2.876.715.875 JPY	01/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	18.923	0,00
200.000 USD	2.084.136 SEK	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	3.124	0,00
5.400.000 USD	174.595.343 TWD	24/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	18.141	0,00
200.000 USD	4.544.048 CZK	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	5.522	0,00
200.000 USD	6.481.234 TWD	29/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	191	0,00
4.300.000 USD	23.757.414 BRL	02/08/2024	JPMorgan Chase Bank	1	38.754	0,01
100.000 USD	1.812.132 ZAR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	818	0,00
635.835 USD	500.000 GBP	10/09/2024	Nomura	1	3.452	0,00
12.412.295 USD	11.500.000 EUR	10/09/2024	Nomura	1	44.456	0,01
6.943.300 USD	9.350.000 SGD	18/09/2024	Royal Bank of Canada	3	18.240	0,00
4.587.887 USD	6.287.500.000 KRW	19/09/2024	Royal Bank of Canada	3	5.741	0,00
45.563.087 USD	329.276.922 CNY	19/09/2024	Royal Bank of Canada	2	181.247	0,02
64.106 USD	350.000 BRL	18/09/2024	Royal Bank of Canada	2	1.643	0,00
15.167.143 USD	118.116.419 HKD	19/09/2024	Royal Bank of Canada	1	4.560	0,00
24.457 USD	40.000 NZD	18/09/2024	Royal Bank of Scotland	1	84	0,00
1.007.517 USD	1.360.000 SGD	18/09/2024	Royal Bank of Scotland	3	235	0,00
835.525 USD	19.420.000 CZK	18/09/2024	Royal Bank of Scotland	9	3.035	0,00
258.039 USD	40.170.000 JPY	18/09/2024	Royal Bank of Scotland	6	5.267	0,00
326.307 USD	290.000 CHF	18/09/2024	Royal Bank of Scotland	3	467	0,00
2.148.760 USD	1.990.000 EUR	18/09/2024	Royal Bank of Scotland	3	7.785	0,00
22.006 USD	30.000 CAD	18/09/2024	Société Générale	1	40	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo 2,39% (31 de diciembre de 2023: 5,65%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
812.446 USD	720.000 CHF	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	12	3.461	0,00
710.536 USD	560.000 GBP	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	8	2.226	0,00
116.262 USD	190.000 NZD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	2	489	0,00
805.942 USD	126.440.000 JPY	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	27	10.307	0,00
139.011 USD	1.460.000 SEK	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	1	583	0,00
23.397 USD	21.790.000 CLP	23/09/2024	State Street Bank and Trust Co	1	327	0,00
690.633 USD	640.000 EUR	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	9	2.079	0,00
72.006 USD	390.000 BRL	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	3	2.404	0,00
4.091.260 USD	3.630.000 CHF	18/09/2024	UBS AG	8	12.632	0,00
56.661 USD	53.400.000 CLP	23/09/2024	UBS AG	2	123	0,00
29.218 USD	160.000 BRL	18/09/2024	UBS AG	1	663	0,00
559.196 USD	206.470.000 HUF	18/09/2024	UBS AG	2	419	0,00
3.630.000 USD	19.233.555 BRL	02/07/2024	UBS AG	1	167.271	0,02
425.144 USD	1.580.000 ILS	18/09/2024	UBS AG	7	4.244	0,00
164.946 USD	130.000 GBP	18/09/2024	UBS AG	2	517	0,00
321.855 USD	441.260.000 KRW	19/09/2024	UBS AG	2	277	0,00
722.713 USD	670.000 EUR	18/09/2024	UBS AG	8	1.882	0,00
538.923 USD	12.400.000 CZK	18/09/2024	UBS AG	3	7.364	0,00
1.320.000 ZAR	71.326 USD	18/09/2024	BNP Paribas	1	529	0,00
620.000 ZAR	33.139 USD	18/09/2024	Citibank NA	1	611	0,00
360.000 ZAR	19.510 USD	18/09/2024	Deutsche Bank AG	1	87	0,00
1.420.000 ZAR	76.815 USD	18/09/2024	Goldman Sachs International	1	483	0,00
64.707.921 ZAR	3.500.000 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	6	41.609	0,00
1.380.000 ZAR	74.841 USD	18/09/2024	Royal Bank of Canada	2	281	0,00
4.930.000 ZAR	263.236 USD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	1	5.132	0,00
<i>Clases CHF con cobertura</i>						
2.811.012 CHF	3.109.864 USD	18/07/2024	State Street Bank and Trust Co	1	24.505	0,00
2.815.728 CHF	3.117.495 USD	18/07/2024	UBS AG	2	22.133	0,00
17.315 CHF	19.115 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	4	191	0,00
20.502 USD	18.242 CHF	18/07/2024	UBS AG	3	161	0,00
75.684 USD	66.814 CHF	18/07/2024	Westpac Banking Corp	2	1.185	0,00
<i>Clases EUR con cobertura</i>						
41.710.378 EUR	44.619.155 USD	18/07/2024	UBS AG	2	118.101	0,01
151.875 EUR	162.451 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	8	444	0,00
88.224 USD	81.913 EUR	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	367	0,00
333.538 USD	309.633 EUR	18/07/2024	UBS AG	2	1.435	0,00
3.166.720 USD	2.920.204 EUR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	43	34.598	0,00
<i>Clases GBP con cobertura</i>						
4.412.176 GBP	5.514.461 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	63.511	0,01
667.533.347 GBP	834.142.082 USD	18/07/2024	State Street Bank and Trust Co	5	9.768.598	1,09
4.241.185 GBP	5.303.816 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	15	57.984	0,01

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo 2,39% (31 de diciembre de 2023: 5,65%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases GBP con cobertura (cont.)</i>						
4.018.293 USD	3.155.902 GBP	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	28.531	0,00
4.816.759 USD	3.799.090 GBP	18/07/2024	State Street Bank and Trust Co	1	13.864	0,00
9.568.047 USD	7.493.318 GBP	18/07/2024	UBS AG	2	94.826	0,01
166.750.820 USD	131.171.611 GBP	18/07/2024	Westpac Banking Corp	39	920.712	0,10
<i>Clases JPY con cobertura</i>						
490.407 USD	76.904.023 JPY	18/07/2024	UBS AG	3	11.134	0,00
391.794 USD	59.531.831 JPY	18/07/2024	Westpac Banking Corp	2	20.787	0,00
<i>Clases SGD con cobertura</i>						
10.914 SGD	8.057 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	4	2	0,00
28 USD	38 SGD	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	0	0,00
40 USD	53 SGD	18/07/2024	UBS AG	2	0	0,00
5.266 USD	7.090 SGD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	6	30	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					21.375.358	2,39

Contratos de futuros 0,83% (31 de diciembre de 2023: 1,13%)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(1)	3 Month CORRA Future December 2024	82	0,00
165	3 Month CORRA Future September 2025	11.026	0,00
(138)	3 Month SOFR Future December 2024	47.663	0,01
121	3 Month SOFR Future June 2025	1.258	0,00
(1.034)	3 Month SOFR Future March 2025	751.419	0,08
715	3 Month SONIA Future December 2024	92.076	0,01
(6)	3 Month SONIA Future June 2025	344	0,00
(721)	30 Day Federal Funds Future August 2024	31.273	0,00
(278)	3-Month Euro EURIBOR Future December 2024	394.066	0,04
152	3-Month Euro EURIBOR Future December 2025	12.171	0,00
154	3-Month Euro EURIBOR Future July 2024	6.391	0,00
208	3-Month Euro EURIBOR Future June 2025	18.477	0,00
223	3-Month Euro EURIBOR Future March 2025	18.372	0,00
152	3-Month Euro EURIBOR Future March 2026	9.165	0,00
(174)	3-Month Euro EURIBOR Future September 2024	290.085	0,03
152	3-Month Euro EURIBOR Future September 2025	15.051	0,00
(1.600)	3-Month Euro EURIBOR Put Option on Future December 2024, Strike Price EUR 96.50	71.819	0,01
(1.600)	3-Month Euro EURIBOR Put Option on Future September 2024, Strike Price EUR 96.38	94.234	0,01
(143)	90-Day Bank Bill Future December 2024	21.198	0,00
(39)	90-Day Bank Bill Future June 2025	243	0,00
(136)	90-Day Bank Bill Future March 2025	22.570	0,00
(368)	Australian Government Bond 10-Year Future September 2024	41.166	0,01

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de futuros 0,83% (31 de diciembre de 2023: 1,13%) (cont.)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(604)	Australian Government Bond 3-Year Future September 2024	215.801	0,02
(162)	British Pound Currency Future September 2024	66.401	0,01
36	Canadian Dollar Currency Future September 2024	2.428	0,00
(43)	CBOE VIX Index Future August 2024	5.651	0,00
(2)	CBOE VIX Index Future October 2024	445	0,00
16	Chinese Yuan Renminbi Currency Future September 2024	3.253	0,00
67	DAX Index Future September 2024	110.230	0,01
(32)	DJIA Mini E-CBOT Future September 2024	22.209	0,00
61	Dollar Index Future September 2024	58.790	0,01
1	E-mini Consumer Discretionary Future September 2024	700	0,00
(1)	E-mini Euro Future September 2024	250	0,00
1	E-mini Health Care Future September 2024	60	0,00
7	E-mini Industrial Future September 2024	2.918	0,00
3	E-mini Russell 2000 Index Future September 2024	181	0,00
(14)	Euro Currency Future September 2024	494	0,00
(890)	Euro FX Currency Future September 2024	455.182	0,05
(112)	Euro STOXX Bank Index Future September 2024	2.086	0,00
7	Euro/Japanese Yen Currency Future September 2024	11.338	0,00
39	Euro-BTP Future July 2024	3.386	0,00
(186)	Euro-BTP Future September 2024	171.360	0,02
(20)	Euro-BTP Call Option on Future August 2024, Strike Price EUR 120.50	2.396	0,00
(80)	Euro-BTP Put Option on Future August 2024, Strike Price EUR 111.00	7.694	0,00
(299)	Euro-Bund Future September 2024	273.601	0,03
(150)	Euro-Bund Weekly Call Option on Future July 2024, Strike Price EUR 133.50	16.467	0,00
(150)	Euro-Bund Weekly Call Option on Future July 2024, Strike Price EUR 134.00	18.331	0,00
100	Euro-Bund Weekly Put Option on Future July 2024, Strike Price EUR 131.50	22.811	0,00
160	Euro-Bund Weekly Put Option on Future July 2024, Strike Price EUR 132.00	60.398	0,01
(28)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2024	48.700	0,01
(196)	Euro-OAT Future September 2024	169.808	0,02
185	Euro-Schatz Future September 2024	23.407	0,00
161	FSC Nifty 50 Index Future July 2024	104.895	0,01
(1)	FTSE 100 Index Future September 2024	1.611	0,00
(190)	FTSE China A50 Index Future July 2024	8.717	0,00
(22)	FTSE/JSE Top 40 Index Future September 2024	6.002	0,00
(32)	Hang Seng China Enterprises Index Future July 2024	70	0,00
9	Hang Seng Index Call Option on Future July 2024, Strike Price HKD 18,000.00	604	0,00
1	Indian Rupee Currency Future July 2024	16	0,00
(112)	Japan Government 10-Year Bond (OSE) Future September 2024	73.107	0,01
(184)	Japanese Yen Currency Future September 2024	271.305	0,03
3	JPX-Nikkei Index 400 Futures September 2024	979	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de futuros 0,83% (31 de diciembre de 2023: 1,13%) (cont.)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
70	Mexican Peso Currency Future September 2024	42.905	0,01
91	Mini- TOPIX Index Future September 2024	30.239	0,00
(4)	MSCI China A 50 Index Future July 2024	3.160	0,00
49	MSCI EAFE Index Future September 2024	37.390	0,00
(3)	MSCI Emerging Markets Index Future September 2024	450	0,00
182	MSCI Singapore Index Future July 2024	40.429	0,01
(48)	Nasdaq 100 E-mini Future September 2024	106.786	0,01
(151)	New Zealand Dollar Currency Future September 2024	18.217	0,00
16	Nikkei 225 (CME) Future September 2024	58.875	0,01
22	Nikkei 225 (OSE) Future September 2024	64.963	0,01
86	Nikkei 225 (SGX) Future September 2024	245.651	0,03
269	Nikkei 225 Mini Future September 2024	62.983	0,01
8	Norwegian Krone Currency Future September 2024	827	0,00
3	NYSE FANG+ Index Future September 2024	3.364	0,00
256	OMXS30 Index Future July 2024	6.703	0,00
(274)	S&P 500 E-mini Future September 2024	1.251.019	0,14
4	S&P Real Estate Sector E-mini Future September 2024	925	0,00
32	S&P/TSX 60 Index Future September 2024	46.150	0,01
123	SGX FTSE Taiwan Future July 2024	70.991	0,01
42	SK Hynix Inc December 2049	4.432	0,00
(52)	Société Générale SSDF December 2024	5.016	0,00
28	South African Rand Currency (CME) Future September 2024	11.375	0,00
(140)	SPI 200 Index Future September 2024	138.028	0,02
4	Swedish Krona Currency Future September 2024	5.360	0,00
(287)	Swiss Franc Currency Future September 2024	130.128	0,02
(46)	Swiss Market Index Future September 2024	38.905	0,00
90	TOPIX Index Future September 2024	264.516	0,03
(98)	Turkish Lira Currency Future August 2024	990	0,00
(64)	United Kingdom Long Gilt Future September 2024	54.299	0,01
21	United States Dollar/Chinese Yuan Renminbi Currency Future September 2024	5.908	0,00
(66)	US Treasury 10-Year Ultra Future September 2024	34.344	0,00
(607)	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2024	153.022	0,02
(133)	US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2024	131.391	0,02
(47)	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2024	101.875	0,01
(4)	VSTOXX Future July 2024	12.949	0,00
30	Yen Denominated Nikkei Future September 2024	70.889	0,01
Plusvalía latente total sobre contratos de futuros [±]		7.449.685	0,83

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones comprados 18,41% (31 de diciembre de 2023: 17,42%)

Número de contratos/ Importe notional	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de compra				
200	12/07/2024	3 Month SOFR Call Option on Future, Strike Price \$96.50 ±	1.250	0,00
400	12/07/2024	3 Month SOFR Call Option on Future, Strike Price \$96.88 ±	2.500	0,00
100	13/12/2024	3 Month SONIA Call Option on Future, Strike Price GBP95.80 ±	10.271	0,00
1.500	13/12/2024	3 Month SONIA Call Option on Future, Strike Price GBP96.00 ±	94.808	0,01
300	16/08/2024	3 Month SONIA Call Option on Future, Strike Price GBP96.05 ±	0	0,00
13	17/01/2025	AbbVie Inc, Strike Price \$180.00 ±	10.172	0,00
11	17/01/2025	AbbVie Inc, Strike Price \$195.00 ±	4.070	0,00
5.000.000 USD	20/12/2024	Absolute Dispersion Basket, Strike Price 28.00% ∞	77.120	0,01
1.000.000 EUR	20/12/2024	Absolute Dispersion Basket, Strike Price 32.00% ∞	20.026	0,00
20.806	09/09/2024	Advanced Energy Industries Inc, Strike Price \$111.45 ∞	126.121	0,02
130.036	14/03/2029	Advanced Energy Industries Inc, Strike Price \$179.76 ∞	2.762.772	0,31
53.892	15/08/2025	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$104.07 ∞	477.853	0,05
33.950	21/08/2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$109.08 ∞	20.781	0,00
125.000	15/08/2025	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$150.00 ∞	193.671	0,02
121.230	21/06/2029	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$180.44 ∞	1.399.895	0,16
900.000.000 JPY	05/09/2024	Anair, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 52bps. ∞	5.639	0,00
170.000.000 JPY	20/08/2024	Anair, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 55bps. ∞	855	0,00
30	17/01/2025	Apple Inc, Strike Price \$190.00 ±	92.025	0,01
26	17/01/2025	Apple Inc, Strike Price \$205.00 ±	55.380	0,01
208	19/07/2024	Apple Inc, Strike Price \$210.00 ±	107.640	0,01
15	17/01/2025	ArcBest Corp, Strike Price \$130.00 ±	9.000	0,00
13	17/01/2025	ArcBest Corp, Strike Price \$140.00 ±	5.070	0,00
18.650.000 AUD	09/07/2024	Australian Dollar/United States Dollar Currency Option, Strike Price \$0.68 ∞	7.311	0,00
7	17/01/2025	Autodesk Inc, Strike Price \$280.00 ±	8.470	0,00
6	17/01/2025	Autodesk Inc, Strike Price \$310.00 ±	4.440	0,00
7	17/01/2025	Axon Enterprise Inc, Strike Price \$280.00 ±	30.030	0,00
6	17/01/2025	Axon Enterprise Inc, Strike Price \$300.00 ±	19.020	0,00
62	17/01/2025	Best Buy Co Inc, Strike Price \$82.50 ±	53.010	0,01
52	17/01/2025	Best Buy Co Inc, Strike Price \$90.00 ±	27.690	0,00
12	19/07/2024	Boeing Co, Strike Price \$185.00 ±	4.680	0,00
77	17/01/2025	Boston Scientific Corp, Strike Price \$75.00 ±	56.595	0,01
67	17/01/2025	Boston Scientific Corp, Strike Price \$80.00 ±	29.815	0,00
62	19/07/2024	Boyd Gaming Corp, Strike Price \$55.00 ±	8.060	0,00
67	20/12/2024	Boyd Gaming Corp, Strike Price \$70.00 ±	4.690	0,00
88	17/01/2025	Boyd Gaming Corp, Strike Price \$70.00 ±	7.480	0,00
58	20/12/2024	Boyd Gaming Corp, Strike Price \$75.00 ±	1.885	0,00
23	23	Boyd Gaming Corp, Strike Price \$75.00 ±	977	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones comprados 18,41% (31 de diciembre de 2023: 17,42%) (cont.)

Número de contratos/ Importe nominal	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de compra (cont.)				
47	17/01/2025	Boyd Gaming Corp, Strike Price \$80.00 ±	1.527	0,00
41	20/12/2024	Brink's Co, Strike Price \$105.00 ±	30.955	0,00
51	20/12/2024	Brink's Co, Strike Price \$95.00 ±	68.085	0,01
49	17/01/2025	Bunge Global SA, Strike Price \$115.00 ±	25.235	0,00
41	17/01/2025	Bunge Global SA, Strike Price \$125.00 ±	10.455	0,00
38	17/01/2025	Callon Petroleum Co, Strike Price \$38.00 ±	3.895	0,00
33	17/01/2025	Callon Petroleum Co, Strike Price \$40.00 ±	2.178	0,00
18	17/01/2025	Cardinal Health Inc, Strike Price \$115.00 ±	3.600	0,00
15	17/01/2025	Cardinal Health Inc, Strike Price \$125.00 ±	2.775	0,00
43	17/01/2025	CarMax Inc, Strike Price \$90.00 ±	11.932	0,00
37	17/01/2025	CarMax Inc, Strike Price \$97.50 ±	7.215	0,00
60	17/01/2025	Charles Schwab Corp, Strike Price \$65.00 ±	73.200	0,01
78	17/01/2025	Charles Schwab Corp, Strike Price \$70.00 ±	70.785	0,01
21	17/01/2025	Charles Schwab Corp, Strike Price \$77.50 ±	10.290	0,00
5	19/07/2024	Charles Schwab Corp, Strike Price \$78.00 ±	350	0,00
400	26/07/2024	Charles Schwab Corp, Strike Price \$78.00 ±	33.800	0,00
40	19/07/2024	Charles Schwab Corp, Strike Price \$95.00 ±	220	0,00
106	17/01/2025	Chemours Co, Strike Price \$35.00 ±	3.710	0,00
95	17/01/2025	Chemours Co, Strike Price \$37.00 ±	2.375	0,00
150	17/01/2025	Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$50.00 ±	246.750	0,03
100	17/01/2025	Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$54.00 ±	125.000	0,02
7	20/12/2024	Cintas Corp, Strike Price \$730.00 ±	23.450	0,00
6	20/12/2024	Cintas Corp, Strike Price \$800.00 ±	7.140	0,00
71	17/01/2025	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$22.00 ±	2.698	0,00
55	17/01/2025	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$25.00 ±	1.017	0,00
76	20/12/2024	Commercial Metals Co, Strike Price \$60.00 ±	17.860	0,00
65	20/12/2024	Commercial Metals Co, Strike Price \$65.00 ±	7.150	0,00
117.000	20/11/2026	Confluent Inc, Strike Price \$138.02 ∞	41.760	0,01
117.000	18/12/2026	Confluent Inc, Strike Price \$138.02 ∞	48.823	0,01
116.000	15/01/2027	Confluent Inc, Strike Price \$138.02 ∞	57.321	0,01
500	17/01/2025	Confluent Inc, Strike Price \$45.00 ±	58.750	0,01
11.700	20/11/2026	Confluent Inc, Strike Price \$76.14 ∞	29.907	0,00
11.700	18/12/2026	Confluent Inc, Strike Price \$76.28 ∞	31.829	0,00
11.600	15/01/2027	Confluent Inc, Strike Price \$76.41 ∞	33.389	0,00
60.469	15/01/2027	Conmed Corp, Strike Price \$110.88 ∞	368.605	0,04
10.078	19/01/2027	Conmed Corp, Strike Price \$110.88 ∞	61.792	0,01
210.000	15/01/2027	Conmed Corp, Strike Price \$249.05 ∞	106.930	0,01
38	17/01/2025	ConocoPhillips, Strike Price \$145.00 ±	3.952	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones comprados 18,41% (31 de diciembre de 2023: 17,42%) (cont.)

Número de contratos/ Importe nominal	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de compra (cont.)				
34	17/01/2025	ConocoPhillips, Strike Price \$155.00 ±	1.734	0,00
20	17/01/2025	Constellation Brands Inc, Strike Price \$280.00 ±	18.600	0,00
17	17/01/2025	Constellation Brands Inc, Strike Price \$310.00 ±	5.610	0,00
160	17/01/2025	Corning Inc, Strike Price \$35.00 ±	86.400	0,01
144	17/01/2025	Corning Inc, Strike Price \$37.00 ±	59.040	0,01
62	17/01/2025	Coterra Energy Inc, Strike Price \$27.00 ±	12.245	0,00
50	17/01/2025	Coterra Energy Inc, Strike Price \$30.00 ±	4.375	0,00
30	20/12/2024	Crocs Inc, Strike Price \$135.00 ±	75.900	0,01
24	20/12/2024	Crocs Inc, Strike Price \$150.00 ±	40.440	0,01
162	17/01/2025	CSX Corp, Strike Price \$37.50 ±	13.770	0,00
126	17/01/2025	CSX Corp, Strike Price \$42.50 ±	1.575	0,00
130.000.000 JPY	16/11/2029	Cybag, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 170bps. ∞	60.341	0,01
300.000.000 JPY	14/09/2028	Daifuku Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 80bps. ∞	269.231	0,03
40.000.000 JPY	13/09/2030	Daifuku Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 75bps. ∞	54.891	0,01
35	17/01/2025	Darden Restaurants Inc, Strike Price \$170.00 ±	10.938	0,00
29	17/01/2025	Darden Restaurants Inc, Strike Price \$185.00 ±	2.900	0,00
120.000	20/12/2024	DB Energy SA, Strike Price EUR9.75 ∞	9.079	0,00
2.173.493	21/03/2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR21.13 ∞	7.816.568	0,88
2.173.493	21/03/2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR21.97 ∞	6.198.620	0,70
33	17/01/2025	Devon Energy Corp, Strike Price \$47.50 ±	10.807	0,00
27	17/01/2025	Devon Energy Corp, Strike Price \$52.50 ±	5.332	0,00
91	17/01/2025	Devon Energy Corp, Strike Price \$57.50 ±	8.600	0,00
77	17/01/2025	Devon Energy Corp, Strike Price \$62.50 ±	4.004	0,00
24	17/01/2025	Diamondback Energy Inc, Strike Price \$224.22 ±	17.520	0,00
19	17/01/2025	Diamondback Energy Inc, Strike Price \$244.22 ±	6.698	0,00
19	20/12/2024	Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$220.00 ±	40.660	0,01
15	20/12/2024	Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$240.00 ±	19.950	0,00
29	17/01/2025	Dine Brands Global Inc, Strike Price \$60.00 ±	6.815	0,00
67	20/12/2024	Dine Brands Global Inc, Strike Price \$65.00 ±	7.203	0,00
48	17/01/2025	Dine Brands Global Inc, Strike Price \$65.00 ±	6.240	0,00
57	20/12/2024	Dine Brands Global Inc, Strike Price \$70.00 ±	2.423	0,00
21	17/01/2025	Dine Brands Global Inc, Strike Price \$70.00 ±	1.522	0,00
1.400.000 EUR	19/12/2025	Dual digital option: Euro Stoxx 50 and Euro Stoxx 50 Index Dividend, Strike Price EUR155.00 ∞	275.412	0,03
4.200.000 USD	20/09/2024	Dual digital option: Euro Stoxx 50 and S&P 500 Index, Strike Price \$0.02 ∞	26.460	0,00
1.000.000 USD	21/02/2025	Dual digital option: S&P 500 Index and EUR/USD spot rate, Down and In Strike Price \$5,935.72 and 1.03 ∞	34.269	0,00
1.100.000 USD	21/02/2025	Dual digital option: S&P 500 Index and EUR/USD spot rate, Down and In Strike Price \$5,986.56 and 1.03 ∞	60.785	0,01
680.000 USD	20/09/2024	Dual digital option: S&P 500 Index and SOFR rate, Down and In, Strike Price \$4,518.19 and \$4.20 ∞	3.222	0,01

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones comprados 18,41% (31 de diciembre de 2023: 17,42%) (cont.)

Número de contratos/ Importe nominal	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de compra (cont.)				
600.000 USD	20/12/2024	Dual digital option: S&P 500 Index and SOFR rate, Down and In, Strike Price \$5,091.00 and \$3.44 [∞]	23.351	0,00
103.656	30/10/2024	Enovis Corp, Strike Price \$47.45 [∞]	276.082	0,03
334.375	29/08/2028	Enovis Corp, Strike Price \$89.72 [∞]	1.604.297	0,18
110.000	17/09/2027	Envestnet Inc, Strike Price \$110.74 [∞]	574.136	0,07
110.000	15/10/2027	Envestnet Inc, Strike Price \$110.74 [∞]	599.316	0,07
110.000	19/11/2027	Envestnet Inc, Strike Price \$110.74 [∞]	631.098	0,07
92.400	15/10/2027	Envestnet Inc, Strike Price \$72.69 [∞]	1.362.228	0,15
36	17/01/2025	EOG Resources Inc, Strike Price \$146.00 [±]	10.890	0,00
30	17/01/2025	EOG Resources Inc, Strike Price \$158.50 [±]	3.900	0,00
77	17/01/2025	EQT Corp, Strike Price \$40.00 [±]	15.400	0,00
67	17/01/2025	EQT Corp, Strike Price \$43.00 [±]	8.777	0,00
555	20/12/2024	Euro Stoxx 50 Dividend Index Call Option on Future, Strike Price EUR160.00 [±]	75.542	0,01
349	19/07/2024	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,925.00 [±]	256.592	0,03
380	17/12/2027	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR5,100.00 [±]	2.070.942	0,23
740	16/08/2024	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR5,250.00 [±]	49.965	0,01
5.000.000 EUR	23/12/2024	Euro/United States Dollar Currency Option, Strike Price \$1.08 [∞]	1.019	0,00
9	17/01/2025	FedEx Corp, Strike Price \$270.00 [±]	39.735	0,01
15	17/01/2025	FedEx Corp, Strike Price \$280.00 [±]	56.662	0,01
22	17/01/2025	FedEx Corp, Strike Price \$300.00 [±]	56.925	0,01
36	17/01/2025	Fiserv Inc, Strike Price \$165.00 [±]	16.740	0,00
30	17/01/2025	Fiserv Inc, Strike Price \$180.00 [±]	5.250	0,00
173.640	09/08/2024	Fluor Corp, Strike Price \$36.19 [∞]	1.368.435	0,15
300.000	15/06/2029	Fluor Corp, Strike Price \$68.50 [∞]	2.714.711	0,31
300.000	13/07/2029	Fluor Corp, Strike Price \$68.50 [∞]	2.757.754	0,31
300.000	13/08/2029	Fluor Corp, Strike Price \$68.50 [∞]	2.805.842	0,32
69	17/01/2025	Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$45.00 [±]	51.922	0,01
66	17/01/2025	Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$47.00 [±]	42.900	0,01
800.000.000 JPY	08/06/2026	GMO Payment Gateway Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 70bps. [∞]	40.797	0,01
41	17/01/2025	Halliburton Co, Strike Price \$40.00 [±]	4.141	0,00
32	17/01/2025	Halliburton Co, Strike Price \$45.00 [±]	1.248	0,00
26	17/01/2025	Hilton Worldwide Holdings Inc, Strike Price \$220.00 [±]	43.290	0,01
22	17/01/2025	Hilton Worldwide Holdings Inc, Strike Price \$240.00 [±]	19.910	0,00
600.000.000 JPY	05/09/2024	Hosele Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 75bps. [∞]	89.830	0,01
66	17/01/2025	HP Inc, Strike Price \$32.00 [±]	32.340	0,00
50	17/01/2025	HP Inc, Strike Price \$37.00 [±]	12.250	0,00
150.000.000 JPY	14/03/2031	Ibiden Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 135bps. [∞]	155.367	0,02
50.000.000 JPY	30/03/2029	Infroneer Holdings Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 140bps. [∞]	16.040	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones comprados 18,41% (31 de diciembre de 2023: 17,42%) (cont.)

Número de contratos/ Importe notional	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de compra (cont.)				
350.000.000 JPY	30/03/2029	Infroneer Holdings Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 160bps. [∞]	132.773	0,02
10.659	17/07/2026	Insulet Corp, Strike Price \$321.48 [∞]	208.267	0,02
50.000	17/07/2026	Insulet Corp, Strike Price \$335.00 [∞]	867.093	0,10
350.000.000 JPY	28/09/2028	JAFco Group Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 167bps. [∞]	313.316	0,04
110.000.000 JPY	28/09/2028	JFE Holdings Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 100bps. [∞]	60.213	0,01
350.000.000 JPY	28/09/2028	JFE Holdings Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 90bps. [∞]	182.410	0,02
200	19/07/2024	JPMorgan Chase & Co, Strike Price \$200.00 [±]	110.000	0,01
93	12/07/2024	JPMorgan Chase & Co, Strike Price \$205.00 [±]	25.110	0,00
380.000.000 JPY	12/03/2029	Kansai, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 112bps. [∞]	320.980	0,04
240.000.000 JPY	12/03/2029	Kansai, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 142bps. [∞]	210.099	0,02
18	11/07/2024	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW365.00 [±]	59.172	0,01
157	17/01/2025	Kraft Heinz Co, Strike Price \$40.00 [±]	2.277	0,00
138	17/01/2025	Kraft Heinz Co, Strike Price \$42.50 [±]	1.380	0,00
30	20/12/2024	Lear Corp, Strike Price \$150.00 [±]	2.325	0,00
27	20/12/2024	Lear Corp, Strike Price \$160.00 [±]	1.485	0,00
12.952	15/12/2028	Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$101.56 [∞]	384.608	0,04
280	17/01/2025	Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$105.00 [±]	151.200	0,02
80.000	15/12/2028	Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$145.00 [∞]	1.308.128	0,15
11	17/01/2025	Lowe's Companies Inc, Strike Price \$240.00 [±]	9.817	0,00
10	17/01/2025	Lowe's Companies Inc, Strike Price \$260.00 [±]	3.675	0,00
21	17/01/2025	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$105.00 [±]	5.250	0,00
51	17/01/2025	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$110.00 [±]	7.650	0,00
18	17/01/2025	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$115.00 [±]	1.620	0,00
44	17/01/2025	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$120.00 [±]	2.310	0,00
53	20/12/2024	ManpowerGroup Inc, Strike Price \$85.00 [±]	6.228	0,00
47	20/12/2024	ManpowerGroup Inc, Strike Price \$90.00 [±]	2.115	0,00
7	20/12/2024	Martin Marietta Materials Inc, Strike Price \$660.00 [±]	5.740	0,00
6	20/12/2024	Martin Marietta Materials Inc, Strike Price \$720.00 [±]	2.235	0,00
12	17/01/2025	Mastercard Inc, Strike Price \$500.00 [±]	10.110	0,00
9	17/01/2025	Mastercard Inc, Strike Price \$560.00 [±]	1.377	0,00
64	20/12/2024	Matador Resources Co, Strike Price \$70.00 [±]	16.480	0,00
49	20/12/2024	Matador Resources Co, Strike Price \$80.00 [±]	6.125	0,00
530.000.000 JPY	29/01/2025	Menicon Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 50bps. [∞]	0	0,00
5	17/01/2025	Meta Platforms Inc, Strike Price \$440.00 [±]	48.975	0,01
4	17/01/2025	Meta Platforms Inc, Strike Price \$480.00 [±]	29.900	0,00
106	16/10/2024	Metlife Inc, Strike Price \$71.00 [∞]	30.631	0,00
106	17/10/2024	Metlife Inc, Strike Price \$71.00 [∞]	30.857	0,00
106	18/10/2024	Metlife Inc, Strike Price \$71.00 [∞]	31.092	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones comprados 18,41% (31 de diciembre de 2023: 17,42%) (cont.)

Número de contratos/ Importe notional	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de compra (cont.)				
500.000.000 MXN	05/07/2024	Mexican Peso/Chinese Yuan Renminbi Currency Option, Strike Price CNY0.44 [∞]	0	0,00
357	18/07/2025	Middleby Corp, Strike Price \$130.00 [∞]	514.027	0,06
45.713	18/07/2025	Middleby Corp, Strike Price \$150.83 [∞]	307.539	0,04
112.500	18/07/2025	Middleby Corp, Strike Price \$210.00 [∞]	66.274	0,01
18	17/01/2025	Morgan Stanley, Strike Price \$105.00 [±]	7.650	0,00
21	17/01/2025	Morgan Stanley, Strike Price \$95.00 [±]	19.215	0,00
91	20/12/2024	Murphy Oil Corp, Strike Price \$50.00 [±]	7.053	0,00
75	20/12/2024	Murphy Oil Corp, Strike Price \$55.00 [±]	2.250	0,00
100.000.000 JPY	16/06/2028	Nagoya, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 113bps. [∞]	45.816	0,01
140.000.000 JPY	15/06/2029	Nagoya, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 125bps. [∞]	79.634	0,01
1.020.000.000 JPY	12/11/2024	Nagoya, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 38bps. [∞]	1.005	0,00
1.000.000.000 JPY	11/12/2024	Nagoya, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 50bps. [∞]	2.534	0,00
370.000.000 JPY	27/11/2024	Nagoya, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 60bps. [∞]	1.372	0,00
10	17/01/2025	Netflix Inc, Strike Price \$490.00 [±]	208.350	0,02
7	17/01/2025	Netflix Inc, Strike Price \$530.00 [±]	122.955	0,01
4	17/01/2025	Netflix Inc, Strike Price \$620.00 [±]	44.410	0,01
34	19/07/2024	Netflix Inc, Strike Price \$680.00 [±]	97.665	0,01
4	17/01/2025	Netflix Inc, Strike Price \$680.00 [±]	30.700	0,00
94	12/07/2024	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY38,750.00 [±]	584.359	0,07
1.200.000.000 JPY	04/10/2024	Nippon 24, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 55bps. [∞]	3.294.464	0,37
10.000.000 JPY	04/09/2026	Nippon Steel Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 49bps. [∞]	25.681	0,00
29	17/01/2025	NRG Energy Inc, Strike Price \$60.00 [±]	62.495	0,01
26	17/01/2025	NRG Energy Inc, Strike Price \$65.00 [±]	47.840	0,01
9	17/01/2025	Nucor Corp, Strike Price \$210.00 [±]	1.282	0,00
8	17/01/2025	Nucor Corp, Strike Price \$230.00 [±]	460	0,00
446.500	29/06/2029	ON Semiconductor Corp, Strike Price \$156.78 [∞]	5.766.045	0,65
446.500	06/07/2029	ON Semiconductor Corp, Strike Price \$156.78 [∞]	5.795.270	0,65
151.810	28/02/2025	ON Semiconductor Corp, Strike Price \$80.75 [∞]	854.336	0,10
72	17/01/2025	ONEOK Inc, Strike Price \$85.00 [±]	24.480	0,00
58	17/01/2025	ONEOK Inc, Strike Price \$95.00 [±]	4.930	0,00
150.000.000 JPY	14/12/2028	OSG Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 60bps. [∞]	137.542	0,02
317	17/01/2025	PG&E Corp, Strike Price \$20.00 [±]	12.046	0,00
82	17/01/2025	PG&E Corp, Strike Price \$22.00 [±]	1.353	0,00
122	17/07/2024	POSCO Holdings Inc, Strike Price KRW488,000.00 [∞]	0	0,00
20	17/01/2025	Prudential Financial Inc, Strike Price \$115.00 [±]	17.900	0,00
15	17/01/2025	Prudential Financial Inc, Strike Price \$125.00 [±]	7.950	0,00
94	17/01/2025	Range Resources Corp, Strike Price \$32.00 [±]	42.300	0,01
39	17/01/2025	Range Resources Corp, Strike Price \$35.00 [±]	11.797	0,00
36	17/01/2025	Range Resources Corp, Strike Price \$37.00 [±]	8.100	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones comprados 18,41% (31 de diciembre de 2023: 17,42%) (cont.)

Número de contratos/ Importe nominal	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de compra (cont.)				
13	20/12/2024	Reliance Inc, Strike Price \$350.00 ±	4.680	0,00
11	20/12/2024	Reliance Inc, Strike Price \$380.00 ±	1.898	0,00
45	16/01/2026	Rocket Companies Inc, Strike Price \$12.00 ±	17.775	0,00
39	17/01/2025	Ross Stores Inc, Strike Price \$145.00 ±	46.995	0,01
13	17/01/2025	Ross Stores Inc, Strike Price \$155.00 ±	9.425	0,00
33	17/01/2025	Ross Stores Inc, Strike Price \$160.00 ±	17.985	0,00
11	17/01/2025	Ross Stores Inc, Strike Price \$170.00 ±	3.245	0,00
39	20/12/2024	Ryder System Inc, Strike Price \$135.00 ±	22.425	0,00
33	20/12/2024	Ryder System Inc, Strike Price \$145.00 ±	10.065	0,00
180	15/11/2024	S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price \$5,300.00 ±	3.300.750	0,37
209	15/11/2024	S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price \$5,400.00 ±	3.046.175	0,34
97	15/11/2024	S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price \$5,450.00 ±	1.242.813	0,14
132	19/07/2024	S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price \$5,550.00 ±	255.750	0,03
130	31/07/2024	S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price \$5,550.00 ±	351.000	0,04
186	15/11/2024	S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price \$5,750.00 ±	855.600	0,10
6	17/12/2027	S&P 500 Index, Strike Price \$5,800.00 ±	508.170	0,06
24	17/12/2027	S&P 500 Index, Strike Price \$6,100.00 ±	1.661.400	0,19
216.740	01/05/2028	Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price \$107.85 ∞	6.080.685	0,68
36.846	09/09/2024	Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price \$64.30 ∞	1.467.077	0,17
76	20/12/2024	SEI Investments Co, Strike Price \$75.00 ±	5.510	0,00
67	20/12/2024	SEI Investments Co, Strike Price \$80.00 ±	1.843	0,00
58.277	21/01/2028	Semtech Corp, Strike Price \$41.74 ∞	664.345	0,08
400.000	21/01/2028	Semtech Corp, Strike Price \$51.00 ∞	4.013.301	0,45
1.050	19/07/2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price \$120.40 ∞	106	0,00
1.050	16/08/2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price \$120.40 ∞	4.359	0,00
18	17/01/2025	Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$115.00 ±	13.410	0,00
16	17/01/2025	Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$125.00 ±	7.280	0,00
300	05/07/2024	SOFR 1 Year Mid-Curve Call Option on Future, Strike Price \$95.94 ±	37.500	0,01
23	17/01/2025	State Street Corp, Strike Price \$82.50 ±	5.635	0,00
19	17/01/2025	State Street Corp, Strike Price \$90.00 ±	1.947	0,00
894.454	28/02/2030	Stem Inc, Strike Price \$11.18 ∞	432.333	0,05
89.445	28/03/2025	Stem Inc, Strike Price \$2.25 ∞	19.223	0,00
380	17/12/2027	Stoxx Europe 600 Index, Strike Price EUR500.00 ±	1.227.904	0,14
114	17/12/2027	Swiss Market Index, Strike Price CHF11,200.00 ±	1.728.395	0,19
50	17/01/2025	T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$120.00 ±	33.750	0,00
42	17/01/2025	T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$130.00 ±	14.070	0,00
180.000.000 JPY	19/09/2030	Taiyo Yuden Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 70bps. ∞	210.929	0,02
10	17/01/2025	Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$185.00 ±	4.775	0,00
9	17/01/2025	Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$200.00 ±	1.931	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones comprados 18,41% (31 de diciembre de 2023: 17,42%) (cont.)

Número de contratos/ Importe notional	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de compra (cont.)				
67	17/01/2025	Tanger Inc, Strike Price \$30.00 ±	5.862	0,00
50	17/01/2025	Tanger Inc, Strike Price \$35.00 ±	875	0,00
16	17/01/2025	Targa Resources Corp, Strike Price \$105.00 ±	44.000	0,01
45	17/01/2025	Targa Resources Corp, Strike Price \$125.00 ±	56.250	0,01
38	17/01/2025	Targa Resources Corp, Strike Price \$135.00 ±	28.310	0,00
19	17/01/2025	Targa Resources Corp, Strike Price \$95.00 ±	68.970	0,01
39	20/12/2024	TD SYNEX Corp, Strike Price \$125.00 ±	14.430	0,00
34	20/12/2024	TD SYNEX Corp, Strike Price \$135.00 ±	6.460	0,00
39	20/12/2024	Tenet Healthcare Corp, Strike Price \$105.00 ±	129.480	0,02
33	20/12/2024	Tenet Healthcare Corp, Strike Price \$115.00 ±	86.130	0,01
34.900	19/08/2024	Tetra Tech Inc, Strike Price \$165.63 ∞	1.438.262	0,16
127.138	17/07/2028	Tetra Tech Inc, Strike Price \$259.56 ∞	4.222.394	0,47
29	20/12/2024	Texas Roadhouse Inc, Strike Price \$165.00 ±	52.490	0,01
23	20/12/2024	Texas Roadhouse Inc, Strike Price \$185.00 ±	19.090	0,00
14	17/01/2025	Thor Industries Inc, Strike Price \$125.00 ±	1.995	0,00
13	17/01/2025	Thor Industries Inc, Strike Price \$135.00 ±	1.658	0,00
230.000.000 JPY	29/09/2028	Tokyu Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 85bps. ∞	95.976	0,01
200.000.000 JPY	13/11/2026	Transcosmos Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 45bps. ∞	75.827	0,01
64	16/08/2024	Uber Technologies Inc, Strike Price \$70.00 ±	38.400	0,01
75.000.000 USD	11/07/2024	United States Dollar/Chinese Yuan Renminbi Currency Option, Strike Price CNY7.33 ∞	51.675	0,01
75.000.000 USD	16/04/2025	United States Dollar/Hong Kong Dollar Currency Option, Strike Price HKD7.77 ∞	233.700	0,03
57.000.000 USD	05/03/2026	United States Dollar/Japanese Yen Currency Option, Strike Price JPY137.00 ∞	5.207.064	0,58
27.975.000 USD	05/03/2026	United States Dollar/Japanese Yen Currency Option, Strike Price JPY141.50 ∞	2.006.339	0,23
66	17/01/2025	Unum Group, Strike Price \$52.50 ±	26.235	0,00
56	17/01/2025	Unum Group, Strike Price \$57.50 ±	6.860	0,00
570	26/07/2024	US Treasury 10-Year Note Call Option on Future, Strike Price \$112.00 ±	89.063	0,01
214	17/01/2025	Viatris Inc, Strike Price \$12.00 ±	9.630	0,00
137	17/01/2025	Viatris Inc, Strike Price \$15.00 ±	1.712	0,00
818.777	25/10/2028	Wayfair Inc, Strike Price \$73.28 ∞	21.176.791	2,37
67.500	13/05/2025	Wayfair Inc, Strike Price \$75.94 ∞	424.762	0,05
41.096	07/11/2024	Western Digital Corp, Strike Price \$42.46 ∞	1.415.571	0,16
35	17/01/2025	Western Digital Corp, Strike Price \$55.00 ±	81.200	0,01
30	17/01/2025	Western Digital Corp, Strike Price \$60.00 ±	58.875	0,01
26	17/01/2025	Western Digital Corp, Strike Price \$65.00 ±	40.560	0,01
22	17/01/2025	Western Digital Corp, Strike Price \$70.00 ±	27.280	0,00
249.066	16/10/2028	Western Digital Corp, Strike Price \$70.26 ∞	7.849.640	0,88
8	17/01/2025	Wingstop Inc, Strike Price \$300.00 ±	111.360	0,01
6	17/01/2025	Wingstop Inc, Strike Price \$330.00 ±	69.360	0,01
46	17/01/2025	Winnebago Industries Inc, Strike Price \$75.00 ±	3.680	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones comprados 18,41% (31 de diciembre de 2023: 17,42%) (cont.)

Número de contratos/ Importe nominal	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de compra (cont.)				
41	17/01/2025	Winnebago Industries Inc, Strike Price \$80.00 ±	1.742	0,00
1.400.000 EUR	20/09/2024	Worst of a basket vs. the best of a basket, Strike Price EURO ∞	7.952	0,00
21.739	19/10/2029	Wolfspeed Inc, Strike Price \$107.31 ∞	126.347	0,02
120.000	19/10/2029	Wolfspeed Inc, Strike Price \$200.00 ∞	504.000	0,06
20	17/01/2025	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$105.00 ±	5.690	0,00
15	17/01/2025	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$115.00 ±	2.017	0,00

Opciones de venta

100	12/07/2024	3 Month Euro EURIBOR Put Option on Future, Strike Price EUR96.00 ±	0	0,00
200	13/09/2024	3 Month SOFR Put Option on Future, Strike Price \$94.00 ±	1.250	0,00
400	11/10/2024	3 Month SOFR Put Option on Future, Strike Price \$94.38 ±	2.500	0,00
200	12/07/2024	3 Month SOFR Put Option on Future, Strike Price \$94.50 ±	1.250	0,00
400	13/12/2024	3 Month SOFR Put Option on Future, Strike Price \$94.63 ±	10.000	0,00
2.000	13/12/2024	3 Month SONIA Put Option on Future, Strike Price GBP94.40 ±	31.603	0,00
29	17/01/2025	AbbVie Inc, Strike Price \$115.00 ±	1.232	0,00
21	17/01/2025	AbbVie Inc, Strike Price \$140.00 ±	3.097	0,00
16	17/01/2025	AbbVie Inc, Strike Price \$165.00 ±	12.240	0,00
46	17/01/2025	AbbVie Inc, Strike Price \$90.00 ±	1.311	0,00
112	19/07/2024	Advanced Energy Industries Inc, Strike Price \$70.00 ±	0	0,00
397	16/08/2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$80.00 ±	49.625	0,01
616	17/01/2025	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$80.00 ±	252.560	0,03
1.121	21/03/2025	Alibaba Group Holding, Strike Price \$50.00 ±	94.164	0,01
571	17/01/2025	Alibaba Group Holding, Strike Price \$55.00 ±	56.815	0,01
5.460	15/11/2024	American Airlines Group Inc, Strike Price \$8.00 ±	73.710	0,01
77	17/01/2025	Apple Inc, Strike Price \$120.00 ±	886	0,00
52	17/01/2025	Apple Inc, Strike Price \$145.00 ±	2.418	0,00
38	17/01/2025	Apple Inc, Strike Price \$170.00 ±	5.966	0,00
208	19/07/2024	Apple Inc, Strike Price \$210.00 ±	70.200	0,01
25	17/01/2025	ArcBest Corp, Strike Price \$100.00 ±	21.625	0,00
19	17/01/2025	ArcBest Corp, Strike Price \$115.00 ±	30.875	0,00
5.460	15/11/2024	American Airlines Group Inc, Strike Price \$8.00 ±	73.710	0,01
77	17/01/2025	Apple Inc, Strike Price \$120.00 ±	886	0,00
52	17/01/2025	Apple Inc, Strike Price \$145.00 ±	2.418	0,00
38	17/01/2025	Apple Inc, Strike Price \$170.00 ±	5.966	0,00
208	19/07/2024	Apple Inc, Strike Price \$210.00 ±	70.200	0,01
25	17/01/2025	ArcBest Corp, Strike Price \$100.00 ±	21.625	0,00
19	17/01/2025	ArcBest Corp, Strike Price \$115.00 ±	30.875	0,00
55	17/01/2025	ArcBest Corp, Strike Price \$65.00 ±	6.050	0,00
37	17/01/2025	ArcBest Corp, Strike Price \$80.00 ±	11.007	0,00
23	17/01/2025	Autodesk Inc, Strike Price \$140.00 ±	1.380	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones comprados 18,41% (31 de diciembre de 2023: 17,42%) (cont.)

Número de contratos/ Importe nominal	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de venta (cont.)				
15	17/01/2025	Autodesk Inc, Strike Price \$180.00 ±	3.563	0,00
10	17/01/2025	Autodesk Inc, Strike Price \$220.00 ±	9.250	0,00
8	17/01/2025	Autodesk Inc, Strike Price \$260.00 ±	19.560	0,00
23	17/01/2025	Axon Enterprise Inc, Strike Price \$140.00 ±	1.725	0,00
14	17/01/2025	Axon Enterprise Inc, Strike Price \$180.00 ±	2.905	0,00
11	17/01/2025	Axon Enterprise Inc, Strike Price \$220.00 ±	5.500	0,00
9	17/01/2025	Axon Enterprise Inc, Strike Price \$250.00 ±	9.720	0,00
7.040	20/09/2024	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR5.25 ±	7.545	0,00
3.073	20/06/2025	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR7.25 ±	128.446	0,02
762	20/12/2024	Banco BPM SpA, Strike Price EUR2.80 ±	31.850	0,00
4.400	20/12/2024	Banco Santander SA, Strike Price EUR2.70 ±	9.431	0,00
139	17/01/2025	Best Buy Co Inc, Strike Price \$55.00 ±	8.827	0,00
100	17/01/2025	Best Buy Co Inc, Strike Price \$65.00 ±	13.200	0,00
74	17/01/2025	Best Buy Co Inc, Strike Price \$75.00 ±	24.235	0,00
1.021	21/03/2025	BNP Paribas SA, Strike Price EUR45.00 ±	112.708	0,01
12	19/07/2024	Boeing Co, Strike Price \$170.00 ±	1.320	0,00
195	17/01/2025	Boston Scientific Corp, Strike Price \$47.00 ±	6.338	0,00
130	17/01/2025	Boston Scientific Corp, Strike Price \$57.50 ±	6.175	0,00
94	17/01/2025	Boston Scientific Corp, Strike Price \$67.50 ±	12.455	0,00
100	17/01/2025	Boyd Gaming Corp, Strike Price \$35.00 ±	7.750	0,00
162	20/12/2024	Boyd Gaming Corp, Strike Price \$45.00 ±	14.985	0,00
207	17/01/2025	Boyd Gaming Corp, Strike Price \$45.00 ±	24.840	0,00
108	20/12/2024	Boyd Gaming Corp, Strike Price \$55.00 ±	41.580	0,01
137	17/01/2025	Boyd Gaming Corp, Strike Price \$55.00 ±	56.170	0,01
36	17/01/2025	Boyd Gaming Corp, Strike Price \$60.00 ±	24.660	0,00
77	20/12/2024	Boyd Gaming Corp, Strike Price \$65.00 ±	85.085	0,01
70	17/01/2025	Boyd Gaming Corp, Strike Price \$65.00 ±	77.350	0,01
475	20/12/2024	BPER Banca, Strike Price EUR2.00 ±	3.920	0,00
127	20/12/2024	Brink's Co, Strike Price \$60.00 ±	1.905	0,00
82	20/12/2024	Brink's Co, Strike Price \$75.00 ±	5.330	0,00
57	20/12/2024	Brink's Co, Strike Price \$90.00 ±	15.248	0,00
59	17/01/2025	Bunge Global SA, Strike Price \$105.00 ±	31.860	0,00
124	17/01/2025	Bunge Global SA, Strike Price \$72.50 ±	9.610	0,00
85	17/01/2025	Bunge Global SA, Strike Price \$87.50 ±	15.088	0,00
7.014	20/12/2024	CaixaBank SA, Strike Price EUR2.40 ±	7.517	0,00
133	17/01/2025	Callon Petroleum Co, Strike Price \$20.00 ±	4.190	0,00
101	17/01/2025	Callon Petroleum Co, Strike Price \$23.00 ±	6.363	0,00
70	17/01/2025	Callon Petroleum Co, Strike Price \$28.00 ±	21.945	0,00
51	17/01/2025	Callon Petroleum Co, Strike Price \$33.00 ±	21.930	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones comprados 18,41% (31 de diciembre de 2023: 17,42%) (cont.)

Número de contratos/ Importe notional	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de venta (cont.)				
21	17/01/2025	Cardinal Health Inc, Strike Price \$105.00 ±	21.210	0,00
67	17/01/2025	Cardinal Health Inc, Strike Price \$57.50 ±	0	0,00
41	17/01/2025	Cardinal Health Inc, Strike Price \$75.00 ±	2.767	0,00
28	17/01/2025	Cardinal Health Inc, Strike Price \$90.00 ±	11.340	0,00
101	17/01/2025	CarMax Inc, Strike Price \$57.50 ±	17.422	0,00
68	17/01/2025	CarMax Inc, Strike Price \$70.00 ±	29.240	0,00
53	17/01/2025	CarMax Inc, Strike Price \$80.00 ±	54.325	0,01
1.000	18/10/2024	Carnival Corp, Strike Price \$10.00 ±	4.000	0,00
2.250	17/01/2025	Carnival Corp, Strike Price \$12.50 ±	70.875	0,01
159	01/07/2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,350.00 ±	5.168	0,00
99	17/01/2025	Charles Schwab Corp, Strike Price \$35.00 ±	1.435	0,00
137	17/01/2025	Charles Schwab Corp, Strike Price \$42.50 ±	2.671	0,00
61	17/01/2025	Charles Schwab Corp, Strike Price \$45.00 ±	1.494	0,00
100	17/01/2025	Charles Schwab Corp, Strike Price \$50.00 ±	4.100	0,00
41	17/01/2025	Charles Schwab Corp, Strike Price \$55.00 ±	2.911	0,00
40	19/07/2024	Charles Schwab Corp, Strike Price \$60.00 ±	280	0,00
70	17/01/2025	Charles Schwab Corp, Strike Price \$60.00 ±	8.750	0,00
29	17/01/2025	Charles Schwab Corp, Strike Price \$65.00 ±	6.365	0,00
400	26/07/2024	Charles Schwab Corp, Strike Price \$70.00 ±	36.000	0,01
245	17/01/2025	Chemours Co, Strike Price \$23.00 ±	74.112	0,01
165	17/01/2025	Chemours Co, Strike Price \$28.00 ±	107.250	0,01
120	17/01/2025	Chemours Co, Strike Price \$33.00 ±	131.400	0,02
300	17/01/2025	Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$24.80 ±	84.750	0,01
150	17/01/2025	Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$31.60 ±	3.375	0,00
200	17/01/2025	Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$38.20 ±	7.500	0,00
150	17/01/2025	Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$45.00 ±	10.125	0,00
12	20/12/2024	Cintas Corp, Strike Price \$570.00 ±	6.840	0,00
8	20/12/2024	Cintas Corp, Strike Price \$670.00 ±	19.360	0,00
341	17/01/2025	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$10.00 ±	7.331	0,00
151	17/01/2025	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$15.00 ±	21.971	0,00
119	17/01/2025	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$17.00 ±	29.036	0,00
85	17/01/2025	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$20.00 ±	43.562	0,01
195	20/12/2024	Commercial Metals Co, Strike Price \$37.50 ±	7.800	0,00
121	20/12/2024	Commercial Metals Co, Strike Price \$47.50 ±	13.613	0,00
91	20/12/2024	Commercial Metals Co, Strike Price \$55.00 ±	32.305	0,00
1.000	16/08/2024	CONMED Corp, Strike Price \$60.00 ±	280.000	0,03
67	17/01/2025	ConocoPhillips, Strike Price \$110.00 ±	36.013	0,01
48	17/01/2025	ConocoPhillips, Strike Price \$130.00 ±	80.760	0,01
100	17/01/2025	ConocoPhillips, Strike Price \$90.00 ±	10.300	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones comprados 18,41% (31 de diciembre de 2023: 17,42%) (cont.)

Número de contratos/ Importe nominal	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de venta (cont.)				
50	17/01/2025	Constellation Brands Inc, Strike Price \$180.00 [±]	7.625	0,00
34	17/01/2025	Constellation Brands Inc, Strike Price \$220.00 [±]	10.880	0,00
24	17/01/2025	Constellation Brands Inc, Strike Price \$260.00 [±]	33.000	0,00
371	17/01/2025	Corning Inc, Strike Price \$23.00 [±]	0	0,00
250	17/01/2025	Corning Inc, Strike Price \$28.00 [±]	20.625	0,00
192	17/01/2025	Corning Inc, Strike Price \$32.00 [±]	10.080	0,00
197	17/01/2025	Coterra Energy Inc, Strike Price \$15.00 [±]	0	0,00
137	17/01/2025	Coterra Energy Inc, Strike Price \$18.00 [±]	1.713	0,00
85	17/01/2025	Coterra Energy Inc, Strike Price \$23.00 [±]	4.462	0,00
71	17/01/2025	Coterra Energy Inc, Strike Price \$25.00 [±]	7.632	0,00
14.610	20/12/2024	Crédit Agricole SA, Strike Price EUR7.00 [±]	86.120	0,01
50	20/12/2024	Crocs Inc, Strike Price \$105.00 [±]	13.250	0,00
35	20/12/2024	Crocs Inc, Strike Price \$125.00 [±]	24.325	0,00
77	20/12/2024	Crocs Inc, Strike Price \$85.00 [±]	6.738	0,00
366	17/01/2025	CSX Corp, Strike Price \$25.00 [±]	8.235	0,00
255	17/01/2025	CSX Corp, Strike Price \$30.00 [±]	19.125	0,00
187	17/01/2025	CSX Corp, Strike Price \$35.00 [±]	48.153	0,01
83	17/01/2025	Darden Restaurants Inc, Strike Price \$110.00 [±]	6.640	0,00
60	17/01/2025	Darden Restaurants Inc, Strike Price \$130.00 [±]	16.050	0,00
41	17/01/2025	Darden Restaurants Inc, Strike Price \$155.00 [±]	45.510	0,01
620	20/12/2024	Davide Campari-Milano NV, Strike Price EUR6.60 [±]	51.431	0,01
660	21/03/2025	Deutsche Bank AG, Strike Price EUR11.00 [±]	22.635	0,00
1.395.000	21/03/2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR15.50 [∞]	71.493	0,01
113	17/01/2025	Devon Energy Corp, Strike Price \$25.00 [±]	1.977	0,00
79	17/01/2025	Devon Energy Corp, Strike Price \$30.00 [±]	1.777	0,00
266	17/01/2025	Devon Energy Corp, Strike Price \$37.50 [±]	19.152	0,00
40	17/01/2025	Devon Energy Corp, Strike Price \$42.50 [±]	6.800	0,00
149	17/01/2025	Devon Energy Corp, Strike Price \$45.00 [±]	37.772	0,01
110	17/01/2025	Devon Energy Corp, Strike Price \$52.50 [±]	71.775	0,01
59	17/01/2025	Diamondback Energy Inc, Strike Price \$142.07 [±]	11.063	0,00
40	17/01/2025	Diamondback Energy Inc, Strike Price \$172.07 [±]	17.400	0,00
28	17/01/2025	Diamondback Energy Inc, Strike Price \$204.22 [±]	42.840	0,01
47	20/12/2024	Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$140.00 [±]	8.460	0,00
32	20/12/2024	Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$170.00 [±]	17.280	0,00
23	20/12/2024	Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price \$200.00 [±]	31.855	0,00
219	17/01/2025	Dine Brands Global Inc, Strike Price \$30.00 [±]	0	0,00
177	20/12/2024	Dine Brands Global Inc, Strike Price \$40.00 [±]	9.735	0,00
127	17/01/2025	Dine Brands Global Inc, Strike Price \$40.00 [±]	9.525	0,00
51	17/01/2025	Dine Brands Global Inc, Strike Price \$45.00 [±]	7.522	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones comprados 18,41% (31 de diciembre de 2023: 17,42%) (cont.)

Número de contratos/ Importe nominal	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de venta (cont.)				
113	20/12/2024	Dine Brands Global Inc, Strike Price \$50.00 ±	35.030	0,01
39	17/01/2025	Dine Brands Global Inc, Strike Price \$50.00 ±	11.700	0,00
94	20/12/2024	Dine Brands Global Inc, Strike Price \$55.00 ±	51.230	0,01
67	17/01/2025	Dine Brands Global Inc, Strike Price \$55.00 ±	35.845	0,01
227	20/12/2024	DocMorris AG, Strike Price CHF53.00 ±	21.346	0,00
600	18/10/2024	Enovis Corporation, Strike Price \$40.00 ±	70.500	0,01
1.155	16/08/2024	Envestnet Inc, Strike Price \$35.00 ±	0	0,00
61	17/01/2025	EOG Resources Inc, Strike Price \$112.50 ±	23.180	0,00
45	17/01/2025	EOG Resources Inc, Strike Price \$132.50 ±	51.750	0,01
91	17/01/2025	EOG Resources Inc, Strike Price \$92.50 ±	7.508	0,00
304	17/01/2025	EQT Corp, Strike Price \$20.00 ±	2.584	0,00
195	17/01/2025	EQT Corp, Strike Price \$25.00 ±	3.315	0,00
137	17/01/2025	EQT Corp, Strike Price \$30.00 ±	11.987	0,00
101	17/01/2025	EQT Corp, Strike Price \$35.00 ±	22.624	0,00
874	21/03/2025	Erste Group Bank AG, Strike Price EUR28.00 ±	28.570	0,00
172	01/07/2024	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,700.00 ±	2.876	0,00
1.024	19/07/2024	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,700.00 ±	308.390	0,04
181	19/07/2024	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,900.00 ±	161.591	0,02
182	19/07/2024	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,925.00 ±	184.720	0,02
380	17/12/2027	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR5,100.00 ±	2.456.215	0,28
5.000.000 EUR	23/07/2024	Euro/United States Dollar Currency Option, Strike Price \$1.05 ∞	10.405	0,00
7.000.000 EUR	01/07/2024	Euro/United States Dollar Currency Option, Strike Price \$1.06 ∞	2.297	0,00
29	17/01/2025	FedEx Corp, Strike Price \$135.00 ±	1.145	0,00
55	17/01/2025	FedEx Corp, Strike Price \$175.00 ±	2.667	0,00
13	17/01/2025	FedEx Corp, Strike Price \$210.00 ±	1.722	0,00
24	17/01/2025	FedEx Corp, Strike Price \$220.00 ±	4.596	0,00
28	17/01/2025	FedEx Corp, Strike Price \$250.00 ±	14.070	0,00
90	17/01/2025	Fiserv Inc, Strike Price \$105.00 ±	13.950	0,00
63	17/01/2025	Fiserv Inc, Strike Price \$125.00 ±	11.498	0,00
44	17/01/2025	Fiserv Inc, Strike Price \$150.00 ±	34.100	0,00
1.623	17/01/2025	Fluor Corp, Strike Price \$27.50 ±	73.035	0,01
260	17/01/2025	Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$23.00 ±	1.820	0,00
176	17/01/2025	Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$28.00 ±	5.016	0,00
113	17/01/2025	Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$35.00 ±	6.667	0,00
88	17/01/2025	Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$40.00 ±	12.804	0,00
157	17/01/2025	Halliburton Co, Strike Price \$20.00 ±	1.805	0,00
100	17/01/2025	Halliburton Co, Strike Price \$25.00 ±	3.450	0,00
61	17/01/2025	Halliburton Co, Strike Price \$32.00 ±	10.980	0,00
47	17/01/2025	Halliburton Co, Strike Price \$37.00 ±	20.915	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones comprados 18,41% (31 de diciembre de 2023: 17,42%) (cont.)

Número de contratos/ Importe nominal	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de venta (cont.)				
750	17/01/2025	Herbalife Nutrition Ltd, Strike Price \$5.00 ±	26.250	0,00
6.424	16/08/2024	Herbalife Nutrition Ltd, Strike Price \$7.50 ±	240.900	0,03
60	17/01/2025	Hilton Worldwide Holdings Inc, Strike Price \$145.00 ±	4.200	0,00
41	17/01/2025	Hilton Worldwide Holdings Inc, Strike Price \$175.00 ±	6.868	0,00
31	17/01/2025	Hilton Worldwide Holdings Inc, Strike Price \$200.00 ±	18.755	0,00
204	17/01/2025	HP Inc, Strike Price \$15.00 ±	204	0,00
165	17/01/2025	HP Inc, Strike Price \$20.00 ±	2.145	0,00
105	17/01/2025	HP Inc, Strike Price \$25.00 ±	2.100	0,00
75	17/01/2025	HP Inc, Strike Price \$30.00 ±	7.312	0,00
175	20/12/2024	Insulet Corp, Strike Price \$120.00 ±	25.813	0,00
47	17/01/2025	Insulet Corp, Strike Price \$150.00 ±	20.798	0,00
260	15/11/2024	InterDigital Inc, Strike Price \$75.00 ±	27.950	0,00
11.450	20/12/2024	Intesa Sanpaolo SpA, Strike Price EUR1.60 ±	307.402	0,04
9	12/07/2024	JPMorgan Chase & Co, Strike Price \$195.00 ±	1.265	0,00
200	19/07/2024	JPMorgan Chase & Co, Strike Price \$200.00 ±	73.500	0,01
440	20/06/2025	KBC Group NV, Strike Price EUR49.48 ±	86.208	0,01
3.170	18/10/2024	Kosmos Energy Ltd, Strike Price \$4.00 ±	31.700	0,00
16	11/07/2024	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW345.00 ±	87	0,00
780	11/07/2024	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW367.50 ±	63.749	0,01
773	11/07/2024	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW372.50 ±	133.373	0,02
401	17/01/2025	Kraft Heinz Co, Strike Price \$25.00 ±	13.233	0,00
278	17/01/2025	Kraft Heinz Co, Strike Price \$30.00 ±	27.800	0,00
178	17/01/2025	Kraft Heinz Co, Strike Price \$37.50 ±	98.790	0,01
52	20/12/2024	Lear Corp, Strike Price \$115.00 ±	41.600	0,01
38	20/12/2024	Lear Corp, Strike Price \$135.00 ±	82.650	0,01
77	20/12/2024	Lear Corp, Strike Price \$95.00 ±	16.363	0,00
1.357	20/09/2024	Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$60.00 ±	0	0,00
1.670	20/12/2024	Lloyds Banking Group Plc, Strike Price GBP24.00 ±	0	0,00
37	17/01/2025	Lowe's Companies Inc, Strike Price \$120.00 ±	1.369	0,00
25	17/01/2025	Lowe's Companies Inc, Strike Price \$150.00 ±	1.987	0,00
17	17/01/2025	Lowe's Companies Inc, Strike Price \$185.00 ±	5.950	0,00
12	17/01/2025	Lowe's Companies Inc, Strike Price \$220.00 ±	16.620	0,00
62	17/01/2025	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$100.00 ±	57.040	0,01
85	17/01/2025	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$50.00 ±	7.650	0,00
51	17/01/2025	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$65.00 ±	3.697	0,00
128	17/01/2025	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$70.00 ±	9.280	0,00
34	17/01/2025	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$80.00 ±	4.590	0,00
86	17/01/2025	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$85.00 ±	19.135	0,00
24	17/01/2025	LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$95.00 ±	13.320	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones comprados 18,41% (31 de diciembre de 2023: 17,42%) (cont.)

Número de contratos/ Importe nominal	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de venta (cont.)				
127	20/12/2024	ManpowerGroup Inc, Strike Price \$55.00 [±]	11.113	0,00
92	20/12/2024	ManpowerGroup Inc, Strike Price \$65.00 [±]	26.680	0,00
69	20/12/2024	ManpowerGroup Inc, Strike Price \$75.00 [±]	57.270	0,01
12	20/12/2024	Martin Marietta Materials Inc, Strike Price \$510.00 [±]	22.560	0,00
9	20/12/2024	Martin Marietta Materials Inc, Strike Price \$600.00 [±]	59.175	0,01
29	17/01/2025	Mastercard Inc, Strike Price \$320.00 [±]	4.785	0,00
20	17/01/2025	Mastercard Inc, Strike Price \$390.00 [±]	14.250	0,00
14	17/01/2025	Mastercard Inc, Strike Price \$460.00 [±]	42.105	0,01
156	20/12/2024	Matador Resources Co, Strike Price \$45.00 [±]	11.310	0,00
104	20/12/2024	Matador Resources Co, Strike Price \$55.00 [±]	26.520	0,00
75	20/12/2024	Matador Resources Co, Strike Price \$65.00 [±]	55.125	0,01
16	17/01/2025	Meta Platforms Inc, Strike Price \$220.00 [±]	1.504	0,00
10	17/01/2025	Meta Platforms Inc, Strike Price \$280.00 [±]	1.950	0,00
8	17/01/2025	Meta Platforms Inc, Strike Price \$340.00 [±]	3.780	0,00
6	17/01/2025	Meta Platforms Inc, Strike Price \$400.00 [±]	7.335	0,00
71	16/10/2024	Metlife Inc, Strike Price \$71.00 [∞]	21.457	0,00
71	17/10/2024	Metlife Inc, Strike Price \$71.00 [∞]	21.537	0,00
71	18/10/2024	Metlife Inc, Strike Price \$71.00 [∞]	21.624	0,00
99	20/09/2024	Middleby Corp, Strike Price \$100.00 [±]	14.108	0,00
108	15/11/2024	Middleby Corp, Strike Price \$100.00 [±]	15.390	0,00
500	20/09/2024	Middleby Corp, Strike Price \$105.00 [±]	80.000	0,01
70	17/01/2025	Morgan Stanley, Strike Price \$50.00 [±]	770	0,00
49	17/01/2025	Morgan Stanley, Strike Price \$60.00 [±]	1.225	0,00
32	17/01/2025	Morgan Stanley, Strike Price \$75.00 [±]	2.800	0,00
24	17/01/2025	Morgan Stanley, Strike Price \$87.50 [±]	6.744	0,00
214	20/12/2024	Murphy Oil Corp, Strike Price \$32.50 [±]	13.375	0,00
141	20/12/2024	Murphy Oil Corp, Strike Price \$40.00 [±]	35.603	0,01
111	20/12/2024	Murphy Oil Corp, Strike Price \$45.00 [±]	58.275	0,01
90	20/09/2024	Nasdaq 100 E-mini, Strike Price \$18,500.00 [±]	369.900	0,04
32	17/01/2025	Netflix Inc, Strike Price \$310.00 [±]	3.488	0,00
14	17/01/2025	Netflix Inc, Strike Price \$380.00 [±]	3.444	0,00
8	17/01/2025	Netflix Inc, Strike Price \$400.00 [±]	2.360	0,00
11	17/01/2025	Netflix Inc, Strike Price \$440.00 [±]	5.142	0,00
6	17/01/2025	Netflix Inc, Strike Price \$480.00 [±]	4.680	0,00
6	17/01/2025	Netflix Inc, Strike Price \$570.00 [±]	14.295	0,00
34	19/07/2024	Netflix Inc, Strike Price \$680.00 [±]	107.185	0,01
8	12/07/2024	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY37,625.00 [±]	1.890	0,00
10	12/07/2024	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY37,750.00 [±]	2.797	0,00
56	12/07/2024	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY38,000.00 [±]	21.236	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones comprados 18,41% (31 de diciembre de 2023: 17,42%) (cont.)

Número de contratos/ Importe notional	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de venta (cont.)				
198	12/07/2024	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY38,750.00 ±	203.096	0,02
47	12/07/2024	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY39,000.00 ±	64.280	0,01
6.184	20/12/2024	NIO Inc, Strike Price \$3.00 ±	170.060	0,02
1.500	20/12/2024	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd, Strike Price \$12.00 ±	36.000	0,01
113	17/01/2025	NRG Energy Inc, Strike Price \$30.00 ±	13.277	0,00
71	17/01/2025	NRG Energy Inc, Strike Price \$38.00 ±	9.052	0,00
51	17/01/2025	NRG Energy Inc, Strike Price \$45.00 ±	3.060	0,00
34	17/01/2025	NRG Energy Inc, Strike Price \$55.00 ±	5.525	0,00
31	17/01/2025	Nucor Corp, Strike Price \$105.00 ±	3.953	0,00
21	17/01/2025	Nucor Corp, Strike Price \$130.00 ±	6.405	0,00
14	17/01/2025	Nucor Corp, Strike Price \$160.00 ±	17.220	0,00
11	17/01/2025	Nucor Corp, Strike Price \$190.00 ±	35.365	0,01
404	20/09/2024	Ocado Group Plc, Strike Price GBP280.00 ±	232.367	0,03
850	17/01/2025	ON Semiconductor Corp, Strike Price \$50.00 ±	136.425	0,02
172	17/01/2025	ONEOK Inc, Strike Price \$55.00 ±	4.300	0,00
123	17/01/2025	ONEOK Inc, Strike Price \$65.00 ±	8.303	0,00
86	17/01/2025	ONEOK Inc, Strike Price \$77.50 ±	26.660	0,00
730	20/09/2024	Ormat Technologies Inc, Strike Price \$45.00 ±	85.775	0,01
2.706	17/01/2025	Peabody Energy Corp, Strike Price \$18.00 ±	163.713	0,02
387	17/01/2025	PG&E Corp, Strike Price \$10.00 ±	0	0,00
873	17/01/2025	PG&E Corp, Strike Price \$12.00 ±	12.222	0,00
559	17/01/2025	PG&E Corp, Strike Price \$15.00 ±	20.683	0,00
435	17/01/2025	PG&E Corp, Strike Price \$17.00 ±	32.190	0,00
739	17/07/2024	POSCO Holdings Inc, Strike Price KRW341,600.00 ∞	1.207	0,00
23	17/01/2025	Prudential Financial Inc, Strike Price \$105.00 ±	6.037	0,00
77	17/01/2025	Prudential Financial Inc, Strike Price \$55.00 ±	9.047	0,00
44	17/01/2025	Prudential Financial Inc, Strike Price \$72.50 ±	6.160	0,00
31	17/01/2025	Prudential Financial Inc, Strike Price \$87.50 ±	3.797	0,00
210	17/01/2025	Range Resources Corp, Strike Price \$15.00 ±	4.200	0,00
150	17/01/2025	Range Resources Corp, Strike Price \$18.00 ±	2.625	0,00
240	17/01/2025	Range Resources Corp, Strike Price \$20.00 ±	18.600	0,00
155	17/01/2025	Range Resources Corp, Strike Price \$25.00 ±	9.300	0,00
107	17/01/2025	Range Resources Corp, Strike Price \$30.00 ±	16.852	0,00
35	20/12/2024	Reliance Inc, Strike Price \$220.00 ±	7.263	0,00
23	20/12/2024	Reliance Inc, Strike Price \$270.00 ±	25.070	0,00
16	20/12/2024	Reliance Inc, Strike Price \$320.00 ±	60.880	0,01
55	20/06/2025	Rheinmetall AG, Strike Price EUR300.00 ±	49.810	0,01
29	17/01/2025	Ross Stores Inc, Strike Price \$100.00 ±	1.740	0,00
62	17/01/2025	Ross Stores Inc, Strike Price \$115.00 ±	8.680	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones comprados 18,41% (31 de diciembre de 2023: 17,42%) (cont.)

Número de contratos/ Importe nominal	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de venta (cont.)				
21	17/01/2025	Ross Stores Inc, Strike Price \$120.00 [±]	3.990	0,00
46	17/01/2025	Ross Stores Inc, Strike Price \$135.00 [±]	25.990	0,00
15	17/01/2025	Ross Stores Inc, Strike Price \$140.00 [±]	9.450	0,00
46	17/01/2025	Ross Stores Inc, Strike Price \$80.00 [±]	5.405	0,00
92	17/01/2025	Ross Stores Inc, Strike Price \$95.00 [±]	12.420	0,00
63	20/12/2024	Ryder System Inc, Strike Price \$100.00 [±]	10.710	0,00
47	20/12/2024	Ryder System Inc, Strike Price \$120.00 [±]	33.370	0,00
63	20/09/2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$5,200.00 [±]	132.300	0,02
90	15/11/2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$5,200.00 [±]	319.500	0,04
180	15/11/2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$5,250.00 [±]	711.000	0,08
97	15/11/2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$5,350.00 [±]	478.938	0,05
209	15/11/2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$5,400.00 [±]	1.157.338	0,13
194	15/11/2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$5,450.00 [±]	1.207.650	0,14
428	15/11/2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$5,500.00 [±]	3.001.350	0,34
252	15/11/2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$5,550.00 [±]	1.990.800	0,22
55	15/11/2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$5,600.00 [±]	489.500	0,06
3	20/09/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$5,500.00 [±]	32.280	0,00
6	17/12/2027	S&P 500 Index, Strike Price \$5,800.00 [±]	304.380	0,04
24	17/12/2027	S&P 500 Index, Strike Price \$6,100.00 [±]	1.458.720	0,16
413	20/09/2024	Saipem SpA, Strike Price EUR1.00 [±]	0	0,00
399	20/12/2024	Saipem SpA, Strike Price EUR1.00 [±]	3.720	0,00
255	20/09/2024	Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price \$60.00 [±]	5.100	0,00
509	20/12/2024	Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price \$70.00 [±]	53.445	0,01
212	20/12/2024	SEI Investments Co, Strike Price \$45.00 [±]	3.710	0,00
142	20/12/2024	SEI Investments Co, Strike Price \$55.00 [±]	10.295	0,00
102	20/12/2024	SEI Investments Co, Strike Price \$65.00 [±]	32.640	0,00
336	20/12/2024	Semtech Corp, Strike Price \$22.00 [±]	52.920	0,01
20	19/07/2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price \$57.50 [±]	200	0,00
49	19/07/2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price \$65.00 [±]	2.940	0,00
814	16/08/2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price \$65.00 [±]	164.835	0,02
994	19/07/2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price \$67.50 [±]	79.520	0,01
227	16/08/2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price \$67.50 [±]	62.993	0,01
2.090	19/07/2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price \$67.88 [∞]	219.303	0,03
7.007	19/07/2024	Sibanye Stillwater Ltd, Strike Price \$2.50 [±]	0	0,00
1.003	18/10/2024	Sibanye Stillwater Ltd, Strike Price \$2.50 [±]	7.523	0,00
2.025	17/01/2025	Sibanye Stillwater Ltd, Strike Price \$2.50 [±]	20.250	0,00
930	20/09/2024	Siemens Energy AG, Strike Price EUR5.20 [±]	997	0,00
21	17/01/2025	Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$105.00 [±]	17.955	0,00
61	17/01/2025	Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$60.00 [±]	3.660	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones comprados 18,41% (31 de diciembre de 2023: 17,42%) (cont.)

Número de contratos/ Importe notional	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de venta (cont.)				
38	17/01/2025	Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$75.00 [±]	4.085	0,00
28	17/01/2025	Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$90.00 [±]	9.520	0,00
655	20/12/2024	Société Générale SA, Strike Price EUR15.00 [±]	18.954	0,00
2.020	20/06/2025	Société Générale SA, Strike Price EUR15.00 [±]	120.154	0,01
70	21/03/2025	Société Générale SA, Strike Price EUR16.00 [±]	3.489	0,00
939	20/09/2024	Standard Chartered Plc, Strike Price GBP480.00 [±]	5.935	0,00
88	17/01/2025	State Street Corp, Strike Price \$40.00 [±]	3.520	0,00
56	17/01/2025	State Street Corp, Strike Price \$50.00 [±]	2.800	0,00
37	17/01/2025	State Street Corp, Strike Price \$62.50 [±]	6.105	0,00
26	17/01/2025	State Street Corp, Strike Price \$75.00 [±]	13.000	0,00
380	17/12/2027	Stoxx Europe 600 Index, Strike Price EUR500.00 [±]	802.312	0,09
114	17/12/2027	Swiss Market Index, Strike Price CHF11,200.00 [±]	1.178.694	0,13
278	20/09/2024	Swiss Prime Site AG, Strike Price CHF64.00 [±]	6.342	0,00
59	17/01/2025	T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$110.00 [±]	34.515	0,01
61	17/01/2025	T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$60.00 [±]	3.202	0,00
122	17/01/2025	T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$75.00 [±]	7.015	0,00
76	17/01/2025	T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$95.00 [±]	15.770	0,00
24	17/01/2025	Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$115.00 [±]	3.384	0,00
18	17/01/2025	Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$140.00 [±]	9.675	0,00
13	17/01/2025	Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$165.00 [±]	21.255	0,00
39	17/01/2025	Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$90.00 [±]	3.510	0,00
263	17/01/2025	Tanger Inc, Strike Price \$15.00 [±]	0	0,00
149	17/01/2025	Tanger Inc, Strike Price \$20.00 [±]	3.352	0,00
123	17/01/2025	Tanger Inc, Strike Price \$22.00 [±]	0	0,00
82	17/01/2025	Tanger Inc, Strike Price \$27.00 [±]	22.140	0,00
52	17/01/2025	Targa Resources Corp, Strike Price \$115.00 [±]	18.200	0,00
69	17/01/2025	Targa Resources Corp, Strike Price \$47.50 [±]	0	0,00
44	17/01/2025	Targa Resources Corp, Strike Price \$60.00 [±]	3.300	0,00
31	17/01/2025	Targa Resources Corp, Strike Price \$72.50 [±]	1.550	0,00
110	17/01/2025	Targa Resources Corp, Strike Price \$80.00 [±]	6.600	0,00
22	17/01/2025	Targa Resources Corp, Strike Price \$85.00 [±]	1.210	0,00
73	17/01/2025	Targa Resources Corp, Strike Price \$97.50 [±]	7.665	0,00
47	20/12/2024	TD SYNEX Corp, Strike Price \$115.00 [±]	29.375	0,00
69	20/12/2024	TD SYNEX Corp, Strike Price \$95.00 [±]	8.798	0,00
104	20/12/2024	Tenet Healthcare Corp, Strike Price \$65.00 [±]	9.360	0,00
68	20/12/2024	Tenet Healthcare Corp, Strike Price \$80.00 [±]	8.160	0,00
48	20/12/2024	Tenet Healthcare Corp, Strike Price \$95.00 [±]	11.040	0,00
250	20/09/2024	Tetra Tech Inc, Strike Price \$125.00 [±]	63.125	0,01
74	20/12/2024	Texas Roadhouse Inc, Strike Price \$105.00 [±]	10.360	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones comprados 18,41% (31 de diciembre de 2023: 17,42%) (cont.)

Número de contratos/ Importe notional	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de venta (cont.)				
48	20/12/2024	Texas Roadhouse Inc, Strike Price \$130.00 [±]	7.560	0,00
36	20/12/2024	Texas Roadhouse Inc, Strike Price \$150.00 [±]	14.580	0,00
15	17/01/2025	Thor Industries Inc, Strike Price \$115.00 [±]	35.025	0,01
46	17/01/2025	Thor Industries Inc, Strike Price \$65.00 [±]	5.865	0,00
32	17/01/2025	Thor Industries Inc, Strike Price \$80.00 [±]	12.320	0,00
22	17/01/2025	Thor Industries Inc, Strike Price \$95.00 [±]	21.010	0,00
128	20/12/2024	Trip.com Group Ltd, Strike Price \$35.00 [±]	18.240	0,00
1.344	17/01/2025	Trip.com Group Ltd, Strike Price \$35.00 [±]	100.800	0,01
1.000.000 USD	23/08/2024	United States Dollar/Turkish Lira Currency Option, Strike Price TRY33.50 [∞]	284.846	0,03
148	17/01/2025	Unum Group, Strike Price \$25.00 [±]	9.250	0,00
116	17/01/2025	Unum Group, Strike Price \$27.50 [±]	6.090	0,00
171	17/01/2025	Unum Group, Strike Price \$32.50 [±]	15.390	0,00
112	17/01/2025	Unum Group, Strike Price \$40.00 [±]	4.480	0,00
80	17/01/2025	Unum Group, Strike Price \$47.50 [±]	15.800	0,00
307	17/01/2025	Viatris Inc, Strike Price \$10.00 [±]	20.722	0,00
214	17/01/2025	Viatris Inc, Strike Price \$12.00 [±]	39.055	0,01
625	17/01/2025	Viatris Inc, Strike Price \$7.00 [±]	6.250	0,00
4.000	19/07/2024	Virgin Galactic Holdings Inc, Strike Price \$0.50 [±]	36.000	0,01
6.694	18/10/2024	Virgin Galactic Holdings Inc, Strike Price \$0.50 [±]	164.003	0,02
1.850	19/07/2024	Vishay Intertechnology Inc, Strike Price \$15.00 [±]	0	0,00
725	17/01/2025	Wayfair Inc, Strike Price \$35.00 [±]	157.325	0,02
30	20/12/2024	Webuild SpA, Strike Price EUR1.45 [±]	2.219	0,00
47	20/12/2024	Webuild SpA, Strike Price EUR1.50 [±]	3.904	0,00
3	21/03/2025	Webuild SpA, Strike Price EUR1.50 [±]	338	0,00
18	20/12/2024	Webuild SpA, Strike Price EUR1.60 [±]	1.756	0,00
30	21/03/2025	Webuild SpA, Strike Price EUR1.60 [±]	4.051	0,00
325	18/10/2024	WEC Energy Group Inc, Strike Price \$55.00 [±]	4.875	0,00
104	17/01/2025	WEC Energy Group Inc, Strike Price \$55.00 [±]	2.600	0,00
134	17/01/2025	Western Digital Corp, Strike Price \$27.50 [±]	9.313	0,00
98	17/01/2025	Western Digital Corp, Strike Price \$32.50 [±]	2.891	0,00
83	17/01/2025	Western Digital Corp, Strike Price \$35.00 [±]	2.739	0,00
115	17/01/2025	Western Digital Corp, Strike Price \$42.50 [±]	5.577	0,00
84	17/01/2025	Western Digital Corp, Strike Price \$50.00 [±]	7.728	0,00
29	17/01/2025	Western Digital Corp, Strike Price \$60.00 [±]	6.380	0,00
22	17/01/2025	Wingstop Inc, Strike Price \$150.00 [±]	2.640	0,00
14	17/01/2025	Wingstop Inc, Strike Price \$190.00 [±]	2.310	0,00
10	17/01/2025	Wingstop Inc, Strike Price \$230.00 [±]	1.925	0,00
8	17/01/2025	Wingstop Inc, Strike Price \$270.00 [±]	4.520	0,00
91	17/01/2025	Winnebago Industries Inc, Strike Price \$35.00 [±]	5.687	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones comprados 18,41% (31 de diciembre de 2023: 17,42%) (cont.)

Número de contratos/ Importe nominal	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de venta (cont.)				
86	17/01/2025	Winnebago Industries Inc, Strike Price \$40.00 ±	10.320	0,00
56	17/01/2025	Winnebago Industries Inc, Strike Price \$45.00 ±	12.040	0,00
56	17/01/2025	Winnebago Industries Inc, Strike Price \$50.00 ±	20.440	0,00
37	17/01/2025	Winnebago Industries Inc, Strike Price \$55.00 ±	20.720	0,00
39	17/01/2025	Winnebago Industries Inc, Strike Price \$60.00 ±	37.245	0,01
27	17/01/2025	Winnebago Industries Inc, Strike Price \$65.00 ±	30.780	0,00
29	17/01/2025	Winnebago Industries Inc, Strike Price \$70.00 ±	47.125	0,01
615	20/09/2024	Wolfspeed Inc, Strike Price \$17.50 ±	70.725	0,01
70	17/01/2025	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$52.50 ±	2.940	0,00
44	17/01/2025	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$67.50 ±	4.752	0,00
31	17/01/2025	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$80.00 ±	10.152	0,00
22	17/01/2025	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price \$95.00 ±	21.230	0,00
23.950	20/03/2025	Xero Ltd, Strike Price AUD89.74 ∞	26.386	0,00
390	17/01/2025	Xerox Holdings Corp, Strike Price \$8.00 ±	12.675	0,00
1.190	17/01/2025	Xerox Holdings Corp, Strike Price \$9.00 ±	59.500	0,01
Total valor razonable en contratos de opciones adquiridos (Prima: USD (175.133.468))			164.355.563	18,41

Las contrapartes en los contratos de opciones extrabursátiles (OTC) son Bank of America Merrill Lynch, BNP Paribas, Citibank, Daiwa, Goldman Sachs International, JPMorgan Chase Bank, Morgan Stanley, Nomura y SMBC Nikko Capital Markets Ltd.

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patri- monio neto
66.558	10X Genomics Inc Class A	Morgan Stanley	21.134	0,00
(488.894)	3M Co	Goldman Sachs International	30.717	0,01
58.485	Abbott Laboratories	Goldman Sachs International	4.663	0,00
(40.023)	AbbVie Inc	Morgan Stanley	5.506	0,00
(95.798)	AbbVie Inc	Goldman Sachs International	3.103	0,00
254.970	ABN AMRO Bank NV	Goldman Sachs International	3.623	0,00
499.321	Acadia Healthcare Co Inc	Goldman Sachs International	4.862	0,00
51.775	Acadia Healthcare Co Inc	Morgan Stanley	7.459	0,00
88.967	ACADIA Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	3.598	0,00
52.999	Accenture Plc Class A	Goldman Sachs International	380	0,00
(68.466)	Acuity Brands Inc	Morgan Stanley	20.738	0,00
287.156	Acushnet Holdings Corp	Morgan Stanley	5.559	0,00
49.031	Admiral Group Plc	Goldman Sachs International	1.914	0,00
(256.507)	Adobe Inc	Morgan Stanley	10.781	0,00
267.580	Advance Auto Parts Inc	Morgan Stanley	3.987	0,00
348.173	Advanced Energy Industries	Nomura	0	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
300	Advanced Micro Devices Inc	Goldman Sachs International	1.061	0,00
(4.300)	AES Corp	Goldman Sachs International	3.759	0,00
(78.636)	Affiliated Managers Group Inc	Morgan Stanley	10.776	0,00
46.886	Affirm Holdings Inc	Morgan Stanley	4.532	0,00
93.163	AGCO Corp	Goldman Sachs International	12.462	0,00
23.797	Agilent Technologies Inc	Goldman Sachs International	2.082	0,00
40.158	AGNC Investment Corp	Morgan Stanley	191	0,00
327.121	AIB Group Plc	Goldman Sachs International	1.256	0,00
(130.276)	Airbnb Inc Class A	Morgan Stanley	4.839	0,00
(70.546)	Airbnb Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	4.167	0,00
(112.972)	Airbnb Inc Class A	Goldman Sachs International	3.766	0,00
(1.869.433)	Akamai Technologies Inc	Nomura	0	0,00
(188.736)	Akero Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	8.396	0,00
(131.261)	Akero Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	1.949	0,00
95.326	Albemarle Corp	Morgan Stanley	20.844	0,00
(600)	Albemarle Corp	Goldman Sachs International	509	0,00
(15.889)	Albertsons Cos Inc Class A	Morgan Stanley	180	0,00
(100.954)	Alcon Inc	JPMorgan Chase Bank	7.561	0,00
(8.286)	Alcon Inc	Morgan Stanley	874	0,00
(46.563)	Alcon Inc	Goldman Sachs International	4.875	0,00
4.773.188	Alibaba Group Holding Ltd	Nomura	0	0,00
(18.120)	Alibaba Group Holding Ltd	Morgan Stanley	1.050	0,00
111.997	Align Technology Inc	Goldman Sachs International	5.968	0,00
40.937	Alkermes Plc	Goldman Sachs International	166	0,00
(29.895)	Allegion Plc	Morgan Stanley	681	0,00
(35)	Allego NV	Goldman Sachs International	0	0,00
43.294	Allegro MicroSystems Inc	Morgan Stanley	2.434	0,00
(583.500)	Allegro.eu SA	Goldman Sachs International	15.911	0,00
69.780	Allianz SE	JPMorgan Chase Bank	33	0,00
415.198	Allianz SE	Goldman Sachs International	11.415	0,00
(73.629)	Allison Transmission Holdings Inc	Morgan Stanley	17.449	0,00
12.862	Allurion Techno	Goldman Sachs International	0	0,00
(129.108)	Ally Financial Inc	Morgan Stanley	3.143	0,00
58.009	Alphabet Inc Class A	Goldman Sachs International	585	0,00
62.518	Alphabet Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	565	0,00
(406.257)	Alphabet Inc Class C	Morgan Stanley	110.904	0,01
(35.466)	Amazon.com Inc	JPMorgan Chase Bank	1.830	0,00
(1.212.588)	Amazon.com Inc	Morgan Stanley	390.200	0,05
(628.440)	Amazon.com Inc	Goldman Sachs International	29.824	0,00
4.200.854	American Airlines Group Inc	Nomura	6.456	0,00
(30)	American Axle & Manufacturing Holdings Inc	Goldman Sachs International	5	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
358.346	American Eagle Outfitters Inc	Morgan Stanley	36.974	0,01
114.161	American Express Co	Goldman Sachs International	1.883	0,00
79.651	American Express Co	Morgan Stanley	802	0,00
78.272	American Tower Corp	Morgan Stanley	146	0,00
(39.341)	American Tower Corp	JPMorgan Chase Bank	2.429	0,00
(86.298)	American Tower Corp	Goldman Sachs International	8.265	0,00
45.492	Americold Realty Trust Inc	Morgan Stanley	1.172	0,00
(108.992)	Ameriprise Financial Inc	Morgan Stanley	23.979	0,00
7.315	AMETEK Inc	Morgan Stanley	24	0,00
(44.531)	Amgen Inc	Morgan Stanley	7	0,00
26.684	Amicus Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	5.428	0,00
2.104	Amicus Therapeutics Inc	Morgan Stanley	221	0,00
8.774	Amicus Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	282	0,00
93.649	AMN Healthcare Services Inc	Goldman Sachs International	9.263	0,00
(1.700)	Amphenol Corp Class A	Goldman Sachs International	2.404	0,00
(200.823)	Analog Devices Inc	Morgan Stanley	24.164	0,00
192.263	Anheuser-Busch InBev SA	JPMorgan Chase Bank	10.298	0,00
420.719	Anheuser-Busch InBev SA	Goldman Sachs International	11.182	0,00
(609.186)	Antero Resources Corp	JPMorgan Chase Bank	257.634	0,03
(207.510)	Antero Resources Corp	Goldman Sachs International	62.578	0,01
(90.212)	APA Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
44.385	Apellis Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	3.251	0,00
(528.884)	Apple Inc	Morgan Stanley	75.032	0,01
4.843	Apple Inc	JPMorgan Chase Bank	22	0,00
957.125	Apple Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(223.145)	Applied Materials Inc	Morgan Stanley	49.913	0,01
(757.550)	ARC Resources Ltd	Goldman Sachs International	62.272	0,01
(104.064)	ArcBest Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.605)	Arcellx Inc	Goldman Sachs International	287	0,00
(33.878)	Arcellx Inc	JPMorgan Chase Bank	424	0,00
(300)	Arch Capital Group Ltd	Goldman Sachs International	206	0,00
(1.300)	Archer-Daniels-Midland Co	Goldman Sachs International	60	0,00
100	Arista Networks Inc	Goldman Sachs International	295	0,00
22.557	Arqit Quantum Inc	Goldman Sachs International	308	0,00
5.424	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	1.500	0,00
27.254	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	7.736	0,00
600	ASGN Inc	JPMorgan Chase Bank	77	0,00
206.027	ASGN Inc	Goldman Sachs International	17.130	0,00
(96.335)	ASML Holding NV	Morgan Stanley	14.012	0,00
6.476.494	Astellas Pharma Inc	JPMorgan Chase Bank	1.802	0,00
5.524.562	Astellas Pharma Inc	Goldman Sachs International	6.732	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(11)	Astrana Health Inc	Goldman Sachs International	2	0,00
(43.730)	AstraZeneca Plc	Goldman Sachs International	7.263	0,00
(198.834)	AstraZeneca Plc	JPMorgan Chase Bank	5.862	0,00
(124.517)	AstraZeneca Plc	Morgan Stanley	27.378	0,01
(290.533)	AT&T Inc	Morgan Stanley	43.596	0,01
20.725	Atlassian Corp Class A	Morgan Stanley	4.895	0,00
147.377	Autodesk Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(130.085)	Autodesk Inc	Morgan Stanley	5.216	0,00
151.009	Automatic Data Processing Inc	Goldman Sachs International	5.068	0,00
(133.762)	Automatic Data Processing Inc	Morgan Stanley	1.483	0,00
26.614	Automatic Data Processing Inc	JPMorgan Chase Bank	468	0,00
(144.276)	Avidity Biosciences Inc	JPMorgan Chase Bank	170.419	0,02
27.275	Avis Budget Group Inc	Morgan Stanley	670	0,00
117.838	Aviva Plc	Goldman Sachs International	2.319	0,00
(104.872)	AXA SA	Morgan Stanley	1.809	0,00
(87.741)	Axalta Coating Systems Ltd	Morgan Stanley	1.088	0,00
182.395	Axon Enterprise Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(657.551)	Axsome Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	69.397	0,01
(85.164)	Axsome Therapeutics Inc	Morgan Stanley	457	0,00
728.812	B3 SA - Brasil Bolsa Balca	Goldman Sachs International	10.773	0,00
759.445	B3 SA - Brasil Bolsa Balca	Morgan Stanley	2.647	0,00
(883.790)	Baker Hughes Co	Goldman Sachs International	25.439	0,00
(112.870)	Baker Hughes Co	JPMorgan Chase Bank	7.784	0,00
(222.333)	Baker Hughes Co	Morgan Stanley	34.352	0,00
197.762	Banco Bilbao Vizcaya Argentina SA	Goldman Sachs International	8.209	0,00
205.548	Banco BPM SpA	Goldman Sachs International	12.527	0,00
1.800.000	Banco BPM SpA	Société Générale	2.136	0,00
471.406	Banco BTG Pactual SA	Morgan Stanley	2.482	0,00
(647.916)	Banco Do Brasil SA	Morgan Stanley	2.773	0,00
(155.748)	Bank Of Ireland Group Plc	Goldman Sachs International	1.962	0,00
(39.389)	Bank Of Ireland Group Plc	JPMorgan Chase Bank	7	0,00
(90.443)	Bank OZK	Morgan Stanley	357	0,00
(2.570.217)	Bank Polska Kasa Opieki SA	JPMorgan Chase Bank	21.437	0,00
(21.545)	Barclays Plc	JPMorgan Chase Bank	579	0,00
(131.970)	Bath & Body Works Inc	Morgan Stanley	596	0,00
(900)	Bath & Body Works Inc	Goldman Sachs International	2.119	0,00
(130.653)	Baxter International Inc	Morgan Stanley	88	0,00
209.521	Baxter International Inc	Goldman Sachs International	2.749	0,00
24.894	Beam Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	3.406	0,00
725	Beam Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	7	0,00
9.115	Beauty Health Co	JPMorgan Chase Bank	6.236	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
42.831	Beauty Health Co	Goldman Sachs International	30.806	0,01
(172.950)	Beazley Plc	Goldman Sachs International	15.997	0,00
(493.932)	BellRing Brands Inc	JPMorgan Chase Bank	81.784	0,01
(1.536.162)	BellRing Brands Inc	Goldman Sachs International	838.617	0,10
220.580	Best Buy Co Inc	JPMorgan Chase Bank	4.859	0,00
(133.327)	Best Buy Co Inc	Morgan Stanley	770	0,00
759.264	Best Buy Co Inc	Goldman Sachs International	21.814	0,00
(18.541)	Bill.com Holdings Inc	Goldman Sachs International	455	0,00
(48.363)	Bill.com Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	1.709	0,00
(44.517)	Biogen Inc	Morgan Stanley	1.185	0,00
(1.114.329)	Biogen Inc	Goldman Sachs International	7.918	0,00
(114.848)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs International	5.927	0,00
(40.299)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Morgan Stanley	3.863	0,00
87.296	Bio-Rad Laboratories Inc Class A	Morgan Stanley	9.744	0,00
(600)	Bio-Techne Corp	Goldman Sachs International	1.063	0,00
44.150	Birkenstock Holding Plc	Morgan Stanley	194	0,00
365.639	BlackRock Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
76.997	Block Inc	Goldman Sachs International	7.667	0,00
(181.491)	Blueprint Medicines Corp	JPMorgan Chase Bank	63.782	0,01
(71.856)	Blueprint Medicines Corp	Goldman Sachs International	10.151	0,00
500	Boeing Co	Goldman Sachs International	837	0,00
(105.756)	Booking Holdings Inc	Morgan Stanley	24.940	0,00
75.620	Booking Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	371	0,00
348.685	BorgWarner Inc	JPMorgan Chase Bank	4.576	0,00
250.392	BorgWarner Inc	Goldman Sachs International	32.618	0,01
(88.951)	Boston Beer Co Inc Class A	Morgan Stanley	1.048	0,00
(163.360)	Boston Scientific Corp	Goldman Sachs International	70.142	0,01
(1.079.511)	Boyd Gaming Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
12.698	Bridgebio Pharma Inc	Goldman Sachs International	4.523	0,00
54.573	Bridgebio Pharma Inc	JPMorgan Chase Bank	5.256	0,00
43.831	Brighthouse Financial Inc	Morgan Stanley	136	0,00
(92.085)	BrightSpring Health Services Inc	JPMorgan Chase Bank	4.139	0,00
478.709	Brink's Co	Goldman Sachs International	0	0,00
107.393	Bristol-Myers Squibb Co	Goldman Sachs International	15.552	0,00
(83.615)	Brixmor Property Group Inc	Morgan Stanley	4.834	0,00
(157.771)	Broadcom Inc	Morgan Stanley	20.332	0,00
78.079	Broadridge Financial Solutions Inc	Morgan Stanley	855	0,00
(500)	Broadridge Financial Solutions Inc	Goldman Sachs International	195	0,00
(47)	Brookline Bancorp Inc	Goldman Sachs International	1	0,00
(400)	Brown & Brown Inc	Goldman Sachs International	398	0,00
89.615	Brown-Forman Corp Class B	Morgan Stanley	12.744	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(500)	Builders FirstSource Inc	Goldman Sachs International	206	0,00
(134.511)	Builders FirstSource Inc	Morgan Stanley	1.662	0,00
134.751	Bunge Global SA	Goldman Sachs International	0	0,00
296.959	Burberry Group Plc	Goldman Sachs International	61.507	0,01
(109.578)	Cadence Design Systems Inc	Morgan Stanley	24.165	0,00
291.402	CaixaBank SA	Goldman Sachs International	6.832	0,00
(354.613)	Campbell Soup Co	JPMorgan Chase Bank	1.956	0,00
(19.842)	Campbell Soup Co	Morgan Stanley	43	0,00
(728.365)	Campbell Soup Co	Goldman Sachs International	8.769	0,00
505.056	Canadian Natural Resources	Goldman Sachs International	50.917	0,01
191.238	Canadian Pacific Kansas City Ltd	JPMorgan Chase Bank	9.253	0,00
82.254	Capital One Financial Corp	Morgan Stanley	1.158	0,00
(7.917.775)	Capitec Bank Holdings Ltd	Goldman Sachs International	108.689	0,01
(619.932)	Capstone Copper Corp	JPMorgan Chase Bank	17.697	0,00
(96.537)	Capstone Copper Corp	Goldman Sachs International	2.313	0,00
57.811	Cardinal Health Inc	Goldman Sachs International	3.020	0,00
(290.156)	CarMax Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
3.600	Carnival Corp	Goldman Sachs International	35	0,00
4.824.075	Carnival Corp	Nomura	0	0,00
(1.500)	Carrier Global Corp	Goldman Sachs International	1.634	0,00
5	Cars.com Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	Cboe Global Markets Inc	Goldman Sachs International	185	0,00
3.574	CDW Corp	JPMorgan Chase Bank	9	0,00
1.269.920	CDW Corp	Goldman Sachs International	1.614	0,00
70.411	CDW Corp	Morgan Stanley	217	0,00
440.946	Celsius Holdings Inc	Goldman Sachs International	112.820	0,01
78.437	Cencora Inc	Morgan Stanley	829	0,00
(409.840)	Cenovus Energy Inc	JPMorgan Chase Bank	93.980	0,01
575.141	Centene Corp	Goldman Sachs International	14.214	0,00
(1.009.196)	CenterPoint Energy Inc	Goldman Sachs International	2.629	0,00
(469.139)	CenterPoint Energy Inc	Morgan Stanley	3.046	0,00
93.772	Ceridian HCM Holding Inc	Morgan Stanley	17.081	0,00
78.972	CF Industries Holdings Inc	Morgan Stanley	2.634	0,00
755.540	Charles Schwab Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
104.936	Charter Communications Inc Class A	Morgan Stanley	12.270	0,00
(368.976)	Chemours Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(886.072)	Cheniere Energy Inc	Goldman Sachs International	27.231	0,00
(175.290)	Cheniere Energy Inc	JPMorgan Chase Bank	10.534	0,00
83.746	Chesapeake Energy Corp	Morgan Stanley	5.966	0,00
957.006	Chesapeake Energy Corp	Goldman Sachs International	57.583	0,01
167.620	Chesapeake Energy Corp	JPMorgan Chase Bank	13.196	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
45.229	Chevron Corp	Morgan Stanley	468	0,00
(1.379.994)	Chevron Corp	JPMorgan Chase Bank	18.787	0,00
(175.585)	Chewy Inc Class A	Goldman Sachs International	5.969	0,00
1.286.204	Chipotle Mexican Grill Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
79.001	Chubb Ltd	Morgan Stanley	2.777	0,00
(127.159)	Church & Dwight Co Inc	JPMorgan Chase Bank	21.214	0,00
(354.202)	Church & Dwight Co Inc	Goldman Sachs International	55.870	0,01
12.953	Ciena Corp	Morgan Stanley	214	0,00
315.690	Cigna Group	Goldman Sachs International	3.257	0,00
78.028	Cigna Group	Morgan Stanley	579	0,00
100	Cincinnati Financial Corp	Goldman Sachs International	151	0,00
206.881	Cintas Corp	Goldman Sachs International	822	0,00
(128.090)	Cintas Corp	Morgan Stanley	4.770	0,00
(59.394)	Cirrus Logic Inc	Morgan Stanley	30.914	0,01
4.615	Cisco Systems Inc	Morgan Stanley	429	0,00
(133.974)	Citigroup Inc	Morgan Stanley	3.438	0,00
42.536	Clarivate Plc	Morgan Stanley	5.546	0,00
(237.809)	Cleveland-Cliffs Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(131.553)	Clorox Co	Morgan Stanley	2.020	0,00
(462.548)	Clorox Co	JPMorgan Chase Bank	760	0,00
375.631	Clorox Co	Goldman Sachs International	4.715	0,00
(86.565)	Cloudflare Inc Class A	Goldman Sachs International	12.940	0,00
(24.837)	Cloudflare Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	2.248	0,00
(17.805)	Cloudflare Inc Class A	Morgan Stanley	606	0,00
(200)	CME Group Inc Class A	Goldman Sachs International	160	0,00
(200)	CMS Energy Corp	Goldman Sachs International	84	0,00
73.533	CNH Industrial NV	Morgan Stanley	2.876	0,00
(129.661)	Coca-Cola Co	Morgan Stanley	2.844	0,00
14.387	Cognizant Technology Solutions Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	116	0,00
(23.402)	Cognizant Technology Solutions Corp Class A	Morgan Stanley	2.325	0,00
330.814	Cognizant Technology Solutions Corp Class A	Goldman Sachs International	20.269	0,00
67.269	Coinbase Global Inc Class A	Goldman Sachs International	4.440	0,00
(81.635)	Columbia Banking System Inc	Morgan Stanley	7.790	0,00
18.919	Comcast Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	1.823	0,00
(133.557)	Comcast Corp Class A	Morgan Stanley	1.606	0,00
(72.558)	Commerzbank AG	Goldman Sachs International	351	0,00
(257.902)	Commerzbank AG	JPMorgan Chase Bank	996	0,00
497.495	Comstock Resources Inc	JPMorgan Chase Bank	15.363	0,00
400	Conagra Brands Inc	Goldman Sachs International	37	0,00
482.671	Confluent Inc Class A	Nomura	0	0,00
1.462.253	CONMED Corp	Nomura	0	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(482.885)	ConocoPhillips	Goldman Sachs International	0	0,00
42	Consolidated Communications Holdings Inc	Goldman Sachs International	1	0,00
134.930	Consolidated Edison Inc	JPMorgan Chase Bank	2	0,00
755.625	Consolidated Edison Inc	Goldman Sachs International	15.196	0,00
(681.887)	Constellation Brands Inc Class A	Goldman Sachs International	35.696	0,01
(1.397.625)	Constellation Brands Inc Class A	Morgan Stanley	41.387	0,01
1.366.274	Constellation Energy Corp	JPMorgan Chase Bank	20.404	0,00
32.463	Constellation Energy Corp	Goldman Sachs International	3.525	0,00
(84.469)	Cooper Cos Inc	JPMorgan Chase Bank	5.455	0,00
(1.400)	Copart Inc	Goldman Sachs International	400	0,00
52.117	Core & Main Inc Class A	Morgan Stanley	5.951	0,00
(130.644)	Corebridge Financial Inc	Morgan Stanley	367	0,00
1.071.571	Corning Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
664.523	Coterra Energy Inc	JPMorgan Chase Bank	27.394	0,01
618.873	Coterra Energy Inc	Goldman Sachs International	22.174	0,00
(22.535)	Coty Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	214	0,00
41.539	Coty Inc Class A	Morgan Stanley	769	0,00
(98.718)	Coupang Inc	JPMorgan Chase Bank	1.231	0,00
317.563	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Morgan Stanley	126.086	0,02
269.779	Credit Agricole SA	JPMorgan Chase Bank	4.192	0,00
322.425	CRISPR Therapeutics AG	Goldman Sachs International	38.822	0,01
156.216	CRISPR Therapeutics AG	JPMorgan Chase Bank	17.118	0,00
(411.191)	Crocs Inc	Morgan Stanley	149.292	0,02
309.157	Crocs Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
84.880	Cross Country Healthcare Inc	Goldman Sachs International	18.022	0,00
500	Crown Castle Inc	Goldman Sachs International	589	0,00
(181.331)	CSX Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(76.412)	Cullinan Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	198	0,00
(75.098)	Curtiss-Wright Corp	Morgan Stanley	13.455	0,00
380.848	CVS Health Corp	Goldman Sachs International	6.477	0,00
1.279	Danaher Corp	Goldman Sachs International	35	0,00
(834.089)	Danske Bank A/S	JPMorgan Chase Bank	25	0,00
(1.705.486)	Danske Bank A/S	Goldman Sachs International	9.304	0,00
78.061	Darden Restaurants Inc	Morgan Stanley	45	0,00
(138.745)	Darden Restaurants Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
195.791	Darling Ingredients Inc	Goldman Sachs International	34.916	0,01
29.205	Datadog Inc Class A	Morgan Stanley	250	0,00
80.725	Davita Healthcare Partner Inc	Morgan Stanley	3.824	0,00
90.977	Davita Healthcare Partner Inc	Goldman Sachs International	1.969	0,00
39.075	Dayforce Inc	JPMorgan Chase Bank	6.319	0,00
536	Dayforce Inc	Goldman Sachs International	261	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(100)	Deckers Outdoor Corp	Goldman Sachs International	834	0,00
(700)	Deere & Co	Goldman Sachs International	1.118	0,00
83.149	Deere & Co	Morgan Stanley	5.269	0,00
305.957	DENTSPLY SIRONA Inc	Goldman Sachs International	25.398	0,00
600.000	Deutsche Bank AG	Société Générale	2.284	0,00
46.446.175	Deutsche Telekom AG	Société Générale	21.515	0,00
223.277	Devon Energy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
647.004	Dexcom Inc	Goldman Sachs International	18.463	0,00
(17.929)	Dexcom Inc	JPMorgan Chase Bank	5.446	0,00
(118.689)	Dexcom Inc	Morgan Stanley	13.694	0,00
585.916	Diageo Plc	JPMorgan Chase Bank	70.141	0,02
874.760	Diageo Plc	Goldman Sachs International	120.651	0,02
(42.029)	Diamondback Energy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
129.165	Dick's Sporting Goods Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.387.173)	Discovery Ltd	Goldman Sachs International	11.302	0,00
30	Diversified Energy Co Plc	Goldman Sachs International	0	0,00
(56.711)	DocuSign Inc	JPMorgan Chase Bank	3.034	0,00
(52.714)	DocuSign Inc	Goldman Sachs International	1.991	0,00
(133.534)	DocuSign Inc	Morgan Stanley	17.876	0,00
(253.466)	Dollar General Corp	Goldman Sachs International	13.324	0,00
(138.924)	Dollar General Corp	JPMorgan Chase Bank	7.660	0,00
40.170	Dollar Tree Inc	Morgan Stanley	929	0,00
(100)	Domino's Pizza Inc	Goldman Sachs International	1.583	0,00
(78.631)	Donaldson Co Inc	Morgan Stanley	10.557	0,00
22.231	DoorDash Inc Class A	Morgan Stanley	2.831	0,00
13.375	DoorDash Inc Class A	Goldman Sachs International	11	0,00
70.231	DoorDash Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	1.791	0,00
(130.066)	DoubleVerify Holdings Inc	Goldman Sachs International	5.541	0,00
(67.267)	DoubleVerify Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	2.642	0,00
3.265	Doximity Inc Class A	Goldman Sachs International	2	0,00
(67.653)	Doximity Inc Class A	Morgan Stanley	716	0,00
976.379	DR Horton Inc	Goldman Sachs International	1.906	0,00
(86.653)	Dropbox Inc Class A	Morgan Stanley	279	0,00
(132.314)	DTE Energy Co	Morgan Stanley	1.348	0,00
35.591	Dynatrace Inc	JPMorgan Chase Bank	643	0,00
78.506	Dynatrace Inc	Morgan Stanley	1.042	0,00
78.841	Dynatrace Inc	Goldman Sachs International	2.471	0,00
(299.780)	Dyne Therapeutics Inc	Morgan Stanley	157.751	0,02
(85.905)	EastGroup Properties Inc	Morgan Stanley	4.394	0,00
62.199	eBay Inc	Goldman Sachs International	42	0,00
(300)	Ecolab Inc	Goldman Sachs International	154	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(60.979)	Edwards Lifesciences Corp	Goldman Sachs International	2.523	0,00
124.850	eFFECTOR Therapeutics	Goldman Sachs International	0	0,00
48.551	Elanco Animal Health Inc	Morgan Stanley	6.220	0,00
22.185	Electronic Arts Inc	Goldman Sachs International	52	0,00
(118.309)	Electronic Arts Inc	Morgan Stanley	14.902	0,00
(595.766)	Elevance Health Inc	Goldman Sachs International	7.293	0,00
(1.080.416)	elf Beauty Inc	Goldman Sachs International	269.551	0,03
(646.222)	elf Beauty Inc	JPMorgan Chase Bank	180.285	0,02
(576.144)	Eli Lilly & Co	JPMorgan Chase Bank	52.400	0,01
(122.839)	Eli Lilly & Co	Morgan Stanley	11.913	0,00
(845.256)	Eli Lilly & Co	Goldman Sachs International	36.515	0,01
249.172	Embecta Corp	Goldman Sachs International	35.121	0,01
(105.927)	EMCOR Group Inc	Morgan Stanley	27.327	0,01
579.648	Enbridge Inc	Goldman Sachs International	3.794	0,00
(367.730)	Encompass Health Corp	Goldman Sachs International	11.027	0,00
37	Encore Capital Group Inc	Goldman Sachs International	9	0,00
278.053	Energizer Holdings Inc	Goldman Sachs International	11.604	0,00
281.323	Energizer Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	8.367	0,00
(116.237)	Energy Transfer LP	Morgan Stanley	19.084	0,00
(913.227)	Energy Transfer LP	JPMorgan Chase Bank	110.897	0,01
(133.077)	Energy Transfer LP	Goldman Sachs International	8.789	0,00
(34.639)	Enovis Corp	Morgan Stanley	279	0,00
(44.067)	Enovis Corp	Nomura	0	0,00
(59.904)	Entergy Corp	Morgan Stanley	3.272	0,00
(103.964)	Envestnet Inc	Nomura	0	0,00
93.619	Envista Holdings Corp	Goldman Sachs International	4.997	0,00
(196.920)	EOG Resources Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(87.932)	EPR Properties	Morgan Stanley	1.158	0,00
134.349	EQT Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
93.208	Equifax Inc	Goldman Sachs International	3.143	0,00
(100)	Equinix Inc	Goldman Sachs International	838	0,00
79.446	Equinix Inc	Morgan Stanley	108	0,00
(164.939)	Erste Group Bank AG	JPMorgan Chase Bank	5.319	0,00
91.711	Etsy Inc	JPMorgan Chase Bank	276	0,00
237.241	Etsy Inc	Morgan Stanley	23.816	0,00
(79.617)	Euronet Worldwide Inc	Morgan Stanley	7.303	0,00
30.219	EverQuote Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	807	0,00
15.777	EverQuote Inc Class A	Goldman Sachs International	624	0,00
(41.738)	Exelixis Inc	Morgan Stanley	1.180	0,00
(227.868)	Expedia Group Inc	Goldman Sachs International	5.113	0,00
(49.991)	Expedia Group Inc	Morgan Stanley	5.880	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(199.620)	Expedia Group Inc	JPMorgan Chase Bank	6.739	0,00
77.976	Expeditors Intl Wash Inc	Morgan Stanley	979	0,00
(300)	Extra Space Storage Inc	Goldman Sachs International	842	0,00
1.130.825	Exxon Mobil Corp	Goldman Sachs International	1.037	0,00
(110.861)	F5 Inc	Morgan Stanley	1.467	0,00
(191.515)	Fair Isaac Corp	JPMorgan Chase Bank	12.295	0,00
(26.482)	Fair Isaac Corp	Goldman Sachs International	1.783	0,00
3.600.000	Fastighets AB Balder	BNP Paribas	38.852	0,01
9.880	Fathom Digital Manufacturing Corporation	Goldman Sachs International	0	0,00
961.368	FedEx Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.904	Fidelity National Information Services Inc	JPMorgan Chase Bank	45	0,00
(51.125)	Fidelity National Information Services Inc	Morgan Stanley	9.106	0,00
199.977	FincoBank SpA	Goldman Sachs International	9.485	0,00
(136.141)	First Citizens BancShares Inc Class A	Morgan Stanley	150	0,00
(86.466)	First Industrial Realty Trust Inc	Morgan Stanley	3.112	0,00
78.248	First Solar Inc	Morgan Stanley	7.543	0,00
(300)	First Solar Inc	Goldman Sachs International	9.531	0,00
(8.309.520)	FirstRand Ltd	Goldman Sachs International	45.457	0,01
(3.406.236)	FirstRand Ltd	JPMorgan Chase Bank	3.810	0,00
50.521	Fiserv Inc	JPMorgan Chase Bank	1.224	0,00
135.481	Fiserv Inc	Goldman Sachs International	3.429	0,00
57.630	Five Below Inc	Morgan Stanley	13.578	0,00
45.260	Fiverr International Ltd	Goldman Sachs International	983	0,00
(137.892)	Flex Ltd	Morgan Stanley	41.595	0,01
21.672	Flight Centre Travel Group	JPMorgan Chase Bank	280	0,00
78.422	Flight Centre Travel Group	Goldman Sachs International	1.451	0,00
418.322	Floor & Decor Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	43.971	0,01
(766.240)	Fluor Corp	Nomura	0	0,00
200	FMC Corp	Goldman Sachs International	44	0,00
(124.838)	Ford Motor Co	Morgan Stanley	2.333	0,00
21.711	Fortinet Inc	Morgan Stanley	374	0,00
110.549	Fortrea Holdings Inc	Goldman Sachs International	8.513	0,00
1.200	Fox Corp Class A	Goldman Sachs International	82	0,00
(25)	Franklin BSP Realty Trust Inc	Goldman Sachs International	5	0,00
76.401	Franklin Resources Inc	Morgan Stanley	2.039	0,00
453.518	Freeport-McMoRan Inc	Goldman Sachs International	63	0,00
(631.258)	Freshpet Inc	JPMorgan Chase Bank	74.117	0,01
(795.342)	Freshpet Inc	Goldman Sachs International	232.548	0,03
(27.607)	Fulcrum Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	16.027	0,00
(37.674)	Fulcrum Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	6.188	0,00
(483.224)	Gap Inc	JPMorgan Chase Bank	47.458	0,01

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
930	Gartner Inc	JPMorgan Chase Bank	34	0,00
57.930	Gartner Inc	Goldman Sachs International	1.922	0,00
77.767	GE HealthCare Technologies Inc	Morgan Stanley	847	0,00
900	GE HealthCare Technologies Inc	Goldman Sachs International	6	0,00
(400)	GE Vernova Inc	Goldman Sachs International	1.111	0,00
77.512	General Mills Inc	Morgan Stanley	870	0,00
765.082	General Mills Inc	JPMorgan Chase Bank	15.036	0,00
162.141	General Mills Inc	Goldman Sachs International	5.122	0,00
486.801	Genmab A/S	JPMorgan Chase Bank	1.031	0,00
4.264.087	Genmab A/S	Goldman Sachs International	85.290	0,01
(87.521)	Genpact Ltd	Morgan Stanley	435	0,00
46.643	Gentex Corp	Morgan Stanley	2.714	0,00
200	Genuine Parts Co	Goldman Sachs International	114	0,00
318.564	Gilead Sciences Inc	JPMorgan Chase Bank	5.192	0,00
(1.000)	Gilead Sciences Inc	Goldman Sachs International	852	0,00
48.765	Gitlab Inc Class A	Morgan Stanley	4.527	0,00
57.559	Glencore Plc	JPMorgan Chase Bank	4.124	0,00
(37.985)	Global Payments Inc	Morgan Stanley	869	0,00
(48.923)	Global-e Online Ltd	JPMorgan Chase Bank	7.932	0,00
(66.011)	Global-e Online Ltd	Goldman Sachs International	9.361	0,00
67.786	GlobalFoundries Inc	Morgan Stanley	5.539	0,00
44.767	Globant SA	Morgan Stanley	629	0,00
(157.436)	GoDaddy Inc Class A	Goldman Sachs International	23.466	0,00
(83.266)	GoDaddy Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	4.815	0,00
(103.428)	Goldman Sachs Group Inc	Morgan Stanley	32.871	0,01
(766)	GRAIL Inc	Goldman Sachs International	2.218	0,00
(81.699)	Grand Canyon Education Inc	Morgan Stanley	11.231	0,00
44.586	Graphic Packaging Holding Co	Morgan Stanley	1.401	0,00
47.975	Grocery Outlet Holding Corp	Morgan Stanley	5.038	0,00
(843.843)	Group 1 Automotive Inc	Morgan Stanley	89.143	0,01
64.931	GSK Plc	JPMorgan Chase Bank	806	0,00
264.769	GSK Plc	Goldman Sachs International	19.193	0,00
(50.887)	Guidewire Software Inc	Goldman Sachs International	6.059	0,00
47.703	GXO Logistics Inc	Morgan Stanley	2.658	0,00
(72.699)	H&R Block Inc	Morgan Stanley	16.781	0,00
352.402	Hain Celestial Group Inc	Goldman Sachs International	69.372	0,01
144.606	Hain Celestial Group Inc	JPMorgan Chase Bank	26.051	0,00
148.963	Haleon Plc	JPMorgan Chase Bank	2.234	0,00
447.110	Haleon Plc	Goldman Sachs International	15.933	0,00
847.524	Halliburton Co	Goldman Sachs International	73.064	0,01
66.335	Halliburton Co	JPMorgan Chase Bank	8.118	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
368.894	Harley-Davidson Inc	Morgan Stanley	19.415	0,00
12	Haynes International Inc	Goldman Sachs International	5	0,00
285.347	HCA Healthcare Inc	Goldman Sachs International	15.031	0,00
78.536	HCA Healthcare Inc	Morgan Stanley	4.551	0,00
26	Healthcare Services Group Inc	Goldman Sachs International	7	0,00
(4.200)	Healthpeak Properties Inc	Goldman Sachs International	52	0,00
(7)	Heidrick & Struggles International Inc	Goldman Sachs International	16	0,00
457.275	Helen of Troy Ltd	Goldman Sachs International	36.923	0,01
81.793	Helen of Troy Ltd	JPMorgan Chase Bank	6.750	0,00
337.756	Helmerich & Payne	Goldman Sachs International	21.496	0,00
80.326	Henry Schein Inc	Morgan Stanley	2.650	0,00
30.737	Henry Schein Inc	Goldman Sachs International	1.143	0,00
1.688.989	Herbalife Nutrition Ltd	Nomura	0	0,00
81.612	Hershey Co	Morgan Stanley	2.995	0,00
1.000	Hess Corp	Goldman Sachs International	2.758	0,00
(321.839)	HF Sinclair Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(85.859)	Highwoods Properties Inc	Morgan Stanley	3.875	0,00
296.261	Hilton Worldwide Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
19	HNI Corp	Goldman Sachs International	6	0,00
(133.493)	Hologic Inc	Morgan Stanley	1.067	0,00
600	Hologic Inc	Goldman Sachs International	725	0,00
(121.816)	Home Depot Inc	Morgan Stanley	13.764	0,00
488.195	Home Reit Plc	Bank of America Merrill Lynch	617	0,00
(62.158)	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	Goldman Sachs International	4.849	0,00
318.465	Hormel Foods Corp	Goldman Sachs International	9.165	0,00
(127.203)	Host Hotels & Resorts Inc	Morgan Stanley	1.200	0,00
(53.156)	Howard Hughes Holdings Inc	Morgan Stanley	389	0,00
244.094	HP Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
136.415	Ideaya Biosciences Inc	Goldman Sachs International	6.933	0,00
(123.174)	IDEXX Laboratories Inc	Morgan Stanley	10.045	0,00
1.448.079	Illinois Tool Works Inc	JPMorgan Chase Bank	79.983	0,01
496.851	Illinois Tool Works Inc	Goldman Sachs International	8.178	0,00
164.804	Immunocore Holdings Plc	Goldman Sachs International	30.382	0,01
(866.069)	Imperial Oil Ltd	JPMorgan Chase Bank	34.716	0,01
(35.388)	Incyte Corp	Morgan Stanley	2.888	0,00
(1.200)	Incyte Corp	Goldman Sachs International	1.317	0,00
48.084	Informatica Inc Class A	Morgan Stanley	4.669	0,00
(158.953)	ING Groep NV	JPMorgan Chase Bank	3.778	0,00
(70.885)	Ingredion Inc	Goldman Sachs International	9.956	0,00
(89.173)	Ingredion Inc	Morgan Stanley	81	0,00
(18.485)	Ingredion Inc	JPMorgan Chase Bank	3.005	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(52.795)	Insméd Inc	JPMorgan Chase Bank	9.377	0,00
(418.616)	Insméd Inc	Goldman Sachs International	400.906	0,05
55.446	Inspire Medical Systems Inc	Morgan Stanley	8.159	0,00
5	Insteel Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(986.330)	Insulet Corp	Nomura	0	0,00
(458.962)	Insulet Corp	Goldman Sachs International	33.199	0,00
(130.044)	Intel Corp	Morgan Stanley	2.963	0,00
(1.200)	Intel Corp	Goldman Sachs International	71	0,00
83.224	Intellia Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	10.126	0,00
57.159	Intellia Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	3.901	0,00
100.172	Inter Parfums Inc	Goldman Sachs International	2.856	0,00
38.618	Inter Parfums Inc	JPMorgan Chase Bank	1.348	0,00
(541.268)	Intercontinental Exchange Inc	JPMorgan Chase Bank	12.076	0,00
(283.327)	Intercontinental Exchange Inc	Goldman Sachs International	4.511	0,00
4.928.678	InterDigital Inc	Nomura	1.312	0,00
300	International Business Machines Corp	Goldman Sachs International	223	0,00
(787.918)	International Flavors & Fragrances Inc	Goldman Sachs International	97.952	0,01
(479.078)	International Flavors & Fragrances Inc	JPMorgan Chase Bank	34.555	0,01
79.489	International Paper Co	Morgan Stanley	1.596	0,00
(700)	International Paper Co	Goldman Sachs International	2.016	0,00
8.750.000	Intesa Sanpaolo SpA	Société Générale	46.059	0,01
(26.085)	Intra-Cellular Therapies Inc	JPMorgan Chase Bank	1.586	0,00
(355.115)	Intuit Inc	Goldman Sachs International	39.386	0,00
(410.149)	Intuit Inc	JPMorgan Chase Bank	41.980	0,01
(337.334)	Intuitive Surgical Inc	Goldman Sachs International	12.836	0,00
44.893	Invesco Ltd	Morgan Stanley	2.692	0,00
(12.929)	Invitation Homes Inc	Morgan Stanley	748	0,00
700	Invitation Homes Inc	Goldman Sachs International	137	0,00
(44.504)	IPG Photonics Corp	Morgan Stanley	693	0,00
27.807	Ipsen	JPMorgan Chase Bank	429	0,00
(100)	IQVIA Holdings Inc	Goldman Sachs International	477	0,00
300	Iron Mountain Inc	Goldman Sachs International	150	0,00
18.835	Ironwood Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	7.219	0,00
349.455	Itau Unibanco Holding SA	Goldman Sachs International	710	0,00
(89.373)	ITT Inc	Morgan Stanley	1.250	0,00
99.918	Jabil Inc	Morgan Stanley	2.907	0,00
(1.100)	Jabil Inc	Goldman Sachs International	1.197	0,00
(77.942)	Janus Henderson Group Plc	Morgan Stanley	9.459	0,00
78.933	Jazz Pharmaceuticals Plc	Goldman Sachs International	6.296	0,00
86.787	JB Hunt Transport Services Inc	Morgan Stanley	6.969	0,00
338.262	Johnson & Johnson	JPMorgan Chase Bank	11.362	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
136.157	Johnson & Johnson	Goldman Sachs International	3.772	0,00
290.178	Johnson & Johnson	Morgan Stanley	13.067	0,00
(80.583)	Jones Lang LaSalle Inc	Morgan Stanley	10.321	0,00
381.526	KBC Group NV	Goldman Sachs International	2.657	0,00
(13)	Kelly Services Inc Class A	Goldman Sachs International	9	0,00
101.001	Kenvue Inc	JPMorgan Chase Bank	2.800	0,00
491.407	Kenvue Inc	Goldman Sachs International	18.270	0,00
(432.336)	Keurig Dr Pepper Inc	Goldman Sachs International	19.644	0,00
(947.291)	KGHM Polska Miedz SA	Goldman Sachs International	60.741	0,01
(87.055)	Kilroy Realty Corp	Morgan Stanley	377	0,00
(117.313)	Kimberly-Clark Corp	Morgan Stanley	15.908	0,00
(1.486.990)	Kimberly-Clark Corp	Goldman Sachs International	103.432	0,01
2.000	Kimco Realty Corp	Goldman Sachs International	52	0,00
45.288	Kinsale Capital Group Inc	Morgan Stanley	328	0,00
(300)	KKR & Co Inc	Goldman Sachs International	181	0,00
77.908	KKR & Co Inc	Morgan Stanley	562	0,00
82.505	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Morgan Stanley	3.353	0,00
43.143	Kohls Corp	Morgan Stanley	483	0,00
481.820	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Goldman Sachs International	17.460	0,00
(142.620)	Kosmos Energy Ltd	Nomura	0	0,00
(93.078)	Kraft Heinz Co	Goldman Sachs International	29.897	0,01
193.537	Kraft Heinz Co	JPMorgan Chase Bank	4.469	0,00
475.993	Kraft Heinz Co	Morgan Stanley	34.355	0,01
265.685	Kroger Co	Goldman Sachs International	4.839	0,00
392.811	Kroger Co	Morgan Stanley	3.034	0,00
(2.821)	L&F Co Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(122.959)	Lam Research Corp	Morgan Stanley	12.150	0,00
69.414	Lamb Weston Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	956	0,00
868.421	Lamb Weston Holdings Inc	Goldman Sachs International	114.387	0,01
(87.088)	Landstar System Inc	Morgan Stanley	1.349	0,00
(8.850)	Las Vegas Sands Corp	Morgan Stanley	60	0,00
(549.295)	Lear Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(45.013)	Legal & General Group Plc	Goldman Sachs International	680	0,00
22.811	Legend Biotech Corp	JPMorgan Chase Bank	4.370	0,00
31.859	Legend Biotech Corp	Goldman Sachs International	8.310	0,00
(700)	Leidos Holdings Inc	Goldman Sachs International	285	0,00
100	Lennar Corp Class A	Goldman Sachs International	94	0,00
(124.719)	Lennox International Inc	Morgan Stanley	8.776	0,00
(43.399)	Liberty Broadband Corp Class C	Morgan Stanley	1.971	0,00
537.189	Liberty Energy Inc	Goldman Sachs International	159	0,00
52.598	Liberty Media Corp	Morgan Stanley	8.226	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(19.980)	Liberty Media Corp Class C	Morgan Stanley	11.543	0,00
24	Ligand Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	97	0,00
45.666	Lithia Motors Inc	Morgan Stanley	153	0,00
7.515.835	Live Nation Entertainment Inc	Société Générale	0	0,00
(133.807)	Live Nation Entertainment Inc	Morgan Stanley	4.654	0,00
600	LKQ Corp	Goldman Sachs International	14	0,00
78.793	Loews Corp	Morgan Stanley	1.513	0,00
334.734	L'Oreal SA	Morgan Stanley	22.146	0,00
11.151	Lowe's Cos Inc	Goldman Sachs International	3.155	0,00
(27.628)	Lumentum Holdings Inc	Morgan Stanley	3.822	0,00
(106.493)	LyondellBasell Industries NV Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(52.871)	Madison Square Garden Entertainment Corp	Goldman Sachs International	928	0,00
(379.726)	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	79.771	0,01
(60.395)	Madrigal Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	10.791	0,00
642.668	Magna International Inc	Goldman Sachs International	55.377	0,01
(109.890)	Manhattan Associates Inc	Morgan Stanley	22.286	0,00
(323.635)	ManpowerGroup Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
44.125	Maplebear Inc	Morgan Stanley	156	0,00
298.504	Marathon Oil Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
45.352	Maravai LifeSciences Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	6.611	0,00
(10)	MarineMax Inc	Goldman Sachs International	17	0,00
81.742	MarketAxess Holdings Inc	Morgan Stanley	3.127	0,00
(325.068)	Marks & Spencer Group Plc	Goldman Sachs International	37.656	0,01
(6.932)	Marriott Vacations Worldwide Corp	Morgan Stanley	405	0,00
78.296	Marsh & McLennan Cos Inc	Morgan Stanley	70	0,00
(200)	Marsh & McLennan Cos Inc	Goldman Sachs International	370	0,00
(356.387)	Martin Marietta Materials Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
12.480	Marvell Technology Inc	Morgan Stanley	78	0,00
47.048	Marvell Technology Inc	Goldman Sachs International	1.711	0,00
(115.472)	Masco Corp	Morgan Stanley	19.283	0,00
(215.678)	Mastercard Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(90.367)	Mastercard Inc Class A	Morgan Stanley	10.871	0,00
(246.765)	Matador Resources Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.300)	Match Group Inc	Goldman Sachs International	200	0,00
1.200	McCormick & Co Inc	Goldman Sachs International	460	0,00
(67.525)	MDU Resources Group Inc	Morgan Stanley	19.019	0,00
172.947	Mediobanca SpA	Goldman Sachs International	2.063	0,00
(58.359)	Medpace Holdings Inc	Morgan Stanley	30.384	0,01
148.475	Medtronic Plc	Goldman Sachs International	6.035	0,00
73.827	Medtronic Plc	JPMorgan Chase Bank	3.344	0,00
(102.913)	Merck & Co Inc	JPMorgan Chase Bank	4.905	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(528.226)	Merck & Co Inc	Goldman Sachs International	10.252	0,00
456.736	Merck KGaA	JPMorgan Chase Bank	13.161	0,00
(327.076)	Merus NV	Goldman Sachs International	236.010	0,03
(78.590)	Merus NV	JPMorgan Chase Bank	5.000	0,00
123.148	Meta Platforms Inc Class A	Goldman Sachs International	6.904	0,00
(368.184)	Meta Platforms Inc Class A	Morgan Stanley	93.772	0,01
(166.648)	Meta Platforms Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	3.440	0,00
79.795	MetLife Inc	Morgan Stanley	2.855	0,00
31.297	MetLife Inc	Goldman Sachs International	355	0,00
(70.171)	Mgic Investment Corp	Morgan Stanley	16.714	0,00
1.800	MGM Resorts International	Goldman Sachs International	626	0,00
(81.767)	Micron Technology Inc	Goldman Sachs International	13.749	0,00
(75.358)	Micron Technology Inc	Morgan Stanley	17.187	0,00
(446.058)	Microsoft Corp	Morgan Stanley	55.636	0,01
(13.255)	Middleby Corp	Nomura	0	0,00
310.059	Moderna Inc	Goldman Sachs International	37.383	0,01
163.237	Moderna Inc	JPMorgan Chase Bank	12.164	0,00
12.796.757	MOL Hungarian Oil & Gas Plc	Morgan Stanley	734	0,00
473.504	Molina Healthcare Inc	Goldman Sachs International	33.795	0,01
531.632	Molson Coors Beverage Co Class B	Morgan Stanley	90.487	0,01
(90.598)	Monday.com Ltd	JPMorgan Chase Bank	9.142	0,00
640.009	Mondelez International Inc Class A	Morgan Stanley	42.070	0,01
(124.781)	Monolithic Power Systems Inc	Morgan Stanley	11.451	0,00
77.090	Monster Beverage Corp	Morgan Stanley	973	0,00
10.600	Monster Beverage Corp	Goldman Sachs International	176	0,00
(121.447)	Moody's Corp	Morgan Stanley	13.771	0,00
190.071	Morgan Stanley	Goldman Sachs International	0	0,00
(19.474)	Morphic Holding Inc	Goldman Sachs International	7.743	0,00
(165.042)	Morphic Holding Inc	JPMorgan Chase Bank	74.518	0,01
(21.802)	Morphic Holding Inc	Morgan Stanley	124	0,00
(101.908)	Motorola Solutions Inc	Morgan Stanley	32.859	0,01
(1.542.926)	MPLX LP	JPMorgan Chase Bank	265.199	0,03
(60.323)	MPLX LP	Goldman Sachs International	3.102	0,00
(535.377)	Mr Price Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	12.321	0,00
(7.513.952)	Mr Price Group Ltd	Goldman Sachs International	26.848	0,00
(89.082)	MSA Safety Inc	Morgan Stanley	529	0,00
(367.230)	Murphy Oil Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
900	Nasdaq Inc	Goldman Sachs International	85	0,00
(2.910.471)	Naspers Ltd	JPMorgan Chase Bank	1.022	0,00
(4.535.952)	Naspers Ltd	Goldman Sachs International	16.076	0,00
(116.182)	Naspers Ltd	Morgan Stanley	680	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
44.562	Natera Inc	Morgan Stanley	1.002	0,00
(155.665)	National Bank of Greece SA	Morgan Stanley	11.485	0,00
22.640	National Beverage Corp	Goldman Sachs International	32	0,00
(82.553)	National Fuel Gas Co	Morgan Stanley	5.051	0,00
1.950.000	NCL Corp Ltd	Nomura	3.871	0,00
43.523	NCR Atleos Corp	Morgan Stanley	70	0,00
48.962	NCR Corp	Morgan Stanley	7.477	0,00
1.223.361	Nestle SA	Goldman Sachs International	38.935	0,00
67.848	Nestle SA	JPMorgan Chase Bank	2.825	0,00
(11.246)	NetApp Inc	Morgan Stanley	4.601	0,00
(183.464)	Netflix Inc	Morgan Stanley	45.655	0,00
1.369.324	Netflix Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.429.158	Neurocrine Biosciences Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(38.774)	Neurocrine Biosciences Inc	Morgan Stanley	6.600	0,00
182.275	Newell Brands Inc	JPMorgan Chase Bank	43.351	0,01
300.707	Newell Brands Inc	Goldman Sachs International	67.152	0,01
(1.200)	Newmont Corp	Goldman Sachs International	115	0,00
(201.398)	News Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	2.952	0,00
(125.147)	News Corp Class A	Goldman Sachs International	2.681	0,00
(1.900)	News Corp Class B	Goldman Sachs International	211	0,00
1.325.696	NextEra Energy Inc	Goldman Sachs International	6.287	0,00
80.839	NextEra Energy Inc	Morgan Stanley	6.282	0,00
225.150	NIO Inc	Nomura	0	0,00
75.931	NiSource Inc	Morgan Stanley	677	0,00
(138.709)	NN Group NV	Goldman Sachs International	2.658	0,00
2.162.763	Nordea Bank Abp	Goldman Sachs International	1.826	0,00
85.333	Nordson Corp	Morgan Stanley	6.351	0,00
(600)	Norfolk Southern Corp	Goldman Sachs International	45	0,00
1.024.793	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Nomura	0	0,00
(86.613)	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Morgan Stanley	184	0,00
(11.294.954)	Novo Nordisk A/S	Goldman Sachs International	291.578	0,03
42.453	Novocure Ltd	Morgan Stanley	1.177	0,00
399.134	NRG Energy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(56.745)	NU Holdings Ltd Class A	Morgan Stanley	26.402	0,00
(129.926)	NU Holdings Ltd Class A	Goldman Sachs International	13.729	0,00
(61.882)	NU Holdings Ltd Class A	JPMorgan Chase Bank	6.973	0,00
103.952	Nu Skin Enterprises Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	20.267	0,00
183.223	Nu Skin Enterprises Inc Class A	Goldman Sachs International	39.379	0,01
442.180	Nucor Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(68.225)	NVIDIA Corp	JPMorgan Chase Bank	2.358	0,00
(296.269)	NVIDIA Corp	Morgan Stanley	157.005	0,02

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
193	Oatly Group AB	Morgan Stanley	857	0,00
2.324	Oatly Group AB	Goldman Sachs International	3.416	0,00
3.154	Oatly Group AB	JPMorgan Chase Bank	6.069	0,00
12.604	Olaplex Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	5.010	0,00
62.907	Olaplex Holdings Inc	Goldman Sachs International	36.481	0,01
(27.728)	Olaplex Holdings Inc	Morgan Stanley	3.227	0,00
4.700	Old Dominion Freight Line Inc	Goldman Sachs International	4.882	0,00
(59.166)	Olema Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	7.286	0,00
161.647	ON Semiconductor Corp	Nomura	0	0,00
71.494	ON Semiconductor Corp	Morgan Stanley	6.444	0,00
1.869.968	ONEOK Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(140.205)	Oracle Corp	Morgan Stanley	37.990	0,01
(40.538)	Oracle Corp	Goldman Sachs International	5.448	0,00
4.904.213	Ormat Technologies Inc	Nomura	7.850	0,00
114.952	Oscar Health Inc Class A	Goldman Sachs International	2.498	0,00
78.682	Otis Worldwide Corp	Morgan Stanley	473	0,00
(212.958.263)	OTP Bank Nyrt	Goldman Sachs International	56.166	0,01
(26.388.103)	OTP Bank Nyrt	JPMorgan Chase Bank	5.087	0,00
(16.648.053)	OTP Bank Nyrt	Morgan Stanley	492	0,00
(107.319)	Owens Corning	Morgan Stanley	27.920	0,01
79.330	PACCAR Inc	Morgan Stanley	1.856	0,00
37.045	Pacira BioSciences Inc	JPMorgan Chase Bank	572	0,00
212.493	Pacira BioSciences Inc	Goldman Sachs International	30.461	0,00
1.296	Pacira BioSciences Inc	Morgan Stanley	136	0,00
(21.873)	Palo Alto Networks Inc	Morgan Stanley	5.506	0,00
(89.481)	Palo Alto Networks Inc	Goldman Sachs International	7.832	0,00
(538.688)	Parker-Hannifin Corp	Morgan Stanley	3.478	0,00
34	Pathward Financial Inc	Goldman Sachs International	35	0,00
37.650	Patterson Cos Inc	Morgan Stanley	6.485	0,00
162.640	Patterson Cos Inc	Goldman Sachs International	10.210	0,00
145.026	Paychex Inc	Goldman Sachs International	5.247	0,00
131.759	Paychex Inc	JPMorgan Chase Bank	4.794	0,00
80.085	Paycom Software Inc	Goldman Sachs International	13.468	0,00
58.732	Paycor HCM Inc	Morgan Stanley	17.022	0,00
59.498	PayPal Holdings Inc	Morgan Stanley	4.521	0,00
5.970.582	Peabody Energy Corp	Nomura	0	0,00
(68.480)	Pegasystems Inc	Morgan Stanley	21.232	0,00
47.516	Penske Automotive Group Inc	Morgan Stanley	2.370	0,00
2.375.258	Pepkor Holdings Ltd	Goldman Sachs International	2.438	0,00
2.844.758	Pepkor Holdings Ltd	JPMorgan Chase Bank	2.816	0,00
675.588	PepsiCo Inc	Goldman Sachs International	30.851	0,01

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
432.335	PepsiCo Inc	JPMorgan Chase Bank	12.838	0,00
384.640	PepsiCo Inc	Morgan Stanley	15.797	0,00
119.940	Perrigo Co Plc	Goldman Sachs International	7.424	0,00
(247.915)	Petco Health & Wellness Co Inc	Morgan Stanley	16.174	0,00
(61.739)	Pfizer Inc	Goldman Sachs International	882	0,00
75.462	PG&E Corp	Morgan Stanley	1.541	0,00
59.132	PG&E Corp	Goldman Sachs International	60	0,00
(74.218)	Phinia Inc	Morgan Stanley	14.892	0,00
600	Pinnacle West Capital Corp	Goldman Sachs International	146	0,00
(30.593)	Pinterest Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	805	0,00
(58.794)	Pinterest Inc Class A	Goldman Sachs International	7.749	0,00
427.443	Polaris Inc	Morgan Stanley	48.856	0,01
200	Pool Corp	Goldman Sachs International	16	0,00
(958.684)	Porto Seguro SA	Goldman Sachs International	1.027	0,00
323.877	POSCO Holdings Inc	Goldman Sachs International	2.382	0,00
(354.356)	Post Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	38.478	0,01
(657.639)	Post Holdings Inc	Goldman Sachs International	17.233	0,00
145.389	Poste Italiane SpA	Goldman Sachs International	7.838	0,00
(603.481)	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	JPMorgan Chase Bank	4.061	0,00
(2.455.818)	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	Goldman Sachs International	50.866	0,01
(64.761)	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	Goldman Sachs International	1.203	0,00
(971.247)	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	JPMorgan Chase Bank	61.525	0,01
(900)	PPG Industries Inc	Goldman Sachs International	447	0,00
77.757	PPL Corp	Morgan Stanley	1.911	0,00
(20)	PRA Group Inc	Goldman Sachs International	16	0,00
(226.136)	Prestige Consumer Healthcare Inc	JPMorgan Chase Bank	9.711	0,00
(299.157)	Prestige Consumer Healthcare Inc	Goldman Sachs International	14.581	0,00
19.922	Procter & Gamble Co	JPMorgan Chase Bank	88	0,00
2	Progyny Inc	Goldman Sachs International	5	0,00
(65.649)	Prosus NV	Morgan Stanley	16.234	0,00
(209.072)	Prosus NV	Goldman Sachs International	16.554	0,00
(30.512)	Prosus NV	JPMorgan Chase Bank	363	0,00
(42.090)	Protagonist Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	8.419	0,00
(25.746)	Protagonist Therapeutics Inc	Morgan Stanley	10.427	0,00
252.481	Prudential Financial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
700	Public Service Enterprise Group Inc	Goldman Sachs International	228	0,00
(200)	PulteGroup Inc	Goldman Sachs International	862	0,00
(47.188)	Qorvo Inc	Morgan Stanley	4.580	0,00
(100.986)	QUALCOMM Inc	Morgan Stanley	36.551	0,01
(1)	Quanex Building Products Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
43.034	QuantumScape Corp	Morgan Stanley	5.975	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
49.507	QuidelOrtho Corp	Morgan Stanley	9.136	0,00
(192.292)	RadNet Inc	Goldman Sachs International	18.132	0,00
44.195	Range Resources Corp	Morgan Stanley	150	0,00
748.320	Range Resources Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
889.602	Range Resources Corp	JPMorgan Chase Bank	11.292	0,00
(24)	Ready Capital Corp	Goldman Sachs International	10	0,00
800	Realty Income Corp	Goldman Sachs International	96	0,00
81.062	Realty Income Corp	Morgan Stanley	2.606	0,00
(93.462)	Reckitt Benckiser Group Plc	Goldman Sachs International	734	0,00
(143.044)	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	23.911	0,00
(27.970)	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	4.547	0,00
300	Regions Financial Corp	Goldman Sachs International	215	0,00
(89.476)	Reinsurance Group of America Class A	Morgan Stanley	402	0,00
(320.175)	Reliance Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.008.500	Remgro Ltd	Goldman Sachs International	12.117	0,00
377.601	Remgro Ltd	Morgan Stanley	156	0,00
2.499.691	Remgro Ltd	JPMorgan Chase Bank	2.244	0,00
49.460	Remitly Global Inc	JPMorgan Chase Bank	15.544	0,00
42.760	Remitly Global Inc	Goldman Sachs International	11.779	0,00
88.024	Repligen Corp	Morgan Stanley	6.485	0,00
20.659	Repligen Corp	Goldman Sachs International	3.401	0,00
32.326	ResMed Inc	Goldman Sachs International	906	0,00
(179.585)	REVOLUTION Medicines Inc	JPMorgan Chase Bank	182.257	0,02
(41.902)	REVOLUTION Medicines Inc	Morgan Stanley	11.297	0,00
79.441	Revvity Inc	Morgan Stanley	1.753	0,00
45.491	Rexford Industrial Realty Inc	Morgan Stanley	1.029	0,00
125.147	Reynolds Consumer Products Inc	Goldman Sachs International	1.362	0,00
2.100.000	Rheinmetall AG	Bank of America Merrill Lynch	12.658	0,00
47.668	Rhythm Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	5.885	0,00
12.716	Rhythm Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	177	0,00
74.080	Rightmove Plc	JPMorgan Chase Bank	1.437	0,00
123.874	Rightmove Plc	Goldman Sachs International	6.093	0,00
101.971	Rio Tinto Plc	JPMorgan Chase Bank	3.797	0,00
(38.007)	Robinhood Markets Inc Class A	Goldman Sachs International	4.327	0,00
(35.038)	Robinhood Markets Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	1.369	0,00
51.108	Roche Holding AG	JPMorgan Chase Bank	2.523	0,00
(212.598)	Roche Holding AG	Goldman Sachs International	1.513	0,00
42.267	Roivant Sciences Ltd	Morgan Stanley	1.183	0,00
(130.838)	Roku Inc	Morgan Stanley	5.526	0,00
(78.250)	Rollins Inc	Morgan Stanley	5.143	0,00
(2.200)	Rollins Inc	Goldman Sachs International	103	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
439.166	Ross Stores Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
162.946	Royalty Pharma Plc Class A	Goldman Sachs International	31.783	0,01
(85.563)	Ryan Specialty Holdings Inc	Morgan Stanley	1.624	0,00
40.428	Ryder System Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(88.830)	Ryder System Inc	Morgan Stanley	1.609	0,00
(654.482)	Saia Inc	Goldman Sachs International	48.677	0,01
(32.988)	Saipem SpA	Société Générale	61	0,00
107.954	Salesforce Inc	Goldman Sachs International	8.332	0,00
(180.883)	Salesforce Inc	Morgan Stanley	3.509	0,00
95.017	Sally Beauty Holdings Inc	Goldman Sachs International	3.876	0,00
84.183	Sally Beauty Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	184	0,00
(30.432)	Samsara Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	3.249	0,00
(1.111.943)	Sanlam Ltd	Morgan Stanley	6.941	0,00
(2.345.699)	Sanlam Ltd	Goldman Sachs International	9.578	0,00
(2.769.104)	Sanlam Ltd	JPMorgan Chase Bank	38.466	0,01
(118.536)	Santander Bank Polska SA	JPMorgan Chase Bank	922	0,00
(532.219)	Santander Bank Polska SA	Goldman Sachs International	23.937	0,00
(682.082)	Sarepta Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	84.078	0,01
13.068	SBA Communications Corp	JPMorgan Chase Bank	568	0,00
78.507	SBA Communications Corp	Goldman Sachs International	1.626	0,00
(134.118)	SBA Communications Corp	Morgan Stanley	1.030	0,00
46.043	Schneider National Inc Class B	Morgan Stanley	2.155	0,00
34.812	Schrodinger Inc	Goldman Sachs International	7.705	0,00
11.048	Schrodinger Inc	JPMorgan Chase Bank	1.823	0,00
6.800.000	Seagate HDD Cayman	Nomura	1.686.302	0,19
7.637.115	Seagate Technology Holdings Plc	Nomura	0	0,00
(63.965)	Sealed Air Corp	Morgan Stanley	6.250	0,00
(111.840)	SEI Investments Co	Goldman Sachs International	0	0,00
318.113	Semtech Corp	Nomura	0	0,00
(80.061)	Sensata Technologies Holding	Morgan Stanley	8.731	0,00
44.515	SentinelOne Inc Class A	Morgan Stanley	1.207	0,00
5	Service Properties Trust	Goldman Sachs International	0	0,00
(101.365)	ServiceNow Inc	Morgan Stanley	34.556	0,01
1.806.652	ServiceNow Inc	Goldman Sachs International	23.967	0,00
(233.836)	ServiceNow Inc	JPMorgan Chase Bank	29.364	0,01
(721.658)	Sharkninja Inc	Goldman Sachs International	166.288	0,02
(303.223)	Sharkninja Inc	JPMorgan Chase Bank	33.270	0,01
(103.679)	Shell Plc	JPMorgan Chase Bank	4.016	0,00
(1.380.504)	Shell Plc	Goldman Sachs International	40.320	0,01
(150.121)	Shell Plc	Morgan Stanley	19.003	0,00
(119.551)	Sherwin-Williams Co	Morgan Stanley	15.482	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(15.155.155)	Shift4 Payments Inc Class A	Nomura	0	0,00
(20.161)	Shopify Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	785	0,00
(69.998)	Shopify Inc Class A	Goldman Sachs International	1.948	0,00
2.724.159	Shoprite Holdings Ltd	JPMorgan Chase Bank	3.591	0,00
74.036	Sibanye Stillwater Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.696	0,00
(14.449)	Sibanye Stillwater Ltd	Nomura	0	0,00
(233)	Siemens Energy AG	Bank of America Merrill Lynch	0	0,00
(130.309)	Simon Property Group Inc	Morgan Stanley	2.847	0,00
1.213.488	Simon Property Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(46.793)	Simply Good Foods Co	Morgan Stanley	632	0,00
(83.488)	Simply Good Foods Co	Goldman Sachs International	9.431	0,00
(57.537)	Sirius XM Holdings Inc	Morgan Stanley	2.792	0,00
52.430	SiteOne Landscape Supply Inc	Morgan Stanley	7.998	0,00
8.460.549	SK Hynix Inc	Goldman Sachs International	104.579	0,01
(214.289)	Skandinaviska Enskilda Banken AB	JPMorgan Chase Bank	628	0,00
(1.011.135)	Skandinaviska Enskilda Banken AB	Goldman Sachs International	2.749	0,00
71.055	Skyworks Solutions Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(61.453)	SLM Corp	Morgan Stanley	25.406	0,00
(81.367)	Smartsheet Inc Class A	Morgan Stanley	7.206	0,00
(42.582)	Snap Inc Class A	Goldman Sachs International	3.484	0,00
(53.828)	Snap Inc Class A	Morgan Stanley	4.865	0,00
(47.166)	Snap Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	4.472	0,00
68.949	Société Générale SA	JPMorgan Chase Bank	507	0,00
1.500.000	Société Générale SA	BNP Paribas	1.152	0,00
17.425	SoFi Technologies Inc	Goldman Sachs International	1.767	0,00
406.061	Sonos Inc	Morgan Stanley	58.112	0,01
49.692	Sotera Health Co	Morgan Stanley	8.712	0,00
503.460	Southern Copper Corp	JPMorgan Chase Bank	4.130	0,00
272.370	Southern Copper Corp	Goldman Sachs International	3.172	0,00
(1.460.323)	Spectrum Brands Holdings Inc	Goldman Sachs International	37.333	0,01
(144.199)	Spectrum Brands Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	1.540	0,00
(86.594)	Spotify Technology SA	Morgan Stanley	1.926	0,00
(236.303)	Spotify Technology SA	JPMorgan Chase Bank	6.109	0,00
(172.965)	Spotify Technology SA	Goldman Sachs International	6.263	0,00
129.935	SpringWorks Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	15.415	0,00
17.719	SpringWorks Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	997	0,00
(132.786)	SS&C Technologies Holdings Inc	Morgan Stanley	1.655	0,00
45.720	STAG Industrial Inc	Morgan Stanley	738	0,00
(3.404.655)	Standard Bank Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	23.756	0,00
(6.136.719)	Standard Bank Group Ltd	Goldman Sachs International	29.488	0,01
(39.677)	State Street Corp	Morgan Stanley	546	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(3.285)	State Street Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(128.907)	Steel Dynamics Inc	Morgan Stanley	9.488	0,00
100	Steel Dynamics Inc	Goldman Sachs International	265	0,00
3.005	Stem Inc	Nomura	0	0,00
46.678	STMicroelectronics NV	Morgan Stanley	8.780	0,00
(133.304)	Stoneco Ltd	Morgan Stanley	2.884	0,00
(616.013)	Stryker Corp	Goldman Sachs International	1.611	0,00
(44.597)	Summit Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	61.850	0,01
44.438	Sunrun Inc	Morgan Stanley	8.057	0,00
(100)	Super Micro Computer Inc	Goldman Sachs International	6.806	0,00
19.634	Supernus Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	163	0,00
269.570	Surgery Partners Inc	Goldman Sachs International	21.250	0,00
(4.890.997)	Swedish Orphan Biovitrum AB	Goldman Sachs International	4.559	0,00
(1.721.992)	Swedish Orphan Biovitrum AB	JPMorgan Chase Bank	3.912	0,00
(97.165)	Synchrony Financial	Morgan Stanley	43.807	0,01
562.703	Sysco Corp	Goldman Sachs International	44.703	0,01
231.731	Sysco Corp	JPMorgan Chase Bank	21.194	0,00
(123.760)	Sysco Corp	Morgan Stanley	7.799	0,00
238.222	T Rowe Price Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(87.036)	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Morgan Stanley	52.940	0,01
(149.862)	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs International	21.903	0,00
203.678.100	Taiyo Yuden Co Ltd	Nomura	959	0,00
(77.803)	Take-Two Interactive Software Inc	Morgan Stanley	5.622	0,00
(86.978)	Take-Two Interactive Software Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.662.046)	Talen Energy Corp	Goldman Sachs International	2.887	0,00
(3.734)	Tanger Factory Outlet Centers Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.600	Tapestry Inc	Goldman Sachs International	367	0,00
(768.188)	Tapestry Inc	Morgan Stanley	53.403	0,01
486.871	Targa Resources Corp	Goldman Sachs International	358.324	0,04
(103.737)	Targa Resources Corp	JPMorgan Chase Bank	35.544	0,01
(137.209)	TD SYNnex Corp	Morgan Stanley	13.799	0,00
(48.162)	TD SYNnex Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(565.341)	TechnipFMC Plc	Goldman Sachs International	43.415	0,01
(168.530)	Teleflex Inc	Goldman Sachs International	6.471	0,00
(136.395)	Teleflex Inc	Morgan Stanley	2.601	0,00
205.592	Tencent Holdings Ltd	Morgan Stanley	4.436	0,00
432.499	Tenet Healthcare Corp	Goldman Sachs International	10.795	0,00
100	Tesla Inc	Goldman Sachs International	1.658	0,00
2.139.999	Tetra Tech Inc	Nomura	0	0,00
(102.498)	Texas Pacific Land Corp	Morgan Stanley	32.424	0,01
318.374	Texas Roadhouse Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
44.013	TFS Financial Corp	Morgan Stanley	1.844	0,00
(213.375)	Thor Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(96.127)	TKO Group Holdings Inc	Goldman Sachs International	6.049	0,00
(139.714)	TKO Group Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	7.184	0,00
44.672	TKO Group Holdings Inc	Morgan Stanley	57	0,00
(140.431)	TKO Group Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	20.589	0,00
(100)	T-Mobile US Inc	Goldman Sachs International	120	0,00
(329.866)	T-Mobile US Inc	Morgan Stanley	32.757	0,01
769.662	TotalEnergies SE	Goldman Sachs International	40.680	0,01
329.598	TotalEnergies SE	JPMorgan Chase Bank	24.121	0,00
850.414	Tourmaline Oil Corp	Goldman Sachs International	19.175	0,00
8.145	TPG Inc	Morgan Stanley	136	0,00
78.367	Trane Technologies Plc	Morgan Stanley	648	0,00
79.953	Travelers Cos Inc	Morgan Stanley	2.862	0,00
529.295	TreeHouse Foods Inc	Goldman Sachs International	36.108	0,01
9.972.498	Trip.com Group Ltd	Nomura	20.084	0,00
27.889	TripAdvisor Inc	Morgan Stanley	203	0,00
2.300	Truist Financial Corp	Goldman Sachs International	1.825	0,00
33	TrustCo Bank Corp NY	Goldman Sachs International	56	0,00
(3.255.895)	Truworths International Ltd	JPMorgan Chase Bank	37.776	0,01
(5.123.817)	Truworths International Ltd	Goldman Sachs International	19.696	0,00
(978.414)	Tryg A/S	Goldman Sachs International	6.016	0,00
(743.250)	Tryg A/S	Morgan Stanley	711	0,00
100	Tyler Technologies Inc	Goldman Sachs International	3.551	0,00
(51.969)	Uber Technologies Inc	JPMorgan Chase Bank	4.873	0,00
(549.548)	Uber Technologies Inc	Morgan Stanley	44.033	0,00
(59.958)	Uber Technologies Inc	Goldman Sachs International	4.554	0,00
17.500.000	Uber Technologies Inc	Goldman Sachs International	3.076.433	0,35
350.551	UBS Group AG	Goldman Sachs International	20.086	0,00
46.545	UBS Group AG	JPMorgan Chase Bank	1.762	0,00
(249.918)	UCB SA	Morgan Stanley	85.033	0,01
(310.546)	UCB SA	JPMorgan Chase Bank	135.420	0,02
(1.107.953)	UCB SA	Goldman Sachs International	463.958	0,06
79.064	U-Haul Holding Co	Morgan Stanley	1.394	0,00
45.446	UiPath Inc Class A	Goldman Sachs International	7.579	0,00
358.164	Ulta Beauty Inc	JPMorgan Chase Bank	4.084	0,00
29.050	Under Armour Inc Class A	Morgan Stanley	1.199	0,00
36.188	Under Armour Inc Class C	Morgan Stanley	1.062	0,00
(1.907.923)	Unilever Plc	Goldman Sachs International	57.363	0,01
(988.844)	Unilever Plc	JPMorgan Chase Bank	28.226	0,00
(98.930)	Unilever Plc	Morgan Stanley	1.060	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
115.346	Union Pacific Corp	Goldman Sachs International	914	0,00
(75.917)	United Airlines Holdings Inc	Morgan Stanley	13.064	0,00
(36)	United Natural Foods Inc	Goldman Sachs International	7	0,00
(32.115)	United Therapeutics Corp	Morgan Stanley	12.977	0,00
(46.141)	United Therapeutics Corp	JPMorgan Chase Bank	17.686	0,00
(76.320)	United Therapeutics Corp	Goldman Sachs International	25.296	0,00
(651.222)	UnitedHealth Group Inc	Goldman Sachs International	14.090	0,00
106.649	Unity Software Inc	Morgan Stanley	31.432	0,01
(200)	Universal Health Services Inc Class B	Goldman Sachs International	1.287	0,00
172.128	Unum Group	Goldman Sachs International	0	0,00
(84.478)	Unum Group	Morgan Stanley	4.768	0,00
73.893	USANA Health Sciences Inc	JPMorgan Chase Bank	2.578	0,00
94.513	USANA Health Sciences Inc	Goldman Sachs International	2.582	0,00
(75.805)	Utz Brands Inc	JPMorgan Chase Bank	11.184	0,00
(95.185)	Utz Brands Inc	Goldman Sachs International	7.851	0,00
(62.333)	UWM Holdings Corp	Morgan Stanley	16.210	0,00
378.725	Vail Resorts Inc	Morgan Stanley	26.018	0,00
(71.905)	Valmont Industries Inc	Morgan Stanley	18.060	0,00
(461.414)	Valvoline Inc	Morgan Stanley	24.730	0,00
(32.230)	Vaxcyte Inc	Goldman Sachs International	18.660	0,00
(11.284)	Vaxcyte Inc	JPMorgan Chase Bank	5.034	0,00
63.339	Veeva Systems Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	1.092	0,00
33.571	Veeva Systems Inc Class A	Goldman Sachs International	1.719	0,00
1.300	Ventas Inc	Goldman Sachs International	675	0,00
(129.414)	Ventas Inc	Morgan Stanley	5.685	0,00
(121.071)	Veralto Corp	Morgan Stanley	9.014	0,00
93.611	VeriSign Inc	Goldman Sachs International	6.625	0,00
(117.997)	Verisk Analytics Inc	Morgan Stanley	15.473	0,00
(209.552)	Verisk Analytics Inc	JPMorgan Chase Bank	16.299	0,00
(367.673)	Verisk Analytics Inc	Goldman Sachs International	44.551	0,01
49.505	VF Corp	Morgan Stanley	8.968	0,00
53.239	Viasat Inc	Morgan Stanley	14.079	0,00
(97.571)	Viatis Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(130.577)	Vici Properties Inc	Morgan Stanley	2.012	0,00
835.590	Virgin Galactic Holdings Inc	Nomura	6.411	0,00
(82.647)	Virtu Financial Inc Class A	Morgan Stanley	1.994	0,00
130.575	Visa Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	5.069	0,00
526.962	Visa Inc Class A	Goldman Sachs International	12.128	0,00
152.024	Visa Inc Class A	Morgan Stanley	5.339	0,00
(43)	Vishay Intertechnology Inc	Nomura	0	0,00
77.958	Vistra Corp	Morgan Stanley	711	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(86.495)	Vistra Corp	JPMorgan Chase Bank	104.710	0,01
(88.636)	Vital Farms Inc	Goldman Sachs International	66.936	0,01
(19.829)	Vital Farms Inc	Morgan Stanley	768	0,00
(8.309)	Vital Farms Inc	JPMorgan Chase Bank	891	0,00
(80.464)	Vontier Corp	Morgan Stanley	7.328	0,00
(88.704)	Voya Financial Inc	Morgan Stanley	36	0,00
245.735	Voya Financial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
767.498	Vulcan Materials Co	JPMorgan Chase Bank	8.607	0,00
1.072.931	Vulcan Materials Co	Goldman Sachs International	36.391	0,01
79.130	Wabtec Corp	Morgan Stanley	1.391	0,00
407.850	Walgreens Boots Alliance Inc	Goldman Sachs International	61.830	0,01
112.835	Walgreens Boots Alliance Inc	Morgan Stanley	38.343	0,01
(286.182)	Walmart Inc	Morgan Stanley	41.831	0,01
(524.207)	Walmart Inc	JPMorgan Chase Bank	92.772	0,01
(728.837)	Walmart Inc	Goldman Sachs International	75.152	0,01
182.003	Walt Disney Co	JPMorgan Chase Bank	4.197	0,00
178.043	Walt Disney Co	Goldman Sachs International	4.561	0,00
2.900	Warner Bros Discovery Inc	Goldman Sachs International	284	0,00
(66.705)	WaVe Life Sciences Ltd	JPMorgan Chase Bank	8.032	0,00
(10.206)	WaVe Life Sciences Ltd	Goldman Sachs International	2.858	0,00
(10.047)	Wayfair Inc Class A	Goldman Sachs International	351	0,00
1.686.346	Wayfair Inc Class A	Nomura	0	0,00
(306)	Wayfair Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	4	0,00
51.307	Wayfair Inc Class A	Morgan Stanley	4.336	0,00
(647.719)	Weatherford International Plc	Goldman Sachs International	27.908	0,01
(123.106)	Weatherford International Plc	JPMorgan Chase Bank	4.902	0,00
(85.825)	Webster Financial Corp	Morgan Stanley	6.638	0,00
90.976	Webuild SpA	Société Générale	690	0,00
3.969.371	WEC Energy Group Inc	Nomura	7.604	0,00
524.250	WEC Energy Group Inc	JPMorgan Chase Bank	1.395	0,00
(84.680)	Wendy's Co	Morgan Stanley	131	0,00
(81.592)	WESCO International Inc	Morgan Stanley	633	0,00
398.911	West Pharmaceutical Services Inc	Goldman Sachs International	6.485	0,00
(73.702)	Western Alliance Bancorp	Morgan Stanley	17.235	0,00
2.244.965	Western Digital Corp	Goldman Sachs International	110	0,00
(284.669)	Western Digital Corp	Morgan Stanley	92.172	0,01
109.699	Western Union Co	Goldman Sachs International	10.234	0,00
154.725	WEX Inc	Goldman Sachs International	28.433	0,01
229.177	Whitecap Resources Inc	Goldman Sachs International	1.329	0,00
283.170	Whitecap Resources Inc	JPMorgan Chase Bank	2.715	0,00
3	Whitestone REIT	Goldman Sachs International	0	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 2,49% (31 de diciembre de 2023: 6,57%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
316.291	Williams-Sonoma Inc	Morgan Stanley	1.719	0,00
78.402	Willis Towers Watson Plc	Morgan Stanley	60	0,00
542.255	Wingstop Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(27.238)	Winnebago Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
113.088	Wix.Com Ltd	JPMorgan Chase Bank	3.861	0,00
120.144	WK Kellogg Co	Goldman Sachs International	13.640	0,00
103.458	WK Kellogg Co	JPMorgan Chase Bank	1.252	0,00
(14.536)	Wolfspeed Inc	Nomura	0	0,00
61.345	Wolfspeed Inc	Morgan Stanley	12.167	0,00
(72.814)	Woodward Inc	Morgan Stanley	15.610	0,00
154.938	Woolworths Holdings Ltd	JPMorgan Chase Bank	363	0,00
8.572.921	Woolworths Holdings Ltd	Goldman Sachs International	12.573	0,00
(77.126)	Workday Inc Class A	Goldman Sachs International	102	0,00
1.681.217	WW Grainger Inc	Goldman Sachs International	64.392	0,01
(25.046)	Wynn Resorts Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(300)	Xcel Energy Inc	Goldman Sachs International	86	0,00
(41)	Xenia Hotels & Resorts Inc	Goldman Sachs International	1	0,00
2.590.000	Xero Investments Ltd	Nomura	84.175	0,01
138.920	Xero Ltd	Nomura	571	0,00
3.171.406	Xerox Holdings Corp	Nomura	1.619	0,00
44.637	XP Inc Class A	Morgan Stanley	3.012	0,00
(36.222)	XPO Inc	JPMorgan Chase Bank	370	0,00
28.412	Yelp Inc	Goldman Sachs International	982	0,00
98.573	Yelp Inc	JPMorgan Chase Bank	7.584	0,00
408.556	YETI Holdings Inc	Morgan Stanley	16.884	0,00
(38.219)	Zai Lab Ltd	Goldman Sachs International	1.806	0,00
(946.711)	Zealand Pharma A/S	JPMorgan Chase Bank	163.346	0,02
(133.973)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Morgan Stanley	332	0,00
57.549	Zimmer Biomet Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	5.612	0,00
253.196	Zimmer Biomet Holdings Inc	Goldman Sachs International	4.750	0,00
11.392	Zoetis Inc	Morgan Stanley	188	0,00
172.599	Zurich Insurance Group AG	JPMorgan Chase Bank	737	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos por diferencias [∞]			22.180.808	2,49

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Swaptions adquiridos 0,02% (31 de diciembre de 2023: 0,00%)

Importe nominal	Fecha de vencimiento	Descripción	Contraparte	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Swaptions de venta					
120.000.000 EUR	17/07/2024	Swaption en EUR, en caso de que se ejerza la opción, la Cartera formalizará un swap con un valor nominal de 120.000.000 EUR en el que abonará un tipo del 1,00% y recibirá iTraxx XO.41.V1, tipo de ejercicio 7,00%	Merrill Lynch International	91.178	0,01
60.000.000 EUR	17/07/2024	Swaption en EUR, en caso de que se ejerza la opción, la Cartera formalizará un swap con un valor nominal de 60.000.000 EUR en el que abonará un tipo del 1,00% y recibirá iTraxx XO.41.V1, tipo de ejercicio 7,00%	Merrill Lynch International	45.589	0,01
Total valor razonable en swaptions adquiridos [∞] (Prima: 317.001 USD)				136.767	0,02

Contratos de credit default swap 0,00% (31 de diciembre de 2023: 0,04%)

Nominal Vega	Fecha de extinción	Contraparte	Obligación de referencia	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
1.100.000 USD	20/12/2026	Merrill Lynch International	Selling default protection on Simon Property Group LP, 2.65%, 15/07/2030	17.301	0,00
Total valor razonable en contratos de credit default swap [∞]				17.301	0,00

Contratos de swap de tipos de interés 0,01% (31 de diciembre de 2023: 0,23%)

Importe nominal	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar) [#]	Tipo fijo	Tipo variable	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
EUR 800.000.000	18/12/2024	Merrill Lynch International	(Pagar)	3,57%	1D €STR	81.016	0,01
EUR 200.000.000	20/11/2024	Merrill Lynch International	(Pagar)	3,60%	1D €STR	1.271	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de swap de tipos de interés [∞]						82.287	0,01

[#] Recibir - El fondo recibe un tipo variable y paga un tipo fijo.

(Paga) – El Fondo paga un tipo variable y recibe un tipo fijo.

Contratos de swap de rentabilidad total 0,15% (31 de diciembre de 2023: 0,21%)

Importe nominal	Fecha de extinción	Tipo variable	Entidad de referencia	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
16.432.862 USD	18/03/2025	5,52 ¹	Société Générale Basket SGBVVRU ²	585.549	0,07
43.260.683 USD	24/04/2025	0,00 ³	Goldman Sachs GSVIDI1B Index ⁴	336.953	0,04
(2.722.677) USD	06/11/2024	4,88 ⁵	Morgan Stanley Basket MSABSMBP ⁶	100.697	0,01
(711.685) USD	03/02/2026	4,58 ⁵	Morgan Stanley Basket MSNBUTAN ⁶	48.645	0,01
233.230 USD	21/09/2024	5,13 ⁵	Goldman Sachs Basket GSUCPSS ⁴	43.513	0,01
(863.026) USD	24/09/2024	(0,80) ³	Morgan Stanley Basket MSCBSBTU ⁶	38.410	0,01
(1.163.328) EUR	24/06/2026	3,15 ⁶	Morgan Stanley Basket MSABECDS ⁶	30.191	0,00
1.428.488 USD	10/03/2026	5,08 ⁵	Morgan Stanley Basket MSXXRTL ⁶	29.876	0,00
(656.310) USD	06/11/2024	5,08 ⁵	Morgan Stanley Basket MSXXSTAP ⁶	28.058	0,00
(630.949) USD	06/11/2024	5,08 ⁵	Morgan Stanley Basket MSABUDEF ⁶	10.147	0,00
(457.490) USD	06/11/2024	5,08 ⁵	Morgan Stanley Basket MSABCSTP ⁶	8.358	0,00

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de *swap* de rentabilidad total 0,15% (31 de diciembre de 2023: 0,21%) (cont.)

Importe notional	Fecha de extinción	Tipo variable	Entidad de referencia	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(392.840) EUR	24/06/2026	3,15 ⁵	Morgan Stanley Basket MSABECDS ⁶	8.157	0,00
(697.973) USD	06/11/2024	5,08 ⁵	Morgan Stanley Basket MSABCSTP ⁶	6.174	0,00
(89.694) USD	05/03/2025	4,99 ⁵	Morgan Stanley Basket MSNBUKWE ⁶	5.550	0,00
(1.351.740) USD	06/11/2024	5,07 ⁵	Morgan Stanley Basket MSABBIO1 ⁶	3.219	0,00
45.742 USD	21/09/2024	5,83 ⁵	Goldman Sachs Basket GSUCPSL5 ⁴	1.102	0,00
(439.055) USD	24/09/2024	(0,80) ³	Morgan Stanley Basket MSCBSMMU ⁶	764	0,00
(696.062) USD	05/03/2025	4,51 ⁵	Morgan Stanley Basket MSACWLUP ⁶	715	0,00
(45.890) USD	06/11/2024	4,59 ⁵	Morgan Stanley Basket MSXXCOTF ⁶	239	0,00
(113.489) USD	06/11/2024	5,33 ⁵	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY ⁶	145	0,00
(152.424) USD	11/02/2025	(0,80) ³	Morgan Stanley Basket MSCBSRVU ⁶	36	0,00
4.375 USD	06/11/2024	5,76 ⁵	Morgan Stanley Basket MSNBUIWM ⁶	22	0,00
747 USD	06/11/2024	5,76 ⁵	Morgan Stanley Basket MSNBUXBI ⁶	1	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de <i>swap</i> de rentabilidad total [∞]				1.286.521	0,15

¹ El SOFR a 1 día es la referencia para este contrato de *swap* de rentabilidad total.² La contraparte en este contrato de *swap* de rentabilidad total es Société Générale.³ Coste de financiación fijo.⁴ La contraparte en este contrato de *swap* de rentabilidad total es Goldman Sachs International.⁵ El FEDEF a 1 día es la referencia para este contrato de *swap* de rentabilidad total.⁶ La contraparte en este contrato de *swap* de rentabilidad total es Morgan Stanley.Contratos de *correlation swap* 0,04% (31 de diciembre de 2023: 0,02%)

Importe notional	Fecha de extinción	Contraparte	Obligación de referencia	Porcentaje de la correlación de ejercicio	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
5.000.000 USD	20/12/2024	BNP Paribas	Basket of S&P 500 /Nikkei 225 Index correlation swap	80,50%	399.351	0,04
Plusvalía latente total sobre contratos de <i>correlation swap</i> [∞]					399.351	0,04

Contratos de *swap* de varianza 0,50% (31 de diciembre de 2023: 0,24%)

Importe teórico Vega	Fecha de extinción	Contraparte	Obligación de referencia	Tipo de ejercicio de varianza	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
884.638 USD	20/11/2024	Goldman Sachs International	GS 128 Pairwise Theta Flat CoVol	Varios	798.712	0,09
250.000 EUR	21/03/2025	BNP Paribas	Russell 2000 Index vs S&P 500 Index	16,00% vs 15,05%	617.343	0,07
325.000 USD	19/12/2025	Citibank NA	FTSE MIB Index vs S&P 500 Index	50,00%	602.826	0,07
400.000 USD	20/12/2024	UBS	CITI 19 Names US Basket	Varios	374.379	0,04
250.000 USD	20/12/2024	UBS	GS 5 Index Thematic	Varios	338.246	0,04
400.000 USD	20/12/2024	Goldman Sachs International	GS 5 Index Thematic	25,69% vs 28,15%	211.520	0,02
110.000 EUR	18/12/2026	BNP Paribas	Euro Stoxx 50 Index Nikkei 225 Index	16,40% vs 20,20%	204.873	0,02
75.000 EUR	19/12/2025	BNP Paribas	Euro Stoxx 50 Index vs S&P 500 Index	16,60% vs 18,40%	153.638	0,02
62.700 EUR	19/12/2025	Goldman Sachs International	Euro Stoxx Banks Index UpVar	18,65%	145.075	0,02
400.000 USD	20/12/2024	BNP Paribas	BNP US Geo Basket	Varios	143.920	0,02
240.000 USD	20/12/2024	Goldman Sachs International	Euro Stoxx 50 Index vs S&P 500 Index	22,00% vs 24,35%	138.009	0,02

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de *swap* de varianza 0,50% (31 de diciembre de 2023: 0,24%) (cont.)

Importe teórico Vega	Fecha de extinción	Contraparte	Obligación de referencia	Tipo de ejercicio de varianza	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
400.000 USD	20/12/2024	UBS	UBS 38 Names US Basket	Varios	117.765	0,01
300.000 USD	20/12/2024	UBS	UBS 24 Names US Basket	Varios	111.929	0,01
300.000 EUR	31/07/2024	Goldman Sachs International	GS 34 Names Global Basket	Varios	109.278	0,01
110.000 EUR	20/09/2024	Morgan Stanley	Euro Stoxx 50 Index UpVar	11,25%	98.860	0,01
125.000 EUR	19/12/2025	Société Générale	SG 14 Names EU Basket	Varios	57.607	0,01
100.000 GBP	19/12/2025	BNP Paribas	Euro Stoxx 50 Index vs S&P 500 Index	16,60% vs 14,40%	44.343	0,01
125.000 GBP	20/06/2025	BNP Paribas	FTSE 100 Index UpVar	17,00%	43.711	0,01
50.000 EUR	21/03/2025	BofA Securities	Euro Stoxx Banks Index vs S&P 500 Index	23,20% vs 17,25%	37.897	0,00
100.000 EUR	19/12/2025	BNP Paribas	Euro Stoxx Banks Index UpVar	19,80%	34.784	0,00
100.000 GBP	20/06/2025	BNP Paribas	FTSE 100 Index UpVar	17,00%	31.469	0,00
200.000 EUR	20/12/2024	BNP Paribas	FTSE MIB Index vs Euro Stoxx 50 Index	22,09% vs 21,64%	26.150	0,00
500.000 USD	20/12/2024	Citibank NA	UBS 35 Names US Basket	33,80% vs 34,00% vs 35,00%	13.952	0,00
250.000 EUR	20/06/2025	BNP Paribas	Euro Stoxx 50 Index vs FTSE 100 Index	34,00% vs 33,00%	4.758	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de <i>swaps</i> de varianza ^{oo}					4.461.044	0,50

Contratos de *swap* sobre volatilidad 1,10% (31 de diciembre de 2023: 1,13%)

Importe notional	Fecha de extinción	Contraparte	Obligación de referencia ¹	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
30.000.000 USD	20/06/2025	Nomura	Nomura 20 Names Global Basket	747.247	0,08
50.000.000 USD	17/01/2025	Citibank NA	CITI 21 Names US Basket	722.088	0,08
25.000.000 USD	17/01/2025	BofA Securities	BAML 17 Names US Basket	698.753	0,08
60.000.000 EUR	20/12/2024	BNP	BNP Down Pairwise EU Basket	695.534	0,08
25.000.000 EUR	20/12/2024	BofA Securities	BAML 16 Names EU Basket	614.616	0,07
20.000.000 USD	17/01/2025	UBS	UBS 17 Names US Basket	562.767	0,06
26.666.700 USD	20/12/2024	Société Générale	SG 15 Names Global Basket	562.667	0,06
25.000.000 USD	17/01/2025	UBS	UBS 39 Names US Basket	510.819	0,06
50.010.000 USD	20/06/2025	Nomura	Nomura 31 Names Global Basket	476.592	0,05
35.000.000 EUR	18/12/2026	BNP	BNP 25 Names EU Basket	464.483	0,05
20.000.000 USD	17/01/2025	Société Générale	SG 13 Names US Basket	440.000	0,05
20.000.000 USD	20/12/2024	UBS	UBS 10 Names US Geo Basket	307.475	0,04
6.000.000.000 EUR	20/12/2024	BNP	BNP 5 Names EU Basket	301.848	0,04
30.000.000 USD	20/06/2025	UBS	UBS 20 Names US Basket	238.817	0,03
30.000.000 USD	20/06/2025	Morgan Stanley	MS 21 Names US Basket	204.721	0,02
40.000.000 USD	17/01/2025	UBS	UBS 24 Names US Basket	204.577	0,02
40.000.000 USD	17/01/2025	Citibank NA	CITI 24 Names US Basket	195.621	0,02
20.000.000 EUR	20/12/2024	BNP	BNP 15 Names EU Basket	193.903	0,02
15.000.000 USD	17/01/2025	BofA Securities	BAML 17 Names US Basket	190.918	0,02
12.500.000 USD	20/06/2025	BofA Securities	BAML 19 Names US Basket	187.790	0,02
15.000.000 USD	17/01/2025	BofA Securities	BAML 18 Names US Basket	187.262	0,02
24.260.500 USD	20/06/2025	BNP Paribas	BNP 28 Names Global Basket	124.943	0,02

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de *swap* sobre volatilidad 1,10% (31 de diciembre de 2023: 1,13%) (cont.)

Importe nacional	Fecha de extinción	Contraparte	Obligación de referencia ¹	Plusvalía latente USD	% del Patri- monio neto
14.830.000 USD	20/06/2025	Morgan Stanley	MS 31 Names Global Basket	121.410	0,01
20.000.000 USD	17/01/2025	BNP	BNP 13 Names US Basket	107.594	0,01
22.500.000 USD	20/06/2025	UBS	UBS 16 Names US Basket	103.749	0,01
13.500.000 EUR	17/01/2025	BNP	BNP 19 Names Global Basket	100.723	0,01
20.000.000 USD	17/01/2025	Morgan Stanley	MS 20 Names US Basket	96.078	0,01
15.000.000 USD	16/01/2026	Morgan Stanley	MS 17 Names US Basket	89.808	0,01
12.500.000 USD	17/01/2025	BNP	BNP 5 Names Down Geo Basket	85.589	0,01
15.000.000 USD	20/06/2025	UBS	UBS 40 Names US Basket	73.293	0,01
1.700.000 EUR	20/12/2024	Goldman Sachs International	ASML Holding NV	41.210	0,01
10.006.200 USD	16/01/2026	UBS	UBS 34 Names US Basket	39.824	0,01
6.250.000 EUR	20/12/2024	BNP	BNP 20 Names EU Basket	34.995	0,01
15.000.000 USD	17/01/2025	BofA Securities	BAML 14 Names US Basket	33.050	0,00
20.000.000 USD	17/01/2025	UBS	UBS 14 Names US Vanilla Basket	17.888	0,00
12.500.000 USD	17/01/2025	Morgan Stanley	MS 24 Names US Basket	14.131	0,00
125.000 EUR	20/12/2024	BNP	BNP 5 Names EU Down Geo Basket	9.488	0,00
125.000 EUR	20/12/2024	BNP	BNP 5 Names EU Down Geo Basket	9.488	0,00
125.000 EUR	20/12/2024	BNP	BNP 5 Names EU Down Geo Basket	9.488	0,00
62.500 EUR	20/12/2024	BNP	BNP 5 Names EU Down Geo Basket	4.744	0,00
62.500 EUR	20/12/2024	BNP	BNP 5 Names EU Down Geo Basket	4.744	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de <i>swap</i> de volatilidad²				9.830.735	1,10

¹ Los contratos de *swap* de volatilidad están denominados en varias divisas extranjeras basadas en las divisas locales de las posiciones del *swap*.

	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	730.199.337	81,80

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (1,40%) (31 de diciembre de 2023: (3,25%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patri- monio neto
80.000 AUD	53.545 USD	18/09/2024	Barclays Bank Plc	1	(8)	(0,00)
1.350.000 AUD	906.551 USD	18/09/2024	Citibank NA	3	(3.125)	(0,00)
801.771 AUD	500.000 EUR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(510)	(0,00)
200.000 AUD	183.017 CAD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(180)	(0,00)
1.370.000 AUD	919.282 USD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	3	(2.471)	(0,00)
1.080.000 BRL	195.797 USD	18/09/2024	Citibank NA	4	(3.054)	(0,00)
19.649.190 BRL	3.630.000 USD	02/07/2024	Goldman Sachs International	1	(92.442)	(0,01)
3.864.595 BRL	700.000 USD	02/08/2024	JPMorgan Chase Bank	3	(6.828)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo (1,40%) (31 de diciembre de 2023: (3,25%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
71.626.575 BRL	13.300.000 USD	02/07/2024	JPMorgan Chase Bank	51	(404.650)	(0,05)
30.000 CAD	21.999 USD	18/09/2024	Citibank NA	2	(33)	(0,00)
22.300.000 CAD	16.328.929 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	5	(28.868)	(0,00)
3.640.192 CAD	4.000.000 AUD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	8	(11.124)	(0,00)
1.465.013 CAD	1.000.000 EUR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(1.303)	(0,00)
10.000 CAD	7.337 USD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	1	(15)	(0,00)
10.000 CAD	7.337 USD	18/09/2024	UBS AG	1	(15)	(0,00)
2.050.000 CHF	2.336.644 USD	18/09/2024	Barclays Bank Plc	12	(33.286)	(0,00)
20.000 CHF	22.550 USD	18/09/2024	Citibank NA	1	(78)	(0,00)
7.500.000 CHF	8.432.452 USD	05/07/2024	Goldman Sachs International	1	(83.144)	(0,01)
13.375.000 CHF	15.117.862 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	4	(219.273)	(0,02)
21.602.168 CHF	22.650.000 EUR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	7	(221.161)	(0,02)
2.167.648 CHF	1.916.667 GBP	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	6	(8.403)	(0,00)
310.000 CHF	351.209 USD	18/09/2024	Royal Bank of Scotland	2	(2.896)	(0,00)
1.230.000 CHF	1.395.152 USD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	11	(13.138)	(0,00)
500.000 CHF	566.437 USD	18/09/2024	UBS AG	5	(4.643)	(0,00)
155.930.000 CLP	168.670 USD	23/09/2024	Barclays Bank Plc	1	(3.579)	(0,00)
94.205.570 CLP	100.000 USD	12/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(211)	(0,00)
280.712.364 CLP	300.000 USD	05/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(2.625)	(0,00)
93.612.661 CLP	100.000 USD	25/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(851)	(0,00)
94.359.399 CLP	100.000 USD	26/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(61)	(0,00)
92.551.324 CLP	100.000 USD	03/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(1.952)	(0,00)
93.574.401 CLP	100.000 USD	24/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(891)	(0,00)
90.186.590 CLP	100.000 USD	08/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(4.464)	(0,00)
26.962.224 CNY	3.753.000 USD	19/09/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(36.993)	(0,01)
207.611.656 CNY	28.655.800 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	13	(198.249)	(0,02)
2.358.408.000 COP	600.000 USD	08/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(31.710)	(0,00)
411.099.800 COP	100.000 USD	12/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(1.014)	(0,00)
2.391.645.000 COP	600.000 USD	15/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(24.431)	(0,00)
414.236.556 COP	100.000 USD	29/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(550)	(0,00)
2.062.410.000 COP	500.000 USD	26/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(4.602)	(0,00)
823.938.080 COP	200.000 USD	22/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(1.951)	(0,00)
11.100.000 CZK	482.797 USD	18/09/2024	BNP Paribas	1	(6.966)	(0,00)
4.300.000 CZK	188.537 USD	18/09/2024	Citibank NA	1	(4.206)	(0,00)
11.525.713 CZK	500.000 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(6.720)	(0,00)
643.122 EUR	2.820.000 PLN	18/09/2024	Barclays Bank Plc	4	(8.900)	(0,00)
10.000 EUR	10.773 USD	18/09/2024	Barclays Bank Plc	1	(14)	(0,00)
110.000 EUR	118.594 USD	18/09/2024	Deutsche Bank AG	1	(248)	(0,00)
240.000 EUR	9.288.264 TRY	18/09/2024	Deutsche Bank AG	3	(1.951)	(0,00)
20.669 EUR	90.000 PLN	18/09/2024	Goldman Sachs International	1	(129)	(0,00)
42.600.000 EUR	46.354.338 USD	05/07/2024	Goldman Sachs International	1	(691.552)	(0,08)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo (1,40%) (31 de diciembre de 2023: (3,25%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
1.000.000 EUR	1.090.840 USD	30/09/2024	Goldman Sachs International	1	(14.370)	(0,00)
11.000.000 EUR	125.854.723 NOK	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	6	(29.006)	(0,00)
9.055.000 EUR	7.720.889 GBP	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(52.160)	(0,02)
22.750.000 EUR	33.774.345 CAD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	5	(295.855)	(0,03)
115.077.477 EUR	124.513.855 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	7	(1.134.026)	(0,13)
1.300.000 EUR	514.866.513 HUF	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	6	(3.006)	(0,00)
500.000 EUR	2.175.694 PLN	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	4	(5.099)	(0,00)
140.000 EUR	152.366 USD	18/09/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(1.744)	(0,00)
11.250.000 EUR	129.360.310 SEK	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(158.239)	(0,02)
9.117.187 EUR	14.855.208 AUD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	7	(147.962)	(0,02)
21.375.000 EUR	20.887.659 CHF	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	6	(349.924)	(0,04)
295.535 EUR	1.290.000 PLN	18/09/2024	Royal Bank of Scotland	2	(2.628)	(0,00)
390.000 EUR	424.760 USD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	2	(5.173)	(0,00)
605.357 EUR	2.650.000 PLN	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	4	(7.282)	(0,00)
120.000 EUR	129.178 USD	18/09/2024	UBS AG	1	(74)	(0,00)
94.696 EUR	410.000 PLN	18/09/2024	UBS AG	1	(10)	(0,00)
10.000 GBP	12.761 USD	18/09/2024	Barclays Bank Plc	1	(113)	(0,00)
90.000 GBP	114.705 USD	18/09/2024	Citibank NA	3	(869)	(0,00)
6.850.000 GBP	8.728.459 USD	18/09/2024	Deutsche Bank AG	3	(64.307)	(0,02)
7.000.000 GBP	8.940.128 USD	05/07/2024	Goldman Sachs International	1	(91.275)	(0,01)
800.000 GBP	1.018.376 USD	30/09/2024	Goldman Sachs International	1	(6.416)	(0,00)
7.682.496 GBP	8.819.644 CHF	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	4	(112.412)	(0,02)
11.750.000 GBP	22.532.402 AUD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	6	(197.209)	(0,02)
8.371.741 GBP	9.900.000 EUR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	9	(31.020)	(0,00)
22.400.569 GBP	28.490.944 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	6	(173.036)	(0,02)
30.000 GBP	38.187 USD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	1	(242)	(0,00)
504.343.560 HUF	1.400.000 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(31.752)	(0,01)
194.970.700 HUF	500.000 EUR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(7.131)	(0,00)
11.640.000 HUF	31.541 USD	18/09/2024	UBS AG	1	(40)	(0,00)
2.201.660 ILS	600.000 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(15.404)	(0,00)
100.000 ILS	27.139 USD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	1	(500)	(0,00)
290.000 ILS	78.773 USD	18/09/2024	UBS AG	1	(1.519)	(0,00)
41.667.312 INR	500.000 USD	05/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(246)	(0,00)
28.703.469 JPY	280.000 AUD	18/09/2024	Barclays Bank Plc	1	(6.759)	(0,00)
75.040.000 JPY	488.828 USD	18/09/2024	Barclays Bank Plc	1	(16.635)	(0,00)
1.056.174 JPY	10.000 AUD	18/09/2024	BNP Paribas	1	(46)	(0,00)
88.613.133 JPY	840.000 AUD	18/09/2024	Citibank NA	10	(4.529)	(0,00)
2.950.000 JPY	18.591 USD	18/09/2024	Citibank NA	1	(28)	(0,00)
519.797.544 JPY	5.400.000 NZD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	8	(55.169)	(0,01)
2.609.174.835 JPY	15.450.000 EUR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	8	(324.667)	(0,05)
1.420.193.578 JPY	7.125.000 GBP	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	9	(167.594)	(0,02)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo (1,40%) (31 de diciembre de 2023: (3,25%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
2.876.715.875 JPY	18.035.433 USD	01/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(152.081)	(0,02)
23.288.225 JPY	220.000 AUD	18/09/2024	JPMorgan Chase Bank	3	(683)	(0,00)
1.166.967.228 JPY	11.200.000 AUD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	9	(217.907)	(0,02)
2.876.715.875 JPY	17.921.387 USD	08/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(21.735)	(0,00)
5.007.102.109 JPY	31.967.082 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	9	(801.955)	(0,10)
1.349.537.846 JPY	11.837.413 CAD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	8	(252.720)	(0,03)
43.621.800 JPY	250.000 CHF	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(6.968)	(0,00)
34.303.325 JPY	330.000 AUD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	3	(4.982)	(0,00)
67.940.000 JPY	442.260 USD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	2	(14.743)	(0,00)
5.292.143 JPY	50.000 AUD	18/09/2024	UBS AG	2	(160)	(0,00)
857.910.000 KRW	626.061 USD	19/09/2024	Citibank NA	1	(841)	(0,00)
275.065.136 KRW	200.000 USD	05/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(251)	(0,00)
136.667.955 KRW	100.000 USD	17/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(763)	(0,00)
1.099.646.543 KRW	800.000 USD	03/07/2024	JPMorgan Chase Bank	4	(1.237)	(0,00)
67.690.000 KRW	49.470 USD	19/09/2024	Royal Bank of Scotland	2	(139)	(0,00)
217.500.000 MXN	12.471.038 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	6	(590.681)	(0,07)
400.000 NOK	37.939 USD	18/09/2024	Citibank NA	1	(297)	(0,00)
54.034.251 NOK	4.750.000 EUR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	7	(16.794)	(0,00)
11.620.663 NOK	1.100.000 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	3	(8.372)	(0,00)
19.500.000 NOK	19.530.761 SEK	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(13.150)	(0,00)
1.200.000 NOK	114.448 USD	18/09/2024	Royal Bank of Scotland	2	(1.524)	(0,00)
2.670.000 NOK	253.799 USD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	7	(2.542)	(0,00)
2.820.000 NOK	266.465 USD	18/09/2024	UBS AG	4	(1.092)	(0,00)
50.000 NZD	30.906 USD	18/09/2024	Barclays Bank Plc	1	(439)	(0,00)
240.000 NZD	147.118 USD	18/09/2024	Citibank NA	4	(877)	(0,00)
73.406.506 NZD	68.000.000 AUD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	11	(692.159)	(0,08)
4.295.147 NZD	2.637.072 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	6	(19.828)	(0,00)
390.000 NZD	238.821 USD	18/09/2024	JPMorgan Chase Bank	3	(1.181)	(0,00)
80.000 NZD	49.152 USD	18/09/2024	Royal Bank of Canada	1	(405)	(0,00)
410.000 NZD	251.137 USD	18/09/2024	Royal Bank of Scotland	2	(1.310)	(0,00)
2.120.000 NZD	1.298.785 USD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	1	(6.995)	(0,00)
50.000 NZD	30.665 USD	18/09/2024	UBS AG	1	(198)	(0,00)
1.120.000 PLN	259.339 EUR	18/09/2024	Barclays Bank Plc	1	(678)	(0,00)
600.000 PLN	138.669 EUR	18/09/2024	Citibank NA	1	(80)	(0,00)
1.490.000 PLN	345.417 EUR	18/09/2024	Deutsche Bank AG	1	(1.335)	(0,00)
460.000 PLN	106.353 EUR	18/09/2024	HSBC Bank Plc	1	(105)	(0,00)
1.050.000 PLN	262.147 USD	18/09/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(1.206)	(0,00)
10.254.485 PLN	2.400.000 EUR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	3	(22.490)	(0,01)
33.800.495 PLN	8.600.000 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	3	(192.600)	(0,02)
170.000 PLN	42.313 USD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	1	(65)	(0,00)
720.000 PLN	166.351 EUR	18/09/2024	UBS AG	1	(41)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo (1,40%) (31 de diciembre de 2023: (3,25%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
750.000 PLN	186.992 USD	18/09/2024	UBS AG	1	(605)	(0,00)
9.190.000 SEK	880.623 USD	18/09/2024	Citibank NA	5	(9.283)	(0,00)
64.874.457 SEK	6.200.000 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	6	(71.706)	(0,01)
50.070.971 SEK	51.000.000 NOK	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	6	(60.967)	(0,00)
109.626.536 SEK	9.750.000 EUR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	5	(97.671)	(0,02)
1.430.000 SEK	137.276 USD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	2	(1.692)	(0,00)
1.200.000 SEK	115.555 USD	18/09/2024	UBS AG	1	(1.778)	(0,00)
3.040.000 SGD	2.264.465 USD	18/09/2024	Citibank NA	5	(12.893)	(0,00)
640.000 SGD	477.841 USD	18/09/2024	Deutsche Bank AG	3	(3.827)	(0,00)
10.247.735 SGD	7.600.000 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	6	(35.566)	(0,00)
22.180.000 THB	609.825 USD	18/09/2024	BNP Paribas	2	(1.512)	(0,00)
9.340.000 TRY	261.872 USD	18/09/2024	Barclays Bank Plc	2	(264)	(0,00)
14.588.770 TRY	380.000 EUR	18/09/2024	Barclays Bank Plc	3	(206)	(0,00)
78.760.000 TRY	2.206.245 USD	18/09/2024	Goldman Sachs International	1	(226)	(0,00)
329.232.494 TRY	9.252.883 USD	18/09/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(31.284)	(0,00)
10.733.968 TRY	280.000 EUR	18/09/2024	UBS AG	3	(591)	(0,00)
9.702.300 TWD	300.000 USD	24/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(929)	(0,00)
9.692.356 TWD	300.000 USD	08/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(1.339)	(0,00)
229.691.564 TWD	7.100.000 USD	05/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(21.039)	(0,00)
6.468.771 TWD	200.000 USD	03/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(613)	(0,00)
21.613 USD	230.000 NOK	18/09/2024	Barclays Bank Plc	1	(31)	(0,00)
5.956 USD	110.000 ZAR	18/09/2024	Barclays Bank Plc	1	(32)	(0,00)
1.749.733 USD	1.630.000 EUR	18/09/2024	Barclays Bank Plc	26	(3.932)	(0,00)
540.902 USD	740.000 CAD	18/09/2024	Barclays Bank Plc	13	(909)	(0,00)
543.608 USD	430.000 GBP	18/09/2024	Barclays Bank Plc	10	(271)	(0,00)
189.656 USD	261.670.000 KRW	19/09/2024	Barclays Bank Plc	5	(1.042)	(0,00)
268.546 USD	9.810.000 THB	18/09/2024	Barclays Bank Plc	3	(505)	(0,00)
46.862 USD	1.680.000 TRY	18/09/2024	Barclays Bank Plc	1	(194)	(0,00)
509.134 USD	770.000 AUD	18/09/2024	Barclays Bank Plc	3	(6.155)	(0,00)
433.620 USD	161.120.000 HUF	18/09/2024	BNP Paribas	7	(2.424)	(0,00)
105.872 USD	430.000 PLN	18/09/2024	BNP Paribas	1	(990)	(0,00)
977.214 USD	81.820.000 INR	18/09/2024	BNP Paribas	1	(1.927)	(0,00)
873.059 USD	1.320.000 AUD	18/09/2024	BNP Paribas	6	(10.292)	(0,00)
5.175.341 USD	189.100.000 THB	18/09/2024	BNP Paribas	9	(10.951)	(0,00)
676.211 USD	12.660.000 MXN	18/09/2024	BNP Paribas	5	(7.623)	(0,00)
143.979 USD	199.230.000 KRW	19/09/2024	BNP Paribas	3	(1.214)	(0,00)
337.835 USD	3.610.000 NOK	18/09/2024	BNP Paribas	3	(1.881)	(0,00)
175.097 USD	240.000 CAD	18/09/2024	BNP Paribas	4	(627)	(0,00)
37.654 USD	1.350.000 TRY	18/09/2024	BNP Paribas	1	(159)	(0,00)
901.126 USD	1.220.000 SGD	18/09/2024	BNP Paribas	3	(2.466)	(0,00)
400.776 USD	550.000 CAD	18/09/2024	Citibank NA	6	(1.923)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo (1,40%) (31 de diciembre de 2023: (3,25%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
492.229 USD	182.780.000 HUF	18/09/2024	Citibank NA	7	(2.435)	(0,00)
164.177 USD	13.760.000 INR	18/09/2024	Citibank NA	2	(489)	(0,00)
1.239.165 USD	1.709.880.000 KRW	19/09/2024	Citibank NA	9	(6.946)	(0,00)
24.447 USD	260.000 NOK	18/09/2024	Citibank NA	1	(20)	(0,00)
172.402 USD	700.000 PLN	18/09/2024	Citibank NA	2	(1.559)	(0,00)
30.699 USD	29.160.000 CLP	23/09/2024	Citibank NA	1	(174)	(0,00)
207.996 USD	3.880.000 MXN	18/09/2024	Citibank NA	4	(1.584)	(0,00)
669.983 USD	530.000 GBP	18/09/2024	Citibank NA	7	(381)	(0,00)
78.611 USD	70.000 CHF	18/09/2024	Citibank NA	1	(40)	(0,00)
418.740 USD	390.000 EUR	18/09/2024	Citibank NA	7	(848)	(0,00)
188.530 USD	310.000 NZD	18/09/2024	Citibank NA	1	(364)	(0,00)
1.154.053 USD	1.740.000 AUD	18/09/2024	Citibank NA	12	(10.370)	(0,00)
673.095 USD	910.000 SGD	18/09/2024	Citibank NA	3	(894)	(0,00)
559.907 USD	32.880.000 PHP	18/09/2024	Citibank NA	4	(2.312)	(0,00)
290.551 USD	230.000 GBP	18/09/2024	Deutsche Bank AG	3	(361)	(0,00)
809.760 USD	3.280.000 PLN	18/09/2024	Deutsche Bank AG	6	(5.371)	(0,00)
423.977 USD	583.770.000 KRW	19/09/2024	Deutsche Bank AG	4	(1.456)	(0,00)
95.920 USD	540.000 BRL	18/09/2024	Deutsche Bank AG	2	(452)	(0,00)
1.117.106 USD	40.900.000 THB	18/09/2024	Deutsche Bank AG	12	(4.624)	(0,00)
416.228 USD	15.040.000 TRY	18/09/2024	Deutsche Bank AG	2	(5.034)	(0,00)
66.541 USD	100.000 AUD	05/07/2024	Goldman Sachs International	1	(249)	(0,00)
1.200.434 USD	100.600.000 INR	18/09/2024	Goldman Sachs International	6	(3.450)	(0,00)
331.284 USD	19.500.000 PHP	18/09/2024	Goldman Sachs International	2	(2.149)	(0,00)
169.796 USD	690.000 PLN	18/09/2024	Goldman Sachs International	2	(1.680)	(0,00)
3.534.726 USD	19.649.190 BRL	02/07/2024	Goldman Sachs International	1	(2.832)	(0,00)
1.388.586 USD	1.300.000 EUR	01/07/2024	Goldman Sachs International	1	(4.690)	(0,00)
711.089 USD	13.350.000 MXN	18/09/2024	Goldman Sachs International	4	(10.015)	(0,00)
1.069.356 USD	1.000.000 EUR	05/07/2024	Goldman Sachs International	1	(2.540)	(0,00)
2.686.318 USD	3.700.000 CAD	02/07/2024	Goldman Sachs International	1	(17.669)	(0,00)
263.898 USD	9.480.000 TRY	18/09/2024	HSBC Bank Plc	2	(1.630)	(0,00)
94.210 USD	380.000 PLN	18/09/2024	HSBC Bank Plc	1	(225)	(0,00)
447.982 USD	1.810.000 PLN	18/09/2024	JPMorgan Chase Bank	3	(1.831)	(0,00)
200.000 USD	6.498.007 TWD	05/07/2024	JPMorgan Chase Bank	3	(264)	(0,00)
300.000 USD	407.096 SGD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(501)	(0,00)
600.000 USD	19.471.288 TWD	31/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(310)	(0,00)
100.000 USD	1.067.138 NOK	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(245)	(0,00)
8.000.000 USD	84.986.224 SEK	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(28.130)	(0,01)
6.700.000 USD	125.539.907 ZAR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	7	(171.079)	(0,02)
2.600.000 USD	963.052.648 HUF	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	3	(12.692)	(0,00)
1.800.899 USD	1.625.000 CHF	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(9.210)	(0,00)
400.000 USD	1.629.127 PLN	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(5.222)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo (1,40%) (31 de diciembre de 2023: (3,25%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
444.588 USD	8.300.000 MXN	18/09/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(3.739)	(0,00)
13.800.000 USD	460.962.789 TRY	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	8	(139.753)	(0,02)
100.000 USD	3.254.115 TWD	01/08/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(329)	(0,00)
100.000 USD	137.713.864 KRW	02/08/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(87)	(0,00)
5.147.046 USD	95.500.000 MXN	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	6	(69.387)	(0,01)
1.657.871 USD	1.312.500 GBP	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(1.339)	(0,00)
29.147.461 USD	43.900.000 AUD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	11	(176.660)	(0,02)
96.654 USD	90.000 EUR	18/09/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(174)	(0,00)
31.837.124 USD	43.700.000 CAD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	6	(105.148)	(0,01)
200.000 USD	189.709.394 CLP	31/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(917)	(0,00)
397.731 USD	1.665.709.148 COP	18/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(2.928)	(0,00)
100.000 USD	419.235.455 COP	02/08/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(585)	(0,00)
507.994 USD	42.451.820 INR	08/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(1.240)	(0,00)
2.031.976 USD	169.620.562 INR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	5	(2.744)	(0,00)
9.184.285 USD	768.057.541 INR	22/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(25.086)	(0,00)
5.054.465 USD	812.500.000 JPY	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(2.685)	(0,00)
200.000 USD	16.724.775 INR	01/08/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(465)	(0,00)
1.184.914 USD	99.122.144 INR	31/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(3.217)	(0,00)
1.047.062 USD	87.484.720 INR	26/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(1.767)	(0,00)
10.000.000 USD	836.108.400 INR	18/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(26.797)	(0,00)
75.554.208 USD	70.569.664 EUR	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	4	(106.759)	(0,01)
1.954.597 USD	3.207.907 NZD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(138)	(0,00)
1.200.000 USD	1.666.948.269 KRW	29/07/2024	JPMorgan Chase Bank	5	(11.218)	(0,00)
12.600.000 USD	17.433.336.618 KRW	25/07/2024	JPMorgan Chase Bank	2	(64.374)	(0,01)
14.083.739 USD	1.174.904.519 INR	05/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(7.949)	(0,00)
100.000 USD	8.349.652 INR	03/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(135)	(0,00)
100.000 USD	139.145.271 KRW	22/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(1.065)	(0,00)
13.583.739 USD	1.136.414.246 INR	25/07/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(40.910)	(0,01)
1.195.004 USD	1.640.000 CAD	18/09/2024	Royal Bank of Canada	14	(5.768)	(0,00)
710.673 USD	59.530.000 INR	18/09/2024	Royal Bank of Canada	4	(1.723)	(0,00)
60.288 USD	3.550.000 PHP	18/09/2024	Royal Bank of Scotland	1	(414)	(0,00)
669.658 USD	922.010.000 KRW	19/09/2024	Royal Bank of Scotland	8	(2.276)	(0,00)
226.256 USD	310.000 CAD	18/09/2024	Royal Bank of Scotland	4	(719)	(0,00)
112.259 USD	100.000 CHF	18/09/2024	Royal Bank of Scotland	1	(100)	(0,00)
214.797 USD	7.840.000 THB	18/09/2024	Royal Bank of Scotland	3	(223)	(0,00)
352.086 USD	29.510.000 INR	18/09/2024	Royal Bank of Scotland	2	(1.060)	(0,00)
78.979 USD	320.000 PLN	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	2	(546)	(0,00)
56.244 USD	600.000 NOK	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	1	(219)	(0,00)
880.458 USD	820.000 EUR	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	12	(1.756)	(0,00)
278.363 USD	420.000 AUD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	3	(2.704)	(0,00)
20.731 USD	3.300.000 JPY	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	1	(35)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo (1,40%) (31 de diciembre de 2023: (3,25%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
128.108 USD	2.390.000 MXN	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	2	(989)	(0,00)
170.258 USD	1.800.000 SEK	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	1	(407)	(0,00)
961.026 USD	1.320.000 CAD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	12	(5.451)	(0,00)
67.323 USD	60.000 CHF	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	1	(93)	(0,00)
664.127 USD	246.250.000 HUF	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	10	(2.310)	(0,00)
111.979 USD	4.020.000 TRY	18/09/2024	UBS AG	1	(619)	(0,00)
480.156 USD	5.130.000 NOK	18/09/2024	UBS AG	7	(2.599)	(0,00)
372.446 USD	13.700.000 THB	18/09/2024	UBS AG	3	(3.292)	(0,00)
346.023 USD	476.790.000 KRW	19/09/2024	UBS AG	5	(1.447)	(0,00)
185.770 USD	69.470.000 HUF	18/09/2024	UBS AG	2	(2.239)	(0,00)
9.104.388 USD	12.510.000 CAD	18/09/2024	UBS AG	5	(55.158)	(0,01)
8.579.708 USD	718.740.000 INR	18/09/2024	UBS AG	24	(21.467)	(0,00)
251.466 USD	1.030.000 PLN	18/09/2024	UBS AG	1	(4.505)	(0,00)
139.746 USD	230.000 NZD	18/09/2024	UBS AG	2	(401)	(0,00)
5.313.274 USD	312.420.000 PHP	18/09/2024	UBS AG	10	(28.828)	(0,00)
31.544 USD	30.010.000 CLP	23/09/2024	UBS AG	1	(229)	(0,00)
1.581.719 USD	2.390.000 AUD	18/09/2024	UBS AG	3	(17.682)	(0,00)
3.068.883 USD	108.500.000 TRY	26/08/2024	UBS AG	1	(47.102)	(0,01)
1.240.000 ZAR	67.859 USD	18/09/2024	Barclays Bank Plc	2	(359)	(0,00)
23.360.000 ZAR	1.289.920 USD	18/09/2024	Citibank NA	6	(18.305)	(0,00)
8.680.000 ZAR	478.971 USD	18/09/2024	Deutsche Bank AG	10	(6.468)	(0,00)
1.240.000 ZAR	67.999 USD	18/09/2024	JPMorgan Chase Bank	1	(499)	(0,00)
30.910.565 ZAR	1.700.000 USD	10/07/2024	JPMorgan Chase Bank	4	(8.196)	(0,00)
5.410.000 ZAR	296.755 USD	18/09/2024	Royal Bank of Scotland	1	(2.259)	(0,00)
8.730.000 ZAR	478.525 USD	18/09/2024	State Street Bank and Trust Co	5	(3.302)	(0,00)
<i>Clases CHF con cobertura</i>						
67 CHF	76 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	1	(1)	(0,00)
2.598.624 USD	2.348.901 CHF	18/07/2024	State Street Bank and Trust Co	1	(20.477)	(0,00)
2.606.002 USD	2.353.757 CHF	18/07/2024	UBS AG	2	(18.513)	(0,00)
250.975 USD	225.151 CHF	18/07/2024	Westpac Banking Corp	4	(76)	(0,00)
<i>Clases EUR con cobertura</i>						
175.849 EUR	191.690 USD	18/07/2024	State Street Bank and Trust Co	1	(3.080)	(0,00)
114.819 EUR	123.198 USD	18/07/2024	UBS AG	1	(46)	(0,00)
1.105 EUR	1.197 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	8	(10)	(0,00)
25.029.042 USD	23.397.169 EUR	18/07/2024	UBS AG	3	(66.034)	(0,01)
967.505 USD	903.309 EUR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	13	(1.356)	(0,00)
<i>Clases GBP con cobertura</i>						
10.050.004 GBP	12.765.412 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	22	(59.968)	(0,01)
6.361.201 USD	5.109.152 GBP	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	(97.904)	(0,01)
7.886.193 USD	6.284.285 GBP	18/07/2024	UBS AG	1	(58.541)	(0,01)
43.654.387 USD	34.799.713 GBP	18/07/2024	Westpac Banking Corp	40	(340.193)	(0,04)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo (1,40%) (31 de diciembre de 2023: (3,25%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases JPY con cobertura</i>						
1.855.134.179 JPY	12.213.350 USD	18/07/2024	State Street Bank and Trust Co	3	(651.988)	(0,07)
1.812.619.817 JPY	11.946.012 USD	18/07/2024	UBS AG	1	(649.604)	(0,07)
<i>Clases SGD con cobertura</i>						
20 SGD	15 USD	18/07/2024	UBS AG	1	(0)	(0,00)
107 SGD	80 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	1	(1)	(0,00)
13 USD	18 SGD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	1	(0)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(12.493.555)	(1,40)

Contratos de futuros (0,74%) (31 de diciembre de 2023: (1,51%))

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
1	1 Month SOFR Future November 2024	(21)	(0,00)
21	10-Year Mini Japanese Government Bond Future September 2024	(2.144)	(0,00)
36	3 Month CORRA Future December 2024	(37)	(0,00)
5	3 Month CORRA Future December 2025	(1.553)	(0,00)
312	3 Month CORRA Future June 2025	(19.010)	(0,00)
428	3 Month CORRA Future March 2025	(17.320)	(0,00)
100	3 Month SOFR Future August 2024	(156)	(0,00)
74	3 Month SOFR Future December 2024	(95.004)	(0,01)
4	3 Month SOFR Future December 2025	(10.938)	(0,00)
8	3 Month SOFR Future December 2026	(1.050)	(0,00)
100	3 Month SOFR Future July 2024	(156)	(0,00)
(86)	3 Month SOFR Future June 2025	(11.995)	(0,00)
7	3 Month SOFR Future June 2026	(1.413)	(0,00)
74	3 Month SOFR Future March 2025	(6.880)	(0,00)
(112)	3 Month SOFR Future March 2026	(50.970)	(0,01)
7	3 Month SOFR Future March 2027	(1.425)	(0,00)
8	3 Month SOFR Future March 2028	(1.563)	(0,00)
74	3 Month SOFR Future September 2024	(82.787)	(0,01)
(77)	3 Month SOFR Future September 2025	(42.018)	(0,01)
8	3 Month SOFR Future September 2026	(1.113)	(0,00)
(5)	3 Month SONIA Future December 2024	(853)	(0,00)
1	3 Month SONIA Future December 2025	(348)	(0,00)
4	3 Month SONIA Future December 2026	(1.707)	(0,00)
5	3 Month SONIA Future June 2025	(269)	(0,00)
2	3 Month SONIA Future June 2026	(853)	(0,00)
(7)	3 Month SONIA Future March 2025	(1.659)	(0,00)
(28)	3 Month SONIA Future March 2026	(17.365)	(0,00)
4	3 Month SONIA Future March 2027	(1.691)	(0,00)
4	3 Month SONIA Future September 2026	(1.659)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de futuros (0,74%) (31 de diciembre de 2023: (1,51%)) (cont.)

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
347	30 Day Federal Funds Future July 2024	(2.084)	(0,00)
(1)	30 Day Federal Funds Future May 2025	(563)	(0,00)
(4)	3-Month Euro EURIBOR Future December 2025	(1.099)	(0,00)
(44)	3-Month Euro EURIBOR Future June 2025	(216)	(0,00)
(92)	3-Month Euro EURIBOR Future March 2025	(20.610)	(0,00)
(2)	3-Month Euro EURIBOR Future March 2026	(415)	(0,00)
(16)	3-Month Euro EURIBOR Future September 2025	(991)	(0,00)
2	3-Month Euro EURIBOR Future September 2026	(455)	(0,00)
200	3-Month Euro EURIBOR Call Option on Future August 2024, Strike Price EUR 97.50	(233)	(0,00)
400	3-Month Euro EURIBOR Put Option on Future August 2024, Strike Price EUR 95.63	(3.115)	(0,00)
200	3-Month Euro EURIBOR Put Option on Future August 2024, Strike Price EUR 95.88	(1.550)	(0,00)
800	3-Month Euro EURIBOR Put Option on Future December 2024, Strike Price EUR 96.13	(22.722)	(0,00)
800	3-Month Euro EURIBOR Put Option on Future December 2024, Strike Price EUR 96.63	(36.230)	(0,01)
1.040	3-Month Euro EURIBOR Call Option on Future July 2024, Strike Price EUR 97.00	(1.173)	(0,00)
500	3-Month Euro EURIBOR Call Option on Future July 2024, Strike Price EUR 97.13	(583)	(0,00)
800	3-Month Euro EURIBOR Put Option on Future September 2024, Strike Price EUR 96.00	(8.836)	(0,00)
800	3-Month Euro EURIBOR Put Option on Future September 2024, Strike Price EUR 96.50	(59.279)	(0,01)
(2)	90-Day Bank Bill Future December 2025	(65)	(0,00)
743	90-Day Bank Bill Future September 2024	(186.898)	(0,02)
(560)	Australian Dollar Currency Future September 2024	(668.072)	(0,08)
6	Australian Government Bond 10-Year Future September 2024	(3.179)	(0,00)
280	BIST 30 Index Future August 2024	(1.969)	(0,00)
(10)	BMW AG December 2024	(2.144)	(0,00)
1	Brazil Real Currency Future July 2024	(40)	(0,00)
250	British Pound Currency Future September 2024	(47.412)	(0,01)
441	CAC40 Index Future July 2024	(699.077)	(0,08)
451	Canadian 10-Year Bond Future September 2024	(167.625)	(0,02)
(342)	Canadian Dollar Currency Future September 2024	(18.124)	(0,00)
74	CBOE VIX Index Future August 2024	(23.225)	(0,00)
100	CBOE VIX Index Future July 2024	(3.188)	(0,00)
(3)	DAX Index Future September 2024	(8.520)	(0,00)
9	DJIA Micro E-mini Future September 2024	(1.013)	(0,00)
4	DJIA Mini E-CBOT Future September 2024	(4.602)	(0,00)
1	E-mini Materials Future September 2024	(150)	(0,00)
24	E-mini Russell 2000 Index Future September 2024	(17.735)	(0,00)
5	E-mini Technology Future September 2024	(16.710)	(0,00)
4	E-mini Utilities Future September 2024	(5.670)	(0,00)
153	Euro Stoxx 50 Future September 2024	(98.708)	(0,01)
11	Euro Stoxx 50 Index Dividend Future December 2025	(782)	(0,00)
350	Euro STOXX Bank Index Future September 2024	(15.634)	(0,00)
(4)	Euro/Pound Sterling Currency Future September 2024	(1.770)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de futuros (0,74%) (31 de diciembre de 2023: (1,51%)) (cont.)

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(224)	Euro-BOBL Future September 2024	(29.751)	(0,00)
20	Euro-BTP Future September 2024	(25.422)	(0,00)
80	Euro-BTP Call Option on Future August 2024, Strike Price EUR 119.50	(5.258)	(0,00)
20	Euro-BTP Put Option on Future August 2024, Strike Price EUR 109.00	(1.580)	(0,00)
818	Euro-Bund Future September 2024	(758.603)	(0,09)
570	Euro-Bund Call Option on Future July 2024, Strike Price EUR 134.50	(221.552)	(0,02)
150	Euro-Bund Weekly Call Option on Future July 2024, Strike Price EUR 132.50	(33.905)	(0,00)
100	Euro-Bund Weekly Call Option on Future July 2024, Strike Price EUR 137.00	(2.863)	(0,00)
(100)	Euro-Bund Weekly Put Option on Future July 2024, Strike Price EUR 129.50	(1.175)	(0,00)
(100)	Euro-Bund Weekly Put Option on Future July 2024, Strike Price EUR 130.00	(3.580)	(0,00)
(320)	Euro-Bund Weekly Put Option on Future July 2024, Strike Price EUR 131.00	(64.496)	(0,01)
1	Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2024	(4.158)	(0,00)
68	Euro-OAT Future September 2024	(66.666)	(0,01)
(2.132)	Euro-Schatz Future September 2024	(92.599)	(0,01)
591	FTSE 100 Index Future September 2024	(369.331)	(0,04)
2	FTSE China A50 Index Future July 2024	(236)	(0,00)
132	FTSE/JSE Top 40 Index Future September 2024	(20.993)	(0,00)
55	FTSE/MIB Index Future September 2024	(72.682)	(0,01)
75	Hang Seng China Enterprises Index Future July 2024	(28.870)	(0,01)
282	Hang Seng China Enterprises Index Call Option on Future July 2024, Strike Price HKD 6,400.00	(95.222)	(0,01)
246	Hang Seng China Enterprises Index Call Option on Future July 2024, Strike Price HKD 6,500.00	(64.814)	(0,01)
202	Hang Seng China Enterprises Index Call Option on Future July 2024, Strike Price HKD 6,600.00	(31.121)	(0,00)
26	Hang Seng China Enterprises Index Call Option on Future July 2024, Strike Price HKD 6,700.00	(4.364)	(0,00)
125	Hang Seng China Enterprises Index Call Option on Future July 2024, Strike Price HKD 6,800.00	(14.416)	(0,00)
128	Hang Seng China Enterprises Index Call Option on Future July 2024, Strike Price HKD 6,900.00	(10.492)	(0,00)
52	Hang Seng China Enterprises Index Call Option on Future July 2024, Strike Price HKD 7,000.00	(2.732)	(0,00)
45	Hang Seng Index Future July 2024	(28.172)	(0,00)
17	Hang Seng Index Option on Future July 2024, Strike Price HKD 17,800.00	(2.644)	(0,00)
17	Hang Seng Index Option on Future July 2024, Strike Price HKD 18,200.00	(1.231)	(0,00)
12	Hang Seng Index Option on Future July 2024, Strike Price HKD 18,500.00	(6.484)	(0,00)
24	IBEX 35 Index Future July 2024	(35.357)	(0,01)
12	IBEX 35 Mini Index Future July 2024	(2.280)	(0,00)
(7)	Indian Rupee Currency Future July 2024	(452)	(0,00)
113	Japan Government 10-Year Bond (OSE) Future September 2024	(205.893)	(0,02)
110	Japanese Yen Currency Future September 2024	(22.822)	(0,00)
(13)	KOSPI 200 Index Future September 2024	(19.143)	(0,00)
(14)	Mini-DAX Future September 2024	(7.604)	(0,00)
13	Mini-Hang Seng China Enterprises Index Future July 2024	(1.461)	(0,00)
47	Mini-Hang Seng Index Future July 2024	(8.174)	(0,00)
34	MSCI Emerging Markets Index Future September 2024	(3.910)	(0,00)
19	NASD 100 Micro E-mini Future September 2024	(4.622)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de futuros (0,74%) (31 de diciembre de 2023: (1,51%)) (cont.)

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
79	Nasdaq 100 E-mini Future September 2024	(172.235)	(0,02)
24	New Zealand Dollar Currency Future September 2024	(4.067)	(0,00)
8	S&P 500 Consumer Staples Index September 2024	(5.690)	(0,00)
33	S&P 500 Micro E-mini Future September 2024	(381)	(0,00)
7	S&P E-mini S&P MidCap 400 Future September 2024	(11.340)	(0,00)
(85)	S&P/TSX 60 Index Future September 2024	(30.533)	(0,01)
(452)	Short-Term Euro-BTP Future September 2024	(6.088)	(0,00)
59	Stellantis NV December 2024	(8.536)	(0,00)
8	STOXX Europe 600 Index Future September 2024	(59.142)	(0,01)
3	STOXX Europe 600 Insurance Future September 2024	(241)	(0,00)
11	STOXX Europe 600 Utilities September 2024	(3.221)	(0,00)
1	Swiss Franc Currency Future September 2024	(2.156)	(0,00)
9	TAIEX Future July 2024	(6.074)	(0,00)
460	United Kingdom Long Gilt Future September 2024	(704.068)	(0,08)
(1.441)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2024	(206.041)	(0,03)
(15)	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future September 2024	(82.470)	(0,01)
(12)	US Treasury 3-Year Note (CBT) Future September 2024	(11.344)	(0,00)
713	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2024	(98.762)	(0,01)
57	US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2024	(98.031)	(0,01)
1	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2024	(3.125)	(0,00)
1.480	VSTOXX Future July 2024	(9.596)	(0,00)
(109)	WIG 20 Index Future December 2049	(32.930)	(0,01)
(219)	Yen Denominated Nikkei Future September 2024	(183.082)	(0,02)
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros *		(6.642.706)	(0,74)

Contratos de opciones suscritos (17,64%) (31 de diciembre de 2023: (23,28%))

Número de contratos/ Importe notional	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de compra				
(1.800)	13/12/2024	3 Month SONIA Call Option on Future, Strike Price GBP96.20 ±	(71.106)	(0,01)
(130.036)	01/08/2028	Advanced Energy Industries Inc, Strike Price \$137.46 ∞	(3.627.387)	(0,41)
(121.230)	29/01/2029	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$126.31 ∞	(2.559.592)	(0,29)
(125.000)	15/08/2025	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$95.00 ∞	(1.559.599)	(0,18)
(12)	19/07/2024	Charles Schwab Corp, Strike Price \$68.00 ±	(7.500)	(0,00)
(199)	19/07/2024	Charles Schwab Corp, Strike Price \$76.00 ±	(25.572)	(0,00)
(169)	19/07/2024	Charles Schwab Corp, Strike Price \$80.00 ±	(6.000)	(0,00)
(24)	19/07/2024	Charles Schwab Corp, Strike Price \$84.00 ±	(192)	(0,00)
(117.000)	20/11/2026	Confluent Inc, Strike Price \$100.06 ∞	(139.457)	(0,02)
(117.000)	18/12/2026	Confluent Inc, Strike Price \$100.06 ∞	(153.908)	(0,02)
(116.000)	15/01/2027	Confluent Inc, Strike Price \$100.06 ∞	(167.884)	(0,02)
(210.000)	15/01/2027	Conmed Corp, Strike Price \$139.47 ∞	(632.244)	(0,07)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones suscritos (17,64%) (31 de diciembre de 2023: (23,28%)) (cont.)

Número de contratos/ Importe nominal	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de compra (cont.)				
(1.395.000)	21/03/2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR15.50 [∞]	(12.782.885)	(1,43)
(120.000)	02/12/2024	Dual digital option: Xtrackers MSCI Eurozone Hedged Equity and EURO STOXX Banks Index, Strike Price EUR9.33 and EUR123.95 [∞]	(6.962)	(0,00)
(334.375)	29/08/2028	Enovis Corp, Strike Price \$58.32 [∞]	(3.718.371)	(0,42)
(110.000)	17/09/2027	Envestnet Inc, Strike Price \$73.37 [∞]	(1.550.809)	(0,17)
(110.000)	15/10/2027	Envestnet Inc, Strike Price \$73.37 [∞]	(1.591.394)	(0,18)
(110.000)	19/11/2027	Envestnet Inc, Strike Price \$73.37 [∞]	(1.642.118)	(0,18)
(370)	19/07/2024	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR5,150.00 [±]	(19.827)	(0,00)
(300.000)	15/06/2029	Fluor Corp, Strike Price \$45.50 [∞]	(4.880.812)	(0,55)
(300.000)	13/07/2029	Fluor Corp, Strike Price \$45.50 [∞]	(4.919.776)	(0,55)
(300.000)	13/08/2029	Fluor Corp, Strike Price \$45.50 [∞]	(4.963.641)	(0,56)
(50.000)	17/07/2026	Insulet Corp, Strike Price \$225.00 [∞]	(2.260.987)	(0,25)
(60)	12/07/2024	JPMorgan Chase & Co, Strike Price \$195.00 [±]	(48.000)	(0,01)
(81)	12/07/2024	JPMorgan Chase & Co, Strike Price \$200.00 [±]	(40.500)	(0,01)
(107)	12/07/2024	JPMorgan Chase & Co, Strike Price \$202.50 [±]	(39.858)	(0,00)
(43)	12/07/2024	JPMorgan Chase & Co, Strike Price \$210.00 [±]	(4.838)	(0,00)
(80.000)	15/12/2028	Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$108.00 [∞]	(2.173.866)	(0,24)
(175)	17/01/2025	MetLife Inc, Strike Price \$70.00 [±]	(100.625)	(0,01)
(500.000.000) MXN	05/07/2024	Mexican Peso/Chinese Yuan Renminbi Currency Option, Strike Price CNY0.45 [∞]	(0)	(0,00)
(112.500)	18/07/2025	Middleby Corp, Strike Price \$130.00 [∞]	(1.619.832)	(0,18)
(446.500)	09/02/2029	ON Semiconductor Corp, Strike Price \$103.87 [∞]	(8.943.381)	(1,00)
(446.500)	16/02/2029	ON Semiconductor Corp, Strike Price \$103.87 [∞]	(8.975.259)	(1,01)
(2)	19/07/2024	Rocket Companies Inc, Strike Price \$18.00 [±]	(10)	(0,00)
(1)	19/07/2024	S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price \$5,400.00 [±]	(7.025)	(0,00)
(55)	15/11/2024	S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price \$5,600.00 [±]	(448.250)	(0,05)
(3)	20/12/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$4,500.00 [±]	(326.445)	(0,04)
(1)	18/10/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$4,600.00 [±]	(94.670)	(0,01)
(6)	17/01/2025	S&P 500 Index, Strike Price \$4,750.00 [±]	(530.130)	(0,06)
(8)	20/12/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$4,900.00 [±]	(578.720)	(0,07)
(10)	17/01/2025	S&P 500 Index, Strike Price \$4,900.00 [±]	(751.050)	(0,08)
(2)	20/12/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$5,000.00 [±]	(127.180)	(0,01)
(1)	20/12/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$5,050.00 [±]	(59.355)	(0,01)
(8)	17/01/2025	S&P 500 Index, Strike Price \$5,075.00 [±]	(481.280)	(0,05)
(12)	17/01/2025	S&P 500 Index, Strike Price \$5,225.00 [±]	(576.120)	(0,07)
(6)	20/12/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$5,300.00 [±]	(234.180)	(0,03)
(20)	17/01/2025	S&P 500 Index, Strike Price \$5,375.00 [±]	(732.900)	(0,08)
(3)	20/09/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$5,500.00 [±]	(40.155)	(0,00)
(16)	20/12/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$5,500.00 [±]	(398.640)	(0,05)
(2)	20/12/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$5,550.00 [±]	(43.570)	(0,01)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones suscritos (17,64%) (31 de diciembre de 2023: (23,28%)) (cont.)

Número de contratos/ Importe nominal	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de compra (cont.)				
(24)	17/01/2025	S&P 500 Index, Strike Price \$5,575.00 ±	(559.560)	(0,06)
(11)	17/01/2025	S&P 500 Index, Strike Price \$5,700.00 ±	(180.290)	(0,02)
(18)	17/01/2025	S&P 500 Index, Strike Price \$5,900.00 ±	(148.680)	(0,02)
(14)	20/12/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$6,000.00 ±	(56.700)	(0,01)
(1)	20/12/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$6,100.00 ±	(2.530)	(0,00)
(20)	17/01/2025	S&P 500 Index, Strike Price \$6,100.00 ±	(73.200)	(0,01)
(216.740)	01/05/2028	Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price \$82.47 ∞	(8.362.295)	(0,94)
(400.000)	21/01/2028	Semtech Corp, Strike Price \$37.00 ∞	(4.943.102)	(0,55)
(2.090)	19/07/2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price \$67.88 ∞	(1.346.306)	(0,15)
(300)	05/07/2024	SOFR 1 Year Mid-Curve Call Option on Future, Strike Price \$96.00 ±	(26.250)	(0,00)
(894.454)	28/02/2030	Stem Inc, Strike Price \$7.13 ∞	(512.173)	(0,06)
(1)	17/07/2024	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD22,200.00 ±	(1.410)	(0,00)
(80)	17/07/2024	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD22,700.00 ±	(67.198)	(0,01)
(59)	17/07/2024	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD22,800.00 ±	(44.830)	(0,01)
(26)	17/07/2024	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD22,900.00 ±	(17.351)	(0,00)
(210)	17/07/2024	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD23,000.00 ±	(124.609)	(0,01)
(77)	17/07/2024	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD23,100.00 ±	(39.400)	(0,00)
(47)	17/07/2024	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD23,300.00 ±	(18.182)	(0,00)
(77)	17/07/2024	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD23,400.00 ±	(25.871)	(0,00)
(109)	17/07/2024	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD23,500.00 ±	(30.911)	(0,00)
(127.138)	17/07/2028	Tetra Tech Inc, Strike Price \$196.64 ∞	(7.733.041)	(0,87)
(64)	19/07/2024	Uber Technologies Inc, Strike Price \$70.00 ±	(21.760)	(0,00)
(21.261.000) USD	05/03/2026	United States Dollar/Japanese Yen Currency Option, Strike Price JPY137.00 ∞	(1.942.235)	(0,22)
(818.777)	25/10/2028	Wayfair Inc, Strike Price \$45.80 ∞	(26.955.604)	(3,02)
(249.066)	16/10/2028	Western Digital Corp, Strike Price \$52.20 ∞	(10.047.413)	(1,13)
(120.000)	19/10/2029	Wolfspeed Inc, Strike Price \$120.00 ∞	(653.398)	(0,07)
Opciones de venta				
(400)	13/12/2024	3 Month SOFR Put Option on Future, Strike Price \$94.38 ±	(5.000)	(0,00)
(400)	11/10/2024	3 Month SOFR Put Option on Future, Strike Price \$94.63 ±	(5.000)	(0,00)
(2.000)	13/12/2024	3 Month SONIA Put Option on Future, Strike Price GBP94.70 ±	(79.006)	(0,01)
(20.806)	09/09/2024	Advanced Energy Industries Inc, Strike Price \$111.45 ∞	(155.855)	(0,02)
(53.892)	15/08/2025	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$104.07 ∞	(924.124)	(0,10)
(33.950)	21/08/2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price \$109.08 ∞	(633.086)	(0,07)
(62)	19/07/2024	Boyd Gaming Corp, Strike Price \$55.00 ±	(6.820)	(0,00)
(20)	19/07/2024	Charles Schwab Corp, Strike Price \$64.00 ±	(260)	(0,00)
(174)	19/07/2024	Charles Schwab Corp, Strike Price \$68.00 ±	(7.221)	(0,00)
(201)	19/07/2024	Charles Schwab Corp, Strike Price \$72.00 ±	(27.738)	(0,00)
(5)	19/07/2024	Charles Schwab Corp, Strike Price \$78.00 ±	(2.200)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones suscritos (17,64%) (31 de diciembre de 2023: (23,28%)) (cont.)

Número de contratos/ Importe notional	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de venta (cont.)				
(11.700)	20/11/2026	Confluent Inc, Strike Price \$76.14 [∞]	(481.182)	(0,05)
(11.700)	18/12/2026	Confluent Inc, Strike Price \$76.28 [∞]	(482.141)	(0,05)
(11.600)	15/01/2027	Confluent Inc, Strike Price \$76.41 [∞]	(478.813)	(0,05)
(70.547)	15/01/2027	Conmed Corp, Strike Price \$110.88 [∞]	(2.605.869)	(0,29)
(1.448.995)	21/03/2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR10.99 [∞]	(16.401)	(0,00)
(1.448.995)	21/03/2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR11.83 [∞]	(21.935)	(0,00)
(103.656)	30/10/2024	Enovis Corp, Strike Price \$47.45 [∞]	(408.644)	(0,05)
(92.400)	15/10/2027	Envestnet Inc, Strike Price \$72.69 [∞]	(1.286.421)	(0,14)
(173.640)	09/08/2024	Fluor Corp, Strike Price \$36.19 [∞]	(45.043)	(0,01)
(10.659)	17/07/2026	Insulet Corp, Strike Price \$321.48 [∞]	(1.151.135)	(0,13)
(13)	12/07/2024	JPMorgan Chase & Co, Strike Price \$190.00 [±]	(715)	(0,00)
(27)	12/07/2024	JPMorgan Chase & Co, Strike Price \$192.50 [±]	(2.390)	(0,00)
(74)	12/07/2024	JPMorgan Chase & Co, Strike Price \$197.50 [±]	(16.021)	(0,00)
(93)	12/07/2024	JPMorgan Chase & Co, Strike Price \$205.00 [±]	(52.778)	(0,01)
(12.952)	15/12/2028	Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$101.56 [∞]	(230.453)	(0,03)
(175)	17/01/2025	MetLife Inc, Strike Price \$65.00 [±]	(45.062)	(0,01)
(45.713)	18/07/2025	Middleby Corp, Strike Price \$150.83 [∞]	(1.205.920)	(0,14)
(151.810)	28/02/2025	ON Semiconductor Corp, Strike Price \$80.75 [∞]	(2.255.762)	(0,25)
(122)	17/07/2024	POSCO Holdings Inc, Strike Price KRW488,000.00 [∞]	(10.992)	(0,00)
(65)	31/07/2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$4,800.00 [±]	(8.775)	(0,00)
(65)	30/08/2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$4,900.00 [±]	(37.375)	(0,00)
(59)	20/09/2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$5,200.00 [±]	(123.900)	(0,01)
(1)	19/07/2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price \$5,380.00 [±]	(825)	(0,00)
(36)	17/01/2025	S&P 500 Index, Strike Price \$2,600.00 [±]	(13.500)	(0,00)
(70)	17/01/2025	S&P 500 Index, Strike Price \$2,700.00 [±]	(29.050)	(0,00)
(20)	20/12/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$3,100.00 [±]	(10.000)	(0,00)
(24)	17/01/2025	S&P 500 Index, Strike Price \$3,325.00 [±]	(20.160)	(0,00)
(45)	17/01/2025	S&P 500 Index, Strike Price \$3,425.00 [±]	(42.075)	(0,01)
(42)	20/12/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$3,500.00 [±]	(33.390)	(0,00)
(5)	20/12/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$3,525.00 [±]	(4.100)	(0,00)
(60)	17/01/2025	S&P 500 Index, Strike Price \$3,550.00 [±]	(63.900)	(0,01)
(14)	20/12/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$3,800.00 [±]	(15.610)	(0,00)
(17)	17/01/2025	S&P 500 Index, Strike Price \$4,050.00 [±]	(31.110)	(0,00)
(32)	17/01/2025	S&P 500 Index, Strike Price \$4,150.00 [±]	(65.760)	(0,01)
(28)	20/12/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$4,250.00 [±]	(53.340)	(0,01)
(3)	20/12/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$4,300.00 [±]	(6.105)	(0,00)
(40)	17/01/2025	S&P 500 Index, Strike Price \$4,300.00 [±]	(98.600)	(0,01)
(1)	18/10/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$4,500.00 [±]	(1.305)	(0,00)
(9)	20/12/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$4,500.00 [±]	(24.165)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones suscritos (17,64%) (31 de diciembre de 2023: (23,28%)) (cont.)

Número de contratos/ Importe nominal	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Opciones de venta (cont.)				
(11)	17/01/2025	S&P 500 Index, Strike Price \$4,750.00 ±	(51.150)	(0,01)
(18)	17/01/2025	S&P 500 Index, Strike Price \$4,900.00 ±	(106.470)	(0,01)
(14)	20/12/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$5,000.00 ±	(85.890)	(0,01)
(1)	20/12/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$5,050.00 ±	(6.715)	(0,00)
(16)	17/01/2025	S&P 500 Index, Strike Price \$5,075.00 ±	(127.360)	(0,01)
(36.846)	09/09/2024	Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price \$64.30 ∞	(1.724)	(0,00)
(58.277)	21/01/2028	Semtech Corp, Strike Price \$41.74 ∞	(1.013.678)	(0,11)
(1.050)	19/07/2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price \$66.42 ∞	(79.185)	(0,01)
(1.050)	16/08/2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price \$66.42 ∞	(287.896)	(0,03)
(300)	05/07/2024	SOFR 1 Year Mid-Curve Put Option on Future, Strike Price \$95.69 ±	(11.250)	(0,00)
(89.445)	28/03/2025	Stem Inc, Strike Price \$2.25 ∞	(112.834)	(0,01)
(15)	17/07/2024	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD22,100.00 ±	(2.728)	(0,00)
(14)	17/07/2024	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD22,200.00 ±	(2.913)	(0,00)
(35)	17/07/2024	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD22,600.00 ±	(12.677)	(0,00)
(26)	17/07/2024	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD22,700.00 ±	(10.819)	(0,00)
(36)	17/07/2024	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD22,800.00 ±	(17.367)	(0,00)
(70)	17/07/2024	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD22,900.00 ±	(37.760)	(0,00)
(102)	17/07/2024	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD23,000.00 ±	(62.882)	(0,01)
(86)	17/07/2024	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD23,100.00 ±	(59.911)	(0,01)
(62)	17/07/2024	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD23,200.00 ±	(48.734)	(0,01)
(34.900)	19/08/2024	Tetra Tech Inc, Strike Price \$165.63 ∞	(30.554)	(0,00)
(500.000) USD	23/08/2024	United States Dollar/Turkish Lira Currency Option, Strike Price TRY33.50 ∞	(142.423)	(0,02)
(67.500)	13/05/2025	Wayfair Inc, Strike Price \$75.94 ∞	(1.751.980)	(0,20)
(41.096)	07/11/2024	Western Digital Corp, Strike Price \$42.46 ∞	(8.380)	(0,00)
(21.739)	19/10/2029	Wolfspeed Inc, Strike Price \$107.31 ∞	(1.509.047)	(0,17)
Total valor razonable en contratos de opciones suscritos (Prima: 166.665.662 USD)			(157.507.520)	(17,64)

Las contrapartes de los Contratos de opciones extrabursátiles (OTC) son BNP Paribas, Goldman Sachs International y JPMorgan Chase Bank.

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%))

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patri- monio neto
1.000	3M Co	Goldman Sachs International	(652)	(0,00)
69.717	3M Co	Morgan Stanley	(7.187)	(0,00)
(288.075)	89bio Inc	Goldman Sachs International	(49.139)	(0,01)
(53.195)	89bio Inc	JPMorgan Chase Bank	(4.209)	(0,00)
(239.552)	Abbott Laboratories	Goldman Sachs International	(5.106)	(0,00)
149.516	AbbVie Inc	JPMorgan Chase Bank	(201)	(0,00)
553.944	AbbVie Inc	Goldman Sachs International	(39.103)	(0,01)
(5.059.750)	Absa Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	(11.556)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(1.852.901)	Absa Group Ltd	Goldman Sachs International	(3.715)	(0,00)
(704.932)	Absa Group Ltd	Morgan Stanley	(1.404)	(0,00)
(524.338)	Academy Sports & Outdoors Inc	Morgan Stanley	(63.911)	(0,01)
200	Accenture Plc Class A	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(82.718)	Accenture Plc Class A	Morgan Stanley	(1.068)	(0,00)
(82.417)	Accor SA	Goldman Sachs International	(2.593)	(0,00)
(331.226)	Accor SA	JPMorgan Chase Bank	(8.294)	(0,00)
90.794	Addus HomeCare Corp	Goldman Sachs International	(24.546)	(0,01)
(18)	Adeia Inc	Goldman Sachs International	(7)	(0,00)
(1.200)	Adobe Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
27.027	Advanced Micro Devices Inc	Morgan Stanley	(2.475)	(0,00)
(132.060)	AECOM	Morgan Stanley	(43)	(0,00)
(131.273)	AES Corp	Morgan Stanley	(13.145)	(0,00)
(500)	Aflac Inc	Goldman Sachs International	(89)	(0,00)
73.838	Aflac Inc	Morgan Stanley	(4.051)	(0,00)
42.324	Agilent Technologies Inc	JPMorgan Chase Bank	(3.854)	(0,00)
31.876	agilon health Inc	Morgan Stanley	(6.040)	(0,00)
(277.061)	agilon health Inc	Goldman Sachs International	(12.238)	(0,00)
41.782	Agree Realty Corp	Morgan Stanley	(2.887)	(0,00)
43.628	Air Lease Corp	Morgan Stanley	(64)	(0,00)
72.143	Air Products & Chemicals Inc	Morgan Stanley	(4.715)	(0,00)
100	Air Products & Chemicals Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
13.286	Airbnb Inc Class A	Morgan Stanley	(270)	(0,00)
101.527	Airbnb Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(4.215)	(0,00)
38.309	Airbnb Inc Class A	Goldman Sachs International	(1.056)	(0,00)
78.488	Akamai Technologies Inc	Morgan Stanley	(169)	(0,00)
500	Akamai Technologies Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(34)	Alamo Group Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(4.559)	Alarm.com Holdings Inc	Goldman Sachs International	(306)	(0,00)
(93.756)	Alarm.com Holdings Inc	Morgan Stanley	(5.637)	(0,00)
(41.293)	Alarm.com Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.017)	(0,00)
18	Albany International Corp Class A	Goldman Sachs International	(22)	(0,00)
(440.901)	Albertsons Cos Inc Class A	Morgan Stanley	(52.007)	(0,01)
(57.919)	Alector Inc	Goldman Sachs International	(5.870)	(0,00)
(244.976)	Alector Inc	JPMorgan Chase Bank	(89.555)	(0,01)
(11)	Alexander & Baldwin Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(300)	Alexandria Real Estate Equities Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
14.200.000	Alibaba Group Holding Ltd	Nomura	(3.766)	(0,00)
(139.667)	Align Technology Inc	Morgan Stanley	(6.710)	(0,00)
(588.691)	Alkermes Plc	JPMorgan Chase Bank	(88.438)	(0,01)
(76.602)	Alkermes Plc	Goldman Sachs International	(1.504)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
700	Allegion Plc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
(445.183)	Allegro.eu SA	JPMorgan Chase Bank	(6.210)	(0,00)
(100)	Allstate Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
45.069	Alphabet Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(3.117)	(0,00)
2.217	Alphabet Inc Class A	Goldman Sachs International	(38)	(0,00)
89.949	Alphabet Inc Class C	Goldman Sachs International	(4.892)	(0,00)
44.826	Alphabet Inc Class C	JPMorgan Chase Bank	(3.333)	(0,00)
100	Amazon.com Inc	Goldman Sachs International	(430)	(0,00)
1.700	Amcort Plc	Goldman Sachs International	(68)	(0,00)
(74.376)	Amdocs Ltd	Morgan Stanley	(3.235)	(0,00)
(88.943)	Amedisys Inc	Morgan Stanley	(140)	(0,00)
(300)	Ameren Corp	Goldman Sachs International	(28)	(0,00)
41.089	American Airlines Group Inc	Morgan Stanley	(562)	(0,00)
(1.800)	American Airlines Group Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
400	American Electric Power Co Inc	Goldman Sachs International	(55)	(0,00)
104.595	American Express Co	Goldman Sachs International	(1.224)	(0,00)
200	American International Group Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
76.398	American Water Works Co Inc	Morgan Stanley	(1.652)	(0,00)
300	American Water Works Co Inc	Goldman Sachs International	(311)	(0,00)
(37)	AMERISAFE Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(538.533)	AmerisourceBergen Corp	Goldman Sachs International	(2.904)	(0,00)
128.541	Amgen Inc	Goldman Sachs International	(20.444)	(0,00)
533.023	Amgen Inc	JPMorgan Chase Bank	(14.506)	(0,00)
97.156	Amphenol Corp Class A	Morgan Stanley	(14.097)	(0,00)
338.239.200	ANA Holdings Inc	Nomura	(170.411)	(0,02)
63.409	Analog Devices Inc	Morgan Stanley	(15.678)	(0,00)
66.625	Annaly Capital Management Inc	Morgan Stanley	(5.723)	(0,00)
100	ANSYS Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
192.607	Antero Midstream Corp	JPMorgan Chase Bank	(36.164)	(0,01)
34.839	Antero Resources Corp	Morgan Stanley	(9.064)	(0,00)
(300)	AO Smith Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
78.352	Aon Plc Class A	Morgan Stanley	(352)	(0,00)
(140.529)	APA Corp	Morgan Stanley	(8.369)	(0,00)
(1.800)	APA Corp	Goldman Sachs International	(1.468)	(0,00)
37	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
74.060	Appfolio Inc Class A	Goldman Sachs International	(4.369)	(0,00)
184.776	Appfolio Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(7.888)	(0,00)
185.430	Apple Inc	Goldman Sachs International	(19.498)	(0,00)
531.514	Aptiv Plc	JPMorgan Chase Bank	(19.473)	(0,00)
(26.269)	Aptiv Plc	Morgan Stanley	(2.389)	(0,00)
354.862	Aptiv Plc	Goldman Sachs International	(6.638)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
66.647	Arcellx Inc	Goldman Sachs International	(2.337)	(0,00)
74.218	Arcellx Inc	JPMorgan Chase Bank	(5.766)	(0,00)
(29.750)	Arcus Biosciences Inc	Goldman Sachs International	(4.093)	(0,00)
(30.540)	Arcus Biosciences Inc	JPMorgan Chase Bank	(7.302)	(0,00)
(270.781)	Argenx SE	Goldman Sachs International	(21.509)	(0,00)
39	Arlo Technologies Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(1)	Armada Hoffer Properties Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(94.262)	Armstrong World Industries Inc	Morgan Stanley	(4.357)	(0,00)
69.942	Arthur J Gallagher & Co	Morgan Stanley	(8.584)	(0,00)
100	Arthur J Gallagher & Co	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
50	Artivion Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
81.262	Ascendis Pharma A/S	Goldman Sachs International	(4.704)	(0,00)
81.942	Ascendis Pharma A/S	JPMorgan Chase Bank	(2.535)	(0,00)
8.177	ASGN Inc	JPMorgan Chase Bank	(104)	(0,00)
41.889	Asia Vital Components Co Ltd	Morgan Stanley	(2.943)	(0,00)
78.327	Aspen Technology Inc	Morgan Stanley	(527)	(0,00)
(91.092)	ASR Nederland NV	JPMorgan Chase Bank	(385)	(0,00)
(226.504)	Assicurazioni Generali	Goldman Sachs International	(2.201)	(0,00)
(200)	Assurant Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(95.009)	Assured Guaranty Ltd	Morgan Stanley	(5.229)	(0,00)
35	Astec Industries Inc	Goldman Sachs International	(16)	(0,00)
(492.131)	AstraZeneca Plc	Goldman Sachs International	(6.170)	(0,00)
600	AT&T Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
70.128	AT&T Inc	Morgan Stanley	(6.187)	(0,00)
67.073	Atlassian Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	(2.224)	(0,00)
70.756	Atmos Energy Corp	Morgan Stanley	(7.539)	(0,00)
(300)	Atmos Energy Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
44.761	AURAS Technology Co Ltd	Morgan Stanley	(2.626)	(0,00)
44.899	Autodesk Inc	Morgan Stanley	(3.898)	(0,00)
(356.724)	Autoliv Inc	Goldman Sachs International	(5.155)	(0,00)
(148.965)	Autoliv Inc	JPMorgan Chase Bank	(3.652)	(0,00)
(100)	AutoZone Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
72.843	AutoZone Inc	Morgan Stanley	(4.197)	(0,00)
(200)	AvalonBay Communities Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(46)	Avanos Medical Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
69.699	Avantor Inc	Morgan Stanley	(4.213)	(0,00)
(300)	Avery Dennison Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(200)	Axon Enterprise Inc	Goldman Sachs International	(57)	(0,00)
1.100	Baker Hughes Co	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
(2.900.000)	Balder Finland OYJ	BNP Paribas	(1.536)	(0,00)
66.484	Ball Corp	Morgan Stanley	(9.829)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
1.200	Ball Corp	Goldman Sachs International	(1.490)	(0,00)
(173.343)	Banca Mediolanum SpA	Goldman Sachs International	(6.568)	(0,00)
(130.897)	Banca Mediolanum SpA	JPMorgan Chase Bank	(5.880)	(0,00)
(133.795)	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	Goldman Sachs International	(13.064)	(0,00)
(50)	BancFirst Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
4.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Société Générale	(136.094)	(0,02)
(266.999)	Banco Bradesco SA	Goldman Sachs International	(2.586)	(0,00)
212.154	Banco Comercial Portugues SA	Goldman Sachs International	(4.473)	(0,00)
59.570	Banco Comercial Portugues SA	JPMorgan Chase Bank	(215)	(0,00)
(190.034)	Banco Do Brasil SA	Goldman Sachs International	(1.349)	(0,00)
1.800	Bank of America Corp	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
69.631	Bank of America Corp	Morgan Stanley	(8.451)	(0,00)
74.574	Bank of New York Mellon Corp	Morgan Stanley	(3.690)	(0,00)
600	Bank of New York Mellon Corp	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
(121.879)	Bankinter SA	Goldman Sachs International	(2.515)	(0,00)
(105.581)	Barclays Plc	Goldman Sachs International	(4.730)	(0,00)
(8.635)	Baxter International Inc	JPMorgan Chase Bank	(684)	(0,00)
(55.828)	Baxter International Inc	Morgan Stanley	(15.038)	(0,00)
1.600	Baxter International Inc	Goldman Sachs International	(292)	(0,00)
(566.446)	BB Seguridade Participacoes SA	Goldman Sachs International	(1.956)	(0,00)
(319.546)	BB Seguridade Participacoes SA	Morgan Stanley	(44)	(0,00)
(599.246)	Becton Dickinson & Co	Goldman Sachs International	(8.594)	(0,00)
(48.527)	Becton Dickinson & Co	JPMorgan Chase Bank	(1.054)	(0,00)
(797)	BeiGene Ltd	JPMorgan Chase Bank	(89)	(0,00)
(29.328)	BeiGene Ltd	Goldman Sachs International	(8.361)	(0,00)
(228.064)	BellRing Brands Inc	Morgan Stanley	(697)	(0,00)
43.886	Berry Global Group Inc	Morgan Stanley	(22)	(0,00)
337.057	Best Buy Co Inc	Morgan Stanley	(21.256)	(0,00)
5.286.393	Bid Corp Ltd	Goldman Sachs International	(4.510)	(0,00)
(6.447)	Bill.com Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	(98)	(0,00)
(187.899)	Bill.com Holdings Inc	Goldman Sachs International	(10.636)	(0,00)
(400)	Biogen Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(505.251)	Biogen Inc	JPMorgan Chase Bank	(1.602)	(0,00)
(100)	Bio-Rad Laboratories Inc Class A	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
214.476	Birkenstock Holding Plc	Morgan Stanley	(32.171)	(0,01)
37.213	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	Morgan Stanley	(7.336)	(0,00)
500	Blackstone Inc	Goldman Sachs International	(90)	(0,00)
(134.981)	Block Inc	Morgan Stanley	(827)	(0,00)
35.336	Block Inc	JPMorgan Chase Bank	(916)	(0,00)
(36.380)	Block Inc	Goldman Sachs International	(17)	(0,00)
33.297	Blue Owl Capital Inc	Morgan Stanley	(9.098)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
3.800.000	BNP Paribas SA	Société Générale	(69.039)	(0,01)
(159.942)	BNP Paribas SA	Goldman Sachs International	(1.512)	(0,00)
73.831	Boeing Co	Morgan Stanley	(4.365)	(0,00)
44.870	BOK Financial Corp	Morgan Stanley	(903)	(0,00)
388.335	Booking Holdings Inc	Morgan Stanley	(67.122)	(0,01)
161.830	Booking Holdings Inc	Goldman Sachs International	(4.511)	(0,00)
(95.480)	BorgWarner Inc	Morgan Stanley	(8.008)	(0,00)
(1.100)	BorgWarner Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
1.300	Boston Properties Inc	Goldman Sachs International	(352)	(0,00)
(7.116)	Boston Scientific Corp	JPMorgan Chase Bank	(47)	(0,00)
(61.675)	BPER Banca	JPMorgan Chase Bank	(589)	(0,00)
161.365	Bridgebio Pharma Inc	Goldman Sachs International	(12.741)	(0,00)
36.800	Bright Horizons Family Solutions Inc	Morgan Stanley	(9.231)	(0,00)
200	Bristol-Myers Squibb Co	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
73.341	Brown & Brown Inc	Morgan Stanley	(3.575)	(0,00)
(349.681)	Brown-Forman Corp Class B	JPMorgan Chase Bank	(62.241)	(0,01)
(105.072)	Brown-Forman Corp Class B	Morgan Stanley	(22.717)	(0,01)
(372.646)	Brown-Forman Corp Class B	Goldman Sachs International	(77.949)	(0,01)
(34.697)	Bruker Corp	Morgan Stanley	(402)	(0,00)
(200)	Bunge Global SA	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(88.955)	BWX Technologies Inc	Morgan Stanley	(407)	(0,00)
505.377	Cactus Inc Class A	Goldman Sachs International	(16.628)	(0,00)
163.502	Cactus Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(12.983)	(0,00)
400	Cadence Design Systems Inc	Goldman Sachs International	(1.433)	(0,00)
61.580	Caesars Entertainment Inc	Morgan Stanley	(15.358)	(0,00)
2.000	Caesars Entertainment Inc	Goldman Sachs International	(2)	(0,00)
(500)	Camden Property Trust	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
1.200	Campbell Soup Co	Goldman Sachs International	(36)	(0,00)
75.960	Campbell Soup Co	Morgan Stanley	(1.196)	(0,00)
449.052	Canadian Pacific Kansas City Ltd	Goldman Sachs International	(3.123)	(0,00)
300	Capital One Financial Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
33	Capitol Federal Financial Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(162.148)	Capri Holdings Ltd	Morgan Stanley	(14.516)	(0,00)
13	Cargurus Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
54.457	Carlisle Cos Inc	Morgan Stanley	(22.343)	(0,00)
70.291	Carlyle Group Inc	Morgan Stanley	(6.952)	(0,00)
75.644	CarMax Inc	Morgan Stanley	(1.904)	(0,00)
(400)	CarMax Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
4.900.000	Carnival Corp	Nomura	(22.367)	(0,01)
67.077	Carrier Global Corp	Morgan Stanley	(10.275)	(0,00)
37.086	Casey's General Stores Inc	Morgan Stanley	(7.820)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
200	Catalent Inc	Goldman Sachs International	(28)	(0,00)
296	CATCHA INVT Corp	Goldman Sachs International	(37)	(0,00)
224.648	Caterpillar Inc	Goldman Sachs International	(8.022)	(0,00)
25.268	Cava Group Inc	Morgan Stanley	(19.964)	(0,00)
19.594	Cboe Global Markets Inc	Morgan Stanley	(862)	(0,00)
1.400	CBRE Group Inc Class A	Goldman Sachs International	(23)	(0,00)
78.050	CDW Corp	Morgan Stanley	(166)	(0,00)
81.952	Celldex Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(11.746)	(0,00)
51.366	Celldex Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	(3.657)	(0,00)
78.319	Celsius Holdings Inc	Morgan Stanley	(39)	(0,00)
(600)	Cencora Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
(400)	Centene Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(136.989)	Centene Corp	Morgan Stanley	(6.062)	(0,00)
72.853	CenterPoint Energy Inc	Morgan Stanley	(3.956)	(0,00)
1.000	CenterPoint Energy Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
46	Centerspace	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(32)	Central Garden & Pet Co	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(23)	Central Pacific Financial Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(163.218)	Ceridian HCM Holding Inc	Goldman Sachs International	(30.929)	(0,00)
(33.729)	Ceridian HCM Holding Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.333)	(0,00)
41.661	Certara Inc	Morgan Stanley	(821)	(0,00)
43	CEVA Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(700)	CF Industries Holdings Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
72.934	CH Robinson Worldwide Inc	Morgan Stanley	(4.951)	(0,00)
(100)	CH Robinson Worldwide Inc	Goldman Sachs International	(133)	(0,00)
(1.052)	Charles River Laboratories International Inc	Goldman Sachs International	(450)	(0,00)
72.228	Charles Schwab Corp	Morgan Stanley	(6.131)	(0,00)
300	Charter Communications Inc Class A	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
100	Chevron Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
11.900	Chewy Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(2.506)	(0,00)
(500)	Chipotle Mexican Grill Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
200	Chubb Ltd	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
3.015.896	Chugai Pharmaceutical Co	Goldman Sachs International	(6.178)	(0,00)
70.344	Church & Dwight Co Inc	Morgan Stanley	(7.179)	(0,00)
200	Cigna Group	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
12.800	CinCor Pharma Inc	Morgan Stanley	(19.968)	(0,00)
(500)	Cisco Systems Inc	Goldman Sachs International	(700)	(0,00)
800	Citigroup Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
(700)	Citizens Financial Group Inc	Goldman Sachs International	(166)	(0,00)
(15)	City Holding Co	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
33.590	Clean Harbors Inc	Morgan Stanley	(10.765)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
30	Clearway Energy Inc Class A	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(31.244)	Clearway Energy Inc Class A	Morgan Stanley	(1.375)	(0,00)
6.317.436	Clicks Group Ltd	Goldman Sachs International	(9.636)	(0,00)
(452.426)	Clorox Co	Goldman Sachs International	(1.560)	(0,00)
(121.977)	Clorox Co	Morgan Stanley	(54)	(0,00)
(67.502)	CMS Energy Corp	Morgan Stanley	(251)	(0,00)
643.494	Coca-Cola Co	Goldman Sachs International	(32.827)	(0,01)
38.346	Cognex Corp	Morgan Stanley	(5.813)	(0,00)
66.456	Cognizant Technology Solutions Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	(1.683)	(0,00)
53.358	Cognizant Technology Solutions Corp Class A	Goldman Sachs International	(173)	(0,00)
48.490	Coherent Corp	Morgan Stanley	(2.961)	(0,00)
2.428	Coinbase Global Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(6)	(0,00)
640.799	Colgate-Palmolive Co	Goldman Sachs International	(50.389)	(0,01)
69.895	Colgate-Palmolive Co	Morgan Stanley	(7.129)	(0,00)
(36)	Collegium Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs International	(17)	(0,00)
(92.928)	Columbia Sportswear Co	Morgan Stanley	(3.995)	(0,00)
53.785	Comcast Corp Class A	Goldman Sachs International	(282)	(0,00)
(178.142)	Comcast Corp Class A	Morgan Stanley	(16.267)	(0,00)
19.110	Commercial Metals Co	Goldman Sachs International	(2)	(0,00)
(93.971)	Concentrix Corp	Morgan Stanley	(6.032)	(0,00)
62.060	Confluent Inc Class A	Morgan Stanley	(14.743)	(0,00)
(100)	ConocoPhillips	Goldman Sachs International	(484)	(0,00)
(600)	Consolidated Edison Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
76.232	Constellation Brands Inc Class A	Morgan Stanley	(2.446)	(0,00)
51.199	Constellation Energy Corp	Morgan Stanley	(25.720)	(0,01)
(4.300)	Contra Abiomed Inc	Morgan Stanley	(3.139)	(0,00)
(37.603)	Cooper Cos Inc	Goldman Sachs International	(2.648)	(0,00)
75.230	Copart Inc	Morgan Stanley	(1.055)	(0,00)
22.499	Copart Inc	Goldman Sachs International	(413)	(0,00)
19.288	Copart Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.986)	(0,00)
(29)	CoreCivic Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(3.000)	Corning Inc	Goldman Sachs International	(183)	(0,00)
59.000	Corning Inc	Morgan Stanley	(18.176)	(0,00)
(35)	Corsair Gaming Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
(2.500)	Corteva Inc	Goldman Sachs International	(572)	(0,00)
(133.047)	CoStar Group Inc	Goldman Sachs International	(59)	(0,00)
100	Costco Wholesale Corp	Goldman Sachs International	(1.792)	(0,00)
73.324	Coterra Energy Inc	Morgan Stanley	(1.735)	(0,00)
(2.300)	Coterra Energy Inc	Goldman Sachs International	(2)	(0,00)
(183.124)	Coty Inc Class A	Goldman Sachs International	(23.858)	(0,01)
(728)	Coty Inc Class A	Morgan Stanley	(88)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(46.872)	Coupang Inc	Goldman Sachs International	(1.805)	(0,00)
32.244	Coupang Inc	Morgan Stanley	(10.070)	(0,00)
40.998	Credit Acceptance Corp	Morgan Stanley	(5.233)	(0,00)
9.700.000	Credit Agricole SA	Société Générale	(152.997)	(0,03)
60.457	CrowdStrike Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	(16.745)	(0,00)
100	CrowdStrike Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
76.290	Crown Castle Inc	Morgan Stanley	(2.423)	(0,00)
(10)	CSG Systems International Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
125.602	CSL Ltd	Goldman Sachs International	(7.877)	(0,00)
(3.500)	CSX Corp	Goldman Sachs International	(2.312)	(0,00)
76.518	CSX Corp	Morgan Stanley	(519)	(0,00)
40.327	CubeSmart	Morgan Stanley	(4.064)	(0,00)
(327.068)	Cullinan Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	(60.953)	(0,01)
300	Cummins Inc	Goldman Sachs International	(1.489)	(0,00)
(35)	CVB Financial Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
77.247	CVS Health Corp	Morgan Stanley	(1.308)	(0,00)
40.214.708	CyberAgent Inc	Nomura	(206)	(0,00)
(33)	Cytek Biosciences Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
157.945	Cytokinetics Inc	Goldman Sachs International	(17.815)	(0,00)
37.819	Cytokinetics Inc	Morgan Stanley	(5.151)	(0,00)
144.131.100	Daifuku Co Ltd	Nomura	(3.521)	(0,00)
6.946.807	Daiichi Sankyo Co Ltd	Goldman Sachs International	(8.946)	(0,00)
200	Danaher Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
93.027	Danaher Corp	Morgan Stanley	(16.280)	(0,00)
5.676.656	Davide Campari-Milano NV	Société Générale	(68.873)	(0,01)
300	Delta Air Lines Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(12)	Deluxe Corp	Goldman Sachs International	(8)	(0,00)
(700)	Devon Energy Corp	Goldman Sachs International	(604)	(0,00)
(336.665)	Dick's Sporting Goods Inc	Morgan Stanley	(9.474)	(0,00)
27	Digi International Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
65.424	Digital Realty Trust Inc	Morgan Stanley	(14.481)	(0,00)
200	Digital Realty Trust Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
253.157	Dino Polska SA	JPMorgan Chase Bank	(2.557)	(0,00)
97.078	Dino Polska SA	Goldman Sachs International	(312)	(0,00)
(27.128)	Direct Line Insurance Group Plc	Goldman Sachs International	(2.022)	(0,00)
(100)	Discover Financial Services	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(1.005.249)	Discovery Ltd	JPMorgan Chase Bank	(1.702)	(0,00)
1.115.659	DNB Bank ASA	JPMorgan Chase Bank	(958)	(0,00)
(6.825)	DocMorris AG	Goldman Sachs International	(52)	(0,00)
(93.347)	Dolby Laboratories Inc Class A	Morgan Stanley	(4.477)	(0,00)
68.632	Dollar General Corp	Morgan Stanley	(10.893)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(190.424)	Dollar General Corp	Goldman Sachs International	(6.808)	(0,00)
(195.929)	Dollar General Corp	JPMorgan Chase Bank	(16.538)	(0,00)
(948.152)	Dollar Tree Inc	Morgan Stanley	(110.454)	(0,01)
(800)	Dollar Tree Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
68.572	Dominion Energy Inc	Morgan Stanley	(7.748)	(0,00)
800	Dominion Energy Inc	Goldman Sachs International	(618)	(0,00)
335.205	Domino's Pizza Inc	Morgan Stanley	(69.329)	(0,01)
63.676	Dover Corp	Morgan Stanley	(15.462)	(0,00)
(600)	Dover Corp	Goldman Sachs International	(203)	(0,00)
77.188	Dow Inc	Morgan Stanley	(158)	(0,00)
2.000	Dow Inc	Goldman Sachs International	(1.628)	(0,00)
100	DR Horton Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(142.459)	DraftKings Inc Class A	Goldman Sachs International	(1.213)	(0,00)
66.917	DraftKings Inc Class A	Morgan Stanley	(10.880)	(0,00)
40.844	Driven Brands Holdings Inc	Morgan Stanley	(2.697)	(0,00)
41.946	DT Midstream Inc	Morgan Stanley	(2.804)	(0,00)
100	DTE Energy Co	Goldman Sachs International	(191)	(0,00)
68.886	Duke Energy Corp	Morgan Stanley	(8.811)	(0,00)
400	Duke Energy Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
39.780	Dun & Bradstreet Holdings Inc	Morgan Stanley	(925)	(0,00)
100	DuPont de Nemours Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(44.240)	Dynatrace Inc	Morgan Stanley	(4.874)	(0,00)
(1.677.348)	Eaton Corp Plc	Goldman Sachs International	(49.657)	(0,01)
(358.922)	Eaton Corp Plc	JPMorgan Chase Bank	(10.428)	(0,00)
32.112	Eaton Corp Plc	Morgan Stanley	(81)	(0,00)
107.851	eBay Inc	JPMorgan Chase Bank	(1.913)	(0,00)
13.145	eBay Inc	Goldman Sachs International	(1.904)	(0,00)
366.277	Edgewell Personal Care Co	Goldman Sachs International	(48.431)	(0,01)
123.625	Edgewell Personal Care Co	JPMorgan Chase Bank	(8.367)	(0,00)
200	Edison International	Goldman Sachs International	(30)	(0,00)
71.213	Edwards Lifesciences Corp	Goldman Sachs International	(912)	(0,00)
123.638	Electronic Arts Inc	JPMorgan Chase Bank	(1.550)	(0,00)
37.023	Electronic Arts Inc	Morgan Stanley	(326)	(0,00)
100	Electronic Arts Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(100)	Eli Lilly & Co	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
41	Ellington Financial Inc	Goldman Sachs International	(5)	(0,00)
(21)	Elme Communities	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
300	Emerson Electric Co	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
589.264	Enbridge Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.294)	(0,00)
(300)	Enphase Energy Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
67.169	Entegris Inc	Morgan Stanley	(21.132)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
400	Entergy Corp	Goldman Sachs International	(70)	(0,00)
997.314	Enterprise Products Partners LP	Goldman Sachs International	(9.966)	(0,00)
(20)	Enviri Corp	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
(100)	EOG Resources Inc	Goldman Sachs International	(679)	(0,00)
100	EPAM Systems Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(634.500)	EQT Corp	Goldman Sachs International	(52.919)	(0,01)
(1.158.898)	EQT Corp	JPMorgan Chase Bank	(121.379)	(0,02)
279.925	Equifax Inc	Goldman Sachs International	(13.146)	(0,00)
11.390	Equifax Inc	JPMorgan Chase Bank	(683)	(0,00)
63.877	Equifax Inc	Morgan Stanley	(15.322)	(0,00)
(1.300)	Equity Residential	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
2.200.000	Erste Group Bank AG	Société Générale	(27.644)	(0,01)
71.429	Essex Property Trust Inc	Morgan Stanley	(7.219)	(0,00)
(300)	Essex Property Trust Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(164.559)	Estee Lauder Cos Inc Class A	Morgan Stanley	(35.655)	(0,01)
(131.376)	Estee Lauder Cos Inc Class A	Goldman Sachs International	(36.316)	(0,01)
49	Ethan Allen Interiors Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
45.581	Evercore Inc Class A	Morgan Stanley	(1.714)	(0,00)
(138.692)	Everest Group Ltd	Morgan Stanley	(3.405)	(0,00)
(100)	Everest Re Group Ltd	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
200	Evergy Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(400)	Eversource Energy	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(47.701)	Evolent Health Inc Class A	Goldman Sachs International	(6.641)	(0,00)
221.893	Evraz Plc	Morgan Stanley	(227.224)	(0,03)
(43.941)	Exact Sciences Corp	Morgan Stanley	(3.144)	(0,00)
88.223	Exelixis Inc	Goldman Sachs International	(3.884)	(0,00)
(900)	Exelon Corp	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
(30)	eXp World Holdings Inc	Goldman Sachs International	(20)	(0,00)
(26.074)	Expedia Group Inc	JPMorgan Chase Bank	(451)	(0,00)
(700)	Expedia Group Inc	Goldman Sachs International	(298)	(0,00)
(300)	Expeditors International of Washington Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
62.107	Extra Space Storage Inc	Morgan Stanley	(16.024)	(0,00)
400	Exxon Mobil Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(200)	F5 Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(100)	FactSet Research Systems Inc	Goldman Sachs International	(154)	(0,00)
63.331	Fair Isaac Corp	Morgan Stanley	(15.515)	(0,00)
(1.000)	Fastenal Co	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
2.211.410	Fastighets AB Balder	BNP Paribas	(43.095)	(0,01)
501	Federal Realty Investment Trust	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
44.391	Fidelity National Information Services Inc	Goldman Sachs International	(6.472)	(0,00)
59.565	Fidelity National Information Services Inc	Morgan Stanley	(19.406)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
66.294	Fifth Third Bancorp	Morgan Stanley	(2.095)	(0,00)
(1.300)	Fifth Third Bancorp	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
(367.479)	First Solar Inc	Goldman Sachs International	(35.503)	(0,01)
(529.884)	First Solar Inc	JPMorgan Chase Bank	(96.227)	(0,01)
600	FirstEnergy Corp	Goldman Sachs International	(83)	(0,00)
134.879	Fiserv Inc	Morgan Stanley	(3.094)	(0,00)
40.784	Floor & Decor Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	(2.910)	(0,00)
(69.829)	Flutter Entertainment Plc	Morgan Stanley	(483)	(0,00)
(670.170)	Flutter Entertainment Plc	Goldman Sachs International	(80.008)	(0,01)
(297.821)	Flutter Entertainment Plc	JPMorgan Chase Bank	(19.723)	(0,00)
(94.583)	FMC Corp	Morgan Stanley	(5.574)	(0,00)
42.194	FNB Corp	Morgan Stanley	(1.070)	(0,00)
(732.066)	Foot Locker Inc	Morgan Stanley	(53.264)	(0,01)
94.379	Foot Locker Inc	Goldman Sachs International	(3.047)	(0,00)
100	Ford Motor Co	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(700)	Fortinet Inc	Goldman Sachs International	(316)	(0,00)
400	Fortive Corp	Goldman Sachs International	(200)	(0,00)
(49)	Four Corners Property Trust Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
117.502	Fox Corp Class A	Morgan Stanley	(4.966)	(0,00)
(1.800)	Fox Corp Class B	Goldman Sachs International	(204)	(0,00)
1.100	Franklin Resources Inc	Goldman Sachs International	(959)	(0,00)
63.586	Freeport-McMoRan Inc	Morgan Stanley	(13.669)	(0,00)
29.701	Frontier Communications Parent Inc	Morgan Stanley	(14.566)	(0,00)
(38)	Fulgent Genetics Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(138.163)	Gap Inc	Goldman Sachs International	(10.666)	(0,00)
(208.342)	Gap Inc	Morgan Stanley	(798)	(0,00)
200	Garmin Ltd	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(100)	Gartner Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
64.293	Gen Digital Inc	Morgan Stanley	(12.347)	(0,00)
(200)	Gen Digital Inc	Goldman Sachs International	(74)	(0,00)
100	Generac Holdings Inc	Goldman Sachs International	(685)	(0,00)
73.719	General Electric Co	Morgan Stanley	(3.844)	(0,00)
200	General Electric Co	Goldman Sachs International	(426)	(0,00)
(1.700)	General Mills Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
(123.457)	General Motors Co	Morgan Stanley	(4.715)	(0,00)
(17)	Gibraltar Industries Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(47.368)	Gilead Sciences Inc	Morgan Stanley	(3.151)	(0,00)
371.923	Gilead Sciences Inc	Goldman Sachs International	(18.119)	(0,00)
(34)	Global Net Lease Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
300	Global Payments Inc	Goldman Sachs International	(134)	(0,00)
(39.494)	Global Payments Inc	Morgan Stanley	(9.349)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(89.197)	Globe Life Inc	Morgan Stanley	(358)	(0,00)
2.209	Globe Life Inc	Goldman Sachs International	(93)	(0,00)
919	Globus Medical Inc Class A	Goldman Sachs International	(26)	(0,00)
36.073	Globus Medical Inc Class A	Morgan Stanley	(8.268)	(0,00)
20.311	Globus Medical Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(6.887)	(0,00)
46.030.400	GMO Payment Gateway Inc	Nomura	(1.775)	(0,00)
42.697	GoDaddy Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(442)	(0,00)
114.675	GoDaddy Inc Class A	Goldman Sachs International	(4.339)	(0,00)
(117.007)	GoDaddy Inc Class A	Morgan Stanley	(491)	(0,00)
(44)	Gogo Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
43	Green Dot Corp Class A	Goldman Sachs International	(12)	(0,00)
(20)	Green Plains Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
149.485	Growthpoint Properties Ltd	JPMorgan Chase Bank	(936)	(0,00)
1.241.673	Growthpoint Properties Ltd	Goldman Sachs International	(10.510)	(0,00)
86.509	GSK Plc	JPMorgan Chase Bank	(782)	(0,00)
(66.550)	GSK Plc	Morgan Stanley	(4.266)	(0,00)
37.767	Guidewire Software Inc	Morgan Stanley	(6.859)	(0,00)
448.570	H Lundbeck A/S	Goldman Sachs International	(6.324)	(0,00)
103.198	H Lundbeck A/S	JPMorgan Chase Bank	(2.567)	(0,00)
411.206	Haleon Plc	Goldman Sachs International	(436)	(0,00)
(600)	Halliburton Co	Goldman Sachs International	(118)	(0,00)
65.919	Halozyme Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	(23.191)	(0,01)
16.994	Halozyme Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(3.704)	(0,00)
(42)	Hanmi Financial Corp	Goldman Sachs International	(44)	(0,00)
84.362	Hannover Rueckversicheru SE	JPMorgan Chase Bank	(397)	(0,00)
396.007	Hannover Rueckversicheru SE	Goldman Sachs International	(16.018)	(0,00)
(92.835)	Hanover Insurance Group Inc	Morgan Stanley	(2.119)	(0,00)
(89.866)	Harley-Davidson Inc	Morgan Stanley	(1.715)	(0,00)
(100)	Hartford Financial Services Group Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
1.900	Hasbro Inc	Goldman Sachs International	(4.251)	(0,00)
(16)	Haverty Furniture Cos Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
18	Hawkins Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
37.953	Healthcare Realty Trust Inc	Morgan Stanley	(4.401)	(0,00)
75.564	Healthpeak Properties Inc	Morgan Stanley	(1.254)	(0,00)
58.878	Heico Corp	Morgan Stanley	(17.922)	(0,00)
(373.829)	Heineken NV	JPMorgan Chase Bank	(15.176)	(0,00)
(289.945)	Heineken NV	Goldman Sachs International	(14.605)	(0,00)
(290.397)	Henkel AG & Co KGaA	Goldman Sachs International	(7.084)	(0,00)
(367.963)	Henkel AG & Co KGaA	JPMorgan Chase Bank	(6.497)	(0,00)
(442.206)	Henry Schein Inc	Goldman Sachs International	(41.889)	(0,01)
3.585.000	Herbalife Ltd	Nomura	(82.326)	(0,01)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(1.257.854)	Hershey Co	Morgan Stanley	(63.060)	(0,01)
(5.600)	Hewlett Packard Enterprise Co	Goldman Sachs International	(1.940)	(0,00)
(125.276)	Hewlett Packard Enterprise Co	Morgan Stanley	(1.816)	(0,00)
(88.845)	Hexcel Corp	Morgan Stanley	(787)	(0,00)
(135.221)	HF Sinclair Corp	Morgan Stanley	(2.069)	(0,00)
71.859	Hilton Worldwide Holdings Inc	Morgan Stanley	(7.636)	(0,00)
(39.299)	Hims & Hers Health Inc	JPMorgan Chase Bank	(4.719)	(0,00)
(17.662)	Hims & Hers Health Inc	Goldman Sachs International	(46)	(0,00)
300	Home Depot Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(500)	Honeywell International Inc	Goldman Sachs International	(309)	(0,00)
41	Horace Mann Educators Corp	Goldman Sachs International	(21)	(0,00)
45.734	Hormel Foods Corp	Morgan Stanley	(595)	(0,00)
128.338	Hormel Foods Corp	JPMorgan Chase Bank	(356)	(0,00)
168.767.460	Hosiden Corp	Société Générale	(4.852)	(0,00)
4.000	Host Hotels & Resorts Inc	Goldman Sachs International	(76)	(0,00)
37.199	Houlihan Lokey Inc	Morgan Stanley	(8.046)	(0,00)
(388.715)	Howmet Aerospace Inc	Morgan Stanley	(29.627)	(0,00)
(800.963)	Howmet Aerospace Inc	Goldman Sachs International	(14.186)	(0,00)
(89.296)	HubSpot Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.155)	(0,00)
(124.429)	HubSpot Inc	Goldman Sachs International	(3.138)	(0,00)
17	Hudson Pacific Properties Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
541.735	Humana Inc	Goldman Sachs International	(28.692)	(0,01)
74.315	Huntington Bancshares Inc	Morgan Stanley	(848)	(0,00)
(700)	Huntington Bancshares Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
(300)	Huntington Ingalls Industries Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(148.919)	Huntington Ingalls Industries Inc	Morgan Stanley	(15.705)	(0,00)
(90.532)	Huntsman Corp	Morgan Stanley	(4.062)	(0,00)
59.951	Hyatt Hotels Corp Class A	Morgan Stanley	(19.886)	(0,00)
52.736.085	Ibiden Co Ltd	Nomura	(1.883)	(0,00)
(522.774)	ICON Plc	Goldman Sachs International	(7.198)	(0,00)
10.156	IDEXX Laboratories Inc	JPMorgan Chase Bank	(540)	(0,00)
28.582	IDEXX Laboratories Inc	Goldman Sachs International	(6.870)	(0,00)
(134.357)	Illinois Tool Works Inc	Morgan Stanley	(95)	(0,00)
100	Illinois Tool Works Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
260.056	Incyte Corp	Morgan Stanley	(11.871)	(0,00)
136.992	Incyte Corp	JPMorgan Chase Bank	(10.925)	(0,00)
170.835	Incyte Corp	Goldman Sachs International	(11.662)	(0,00)
128.068.875	INFRONEER Holdings Inc	Nomura	(2.945)	(0,00)
(480.429)	ING Groep NV	Goldman Sachs International	(1.197)	(0,00)
300	Ingersoll Rand Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
71.526	Ingersoll Rand Inc	Morgan Stanley	(6.905)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
42	Innovative Industrial Properties Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
584	Innovid Corp	Goldman Sachs International	(14)	(0,00)
(118.940)	Insmad Inc	Morgan Stanley	(3.110)	(0,00)
(407)	Insulet Corp	JPMorgan Chase Bank	(5)	(0,00)
(35.002)	Intel Corp	Morgan Stanley	(10.726)	(0,00)
34.980	Interactive Brokers Group Inc Class A	Morgan Stanley	(9.282)	(0,00)
65.260	Intercontinental Exchange Inc	Morgan Stanley	(12.469)	(0,00)
(3.456)	Intercontinental Exchange Inc	JPMorgan Chase Bank	(59)	(0,00)
74.708	International Business Machines Corp	Morgan Stanley	(4.217)	(0,00)
(42.599)	International Flavors & Fragrances Inc	Morgan Stanley	(204)	(0,00)
(1.200)	Interpublic Group of Cos Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
(124.289)	Intesa Sanpaolo SpA	JPMorgan Chase Bank	(2.159)	(0,00)
4.800.000	Intesa Sanpaolo SpA	Société Générale	(58.722)	(0,01)
(73.552)	Intra-Cellular Therapies Inc	Goldman Sachs International	(7.075)	(0,00)
22.922	Intuitive Surgical Inc	Goldman Sachs International	(13.918)	(0,00)
67.241	Intuitive Surgical Inc	Morgan Stanley	(11.320)	(0,00)
(1.600)	Invesco Ltd	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
38.806	Ionis Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(5.381)	(0,00)
(558)	Iovance Biotherapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(11)	(0,00)
(31.918)	Iovance Biotherapeutics Inc	Goldman Sachs International	(15.625)	(0,00)
102.815	Ipsen	Goldman Sachs International	(8.396)	(0,00)
(179.689)	IQVIA Holdings Inc	Goldman Sachs International	(1.447)	(0,00)
222.603	Itau Unibanco Holding SA	Morgan Stanley	(639)	(0,00)
300	Jack Henry & Associates Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(500)	Jacobs Solutions Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
169.853.918	JAFCO Group Co Ltd	Nomura	(2.205)	(0,00)
11.000	Jaws Mustang	Goldman Sachs International	(375)	(0,00)
(700)	JB Hunt Transport Services Inc	Goldman Sachs International	(844)	(0,00)
8.416	JD.com Inc	Morgan Stanley	(1.645)	(0,00)
167.662.380	JFE Holdings Inc	Goldman Sachs International	(2.957)	(0,00)
(366.637)	JM Smucker Co	JPMorgan Chase Bank	(15.399)	(0,00)
(250.673)	JM Smucker Co	Goldman Sachs International	(19.285)	(0,00)
105.768	Johnson & Johnson	Goldman Sachs International	(834)	(0,00)
1.400	Johnson Controls International Plc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
69.140	Johnson Controls International Plc	Morgan Stanley	(8.638)	(0,00)
100	JPMorgan Chase & Co	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(141.546)	Julius Baer Group Ltd	Goldman Sachs International	(4.598)	(0,00)
(22.668)	Julius Baer Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	(507)	(0,00)
(1.200)	Juniper Networks Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
321.036.000	Kansai Paint Co Ltd	Nomura	(8.757)	(0,00)
2.000.000	KBC Group NV	Société Générale	(24.605)	(0,01)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(100)	Kellanova	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(554.166)	Kellogg Co	Goldman Sachs International	(3.804)	(0,00)
(729.037)	Kellogg Co	JPMorgan Chase Bank	(4.100)	(0,00)
351.021	Kellogg Co	Morgan Stanley	(962)	(0,00)
34.877	Kemper Corp	Morgan Stanley	(10.212)	(0,00)
(33)	Kennametal Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
2.400	Kenvue Inc	Goldman Sachs International	(1.240)	(0,00)
(137.084)	Keros Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(6.381)	(0,00)
(380.242)	Keros Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	(67.208)	(0,01)
(2.900)	Keurig Dr Pepper Inc	Goldman Sachs International	(2)	(0,00)
70.522	Keurig Dr Pepper Inc	Morgan Stanley	(4.031)	(0,00)
74.439	KeyCorp	Morgan Stanley	(1.770)	(0,00)
(500)	KeyCorp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
358.704	Keyera Corp	JPMorgan Chase Bank	(43.038)	(0,01)
339.338	Keyera Corp	Goldman Sachs International	(41.284)	(0,01)
(500)	Keysight Technologies Inc	Goldman Sachs International	(281)	(0,00)
(62.090)	Kimberly-Clark Corp	Morgan Stanley	(350)	(0,00)
300	Kimberly-Clark Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(140.663)	Kimberly-Clark Corp	JPMorgan Chase Bank	(2.366)	(0,00)
73.841	Kimco Realty Corp	Morgan Stanley	(2.879)	(0,00)
70.508	Kinder Morgan Inc	Morgan Stanley	(4.934)	(0,00)
(200)	Kinder Morgan Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
34.643	King Slide Works Co Ltd	Morgan Stanley	(2.384)	(0,00)
72.548	KLA Corp	Morgan Stanley	(16.391)	(0,00)
155.893	Klaviyo Inc Class A	Goldman Sachs International	(6.846)	(0,00)
96.593	Kohls Corp	Goldman Sachs International	(1.350)	(0,00)
419.272	Kohls Corp	JPMorgan Chase Bank	(13.668)	(0,00)
134.754	Kroger Co	JPMorgan Chase Bank	(733)	(0,00)
(1.500)	Kroger Co	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
7.733	Kymera Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.105)	(0,00)
(119.985)	Kymera Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	(29.136)	(0,00)
311.550	Labcorp Holdings Inc	Goldman Sachs International	(3.399)	(0,00)
75.117	Labcorp Holdings Inc	Morgan Stanley	(3.254)	(0,00)
(46)	Lakeland Financial Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
22.531	Lam Research Corp	Morgan Stanley	(6.193)	(0,00)
44.541	Lamar Advertising Co Class A	Morgan Stanley	(738)	(0,00)
77.561	Lamb Weston Holdings Inc	Morgan Stanley	(617)	(0,00)
(300)	Lamb Weston Holdings Inc	Goldman Sachs International	(183)	(0,00)
(600)	Las Vegas Sands Corp	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
(103.552)	Lear Corp	Morgan Stanley	(13.777)	(0,00)
49	LeMaitre Vascular Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
35.693	Lennar Corp Class B	Morgan Stanley	(9.159)	(0,00)
(405.245)	Lennox International Inc	Goldman Sachs International	(2.624)	(0,00)
(405.510)	Lennox International Inc	JPMorgan Chase Bank	(753)	(0,00)
42.185	Liberty Media Corp Class A	Morgan Stanley	(4.000)	(0,00)
31.972	Liberty Media Corp Class C	Morgan Stanley	(2.652)	(0,00)
69.038	Linde Plc	Morgan Stanley	(9.330)	(0,00)
(1)	Liquidity Services Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(236.049)	Lithia Motors Inc Class A	Morgan Stanley	(23.322)	(0,01)
42.906	Littelfuse Inc	Morgan Stanley	(1.902)	(0,00)
(89.385)	Live Nation Entertainment Inc	Goldman Sachs International	(47)	(0,00)
12.000.000	Live Nation Entertainment Inc	Nomura	(65.076)	(0,01)
121.704	Lloyds Banking Group Plc	Goldman Sachs International	(1.238)	(0,00)
100	Lockheed Martin Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
600	Loews Corp	Goldman Sachs International	(1.149)	(0,00)
(89.754)	Louisiana-Pacific Corp	Morgan Stanley	(5.659)	(0,00)
(178.369)	Lululemon Athletica Inc	Morgan Stanley	(47.679)	(0,01)
(1.400)	Lululemon Athletica Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
41.381	Lumentum Holdings Inc	Morgan Stanley	(5.094)	(0,00)
(72.731)	M&G Plc	Goldman Sachs International	(480)	(0,00)
(300)	M&T Bank Corp	Goldman Sachs International	(360)	(0,00)
(10.190)	Madison Square Garden Entertainment Corp	JPMorgan Chase Bank	(686)	(0,00)
43.736	Madison Square Garden Sports Corp Class A	Morgan Stanley	(988)	(0,00)
33.538	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	(10.570)	(0,00)
(91.384)	ManpowerGroup Inc	Morgan Stanley	(2.219)	(0,00)
38.412	Maplebear Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.008)	(0,00)
(1.700)	Marathon Oil Corp	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
(200)	MarketAxess Holdings Inc	Goldman Sachs International	(682)	(0,00)
(42.403)	Marks & Spencer Group Plc	JPMorgan Chase Bank	(4.690)	(0,00)
1.028.489	Marriott International Inc Class A	Goldman Sachs International	(37.740)	(0,01)
72.960	Martin Marietta Materials Inc	Morgan Stanley	(5.456)	(0,00)
(100)	Martin Marietta Materials Inc	Goldman Sachs International	(54)	(0,00)
65.346	Marvell Technology Inc	Morgan Stanley	(13.889)	(0,00)
(900)	Masco Corp	Goldman Sachs International	(166)	(0,00)
(366.271)	Mastercard Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(6.220)	(0,00)
(206.307)	Mastercard Inc Class A	Goldman Sachs International	(4.714)	(0,00)
(71.926)	Match Group Inc	Morgan Stanley	(297)	(0,00)
(89.469)	Mattel Inc	Morgan Stanley	(5.142)	(0,00)
(13)	Matthews International Corp Class A	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
76.501	McCormick & Co Inc	Morgan Stanley	(1.132)	(0,00)
(731.708)	McCormick & Co Inc	Goldman Sachs International	(2.934)	(0,00)
(530.655)	McCormick & Co Inc	JPMorgan Chase Bank	(510)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
100	McDonald's Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
536.619	McKesson Corp	Goldman Sachs International	(4.043)	(0,00)
249.397	MEG Energy Corp	Goldman Sachs International	(3.678)	(0,00)
29	Mercer International Inc	Goldman Sachs International	(4)	(0,00)
(1.620.636)	Merck & Co Inc	Goldman Sachs International	(60.922)	(0,01)
(500.677)	Merck & Co Inc	JPMorgan Chase Bank	(15.003)	(0,00)
(142.947)	Merck & Co Inc	Morgan Stanley	(5.411)	(0,00)
613.372	Merck KGaA	Goldman Sachs International	(10.686)	(0,00)
6.679	Merck KGaA	JPMorgan Chase Bank	(405)	(0,00)
16	Mercury General Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(100)	Meta Platforms Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(38)	Metallus Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
22.961	Mettler-Toledo International Inc	Goldman Sachs International	(4.971)	(0,00)
101.784	Microchip Technology Inc	Morgan Stanley	(7.179)	(0,00)
300	Microchip Technology Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
49.622	Micron Technology Inc	Morgan Stanley	(28.043)	(0,01)
48.722	Microsoft Corp	Goldman Sachs International	(4.346)	(0,00)
(600)	Mid-America Apartment Communities Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
69.566	Mid-America Apartment Communities Inc	Morgan Stanley	(1.664)	(0,00)
(607)	Mirati Therapeutics	Morgan Stanley	(303)	(0,00)
36.709	Mister Car Wash Inc	Morgan Stanley	(2.294)	(0,00)
36.084	MKS Instruments Inc	Morgan Stanley	(8.491)	(0,00)
44.814	Mohawk Industries Inc	Morgan Stanley	(1.348)	(0,00)
600	Mohawk Industries Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
41.160.428	MOL Hungarian Oil & Gas Plc	Goldman Sachs International	(783)	(0,00)
(124.772)	Molina Healthcare Inc	Morgan Stanley	(4.770)	(0,00)
100	Molina Healthcare Inc	Goldman Sachs International	(1.078)	(0,00)
77.079	Molson Coors Beverage Co Class B	Morgan Stanley	(805)	(0,00)
(2.100)	Molson Coors Beverage Co Class B	Goldman Sachs International	(74)	(0,00)
300	Mondelez International Inc Class A	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(737.490)	Monster Beverage Corp	Goldman Sachs International	(33.981)	(0,01)
(176.677)	Monster Beverage Corp	Morgan Stanley	(2.170)	(0,00)
(22.857)	Monster Beverage Corp	JPMorgan Chase Bank	(1.466)	(0,00)
(400)	Morgan Stanley	Goldman Sachs International	(335)	(0,00)
(64.365)	Morningstar Inc	Morgan Stanley	(1.562)	(0,00)
2.400	Mosaic Co	Goldman Sachs International	(2)	(0,00)
(100)	Motorola Solutions Inc	Goldman Sachs International	(10)	(0,00)
(126.191)	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG (MunichRe)	Morgan Stanley	(446)	(0,00)
(84.137)	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG (MunichRe)	Goldman Sachs International	(307)	(0,00)
(172.898)	Murphy USA Inc	Morgan Stanley	(6.126)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(426.818)	Murphy USA Inc	Goldman Sachs International	(5.204)	(0,00)
80.590.465	Nagoya Railroad Co Ltd	Nomura	(1.712)	(0,00)
65.504	Nasdaq Inc	Morgan Stanley	(11.712)	(0,00)
88.387	National Beverage Corp	JPMorgan Chase Bank	(2.045)	(0,00)
310.778	National Fuel Gas Co	Goldman Sachs International	(27.404)	(0,01)
40.071	National Fuel Gas Co	JPMorgan Chase Bank	(4.715)	(0,00)
38.331	National Storage Affiliates Trust	Morgan Stanley	(6.152)	(0,00)
148.710	Natwest Group Plc	Goldman Sachs International	(14.025)	(0,00)
(30)	Navient Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
3.238.888	Nedbank Group Ltd	Goldman Sachs International	(25.798)	(0,01)
2.619.227	Nedbank Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	(35.425)	(0,01)
671.981	Nedbank Group Ltd	Morgan Stanley	(6.419)	(0,00)
(900)	NetApp Inc	Goldman Sachs International	(384)	(0,00)
9.152	NetApp Inc	Morgan Stanley	(2.350)	(0,00)
139.369	Netflix Inc	Goldman Sachs International	(12.254)	(0,00)
(189.509)	Neumora Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	(57.651)	(0,01)
181.891	Neurocrine Biosciences Inc	Goldman Sachs International	(10.677)	(0,00)
29.698	Neurocrine Biosciences Inc	JPMorgan Chase Bank	(779)	(0,00)
16	New York Mortgage Trust Inc	Goldman Sachs International	(6)	(0,00)
39.915	New York Times Co Class A	JPMorgan Chase Bank	(1.709)	(0,00)
156.450	New York Times Co Class A	Goldman Sachs International	(14.415)	(0,00)
42.343	Newmarket Corp	Morgan Stanley	(2.939)	(0,00)
66.020	Newmont Corp	Morgan Stanley	(10.734)	(0,00)
(2.700)	News Corp Class A	Goldman Sachs International	(163)	(0,00)
73.565	News Corp Class B	Morgan Stanley	(1.813)	(0,00)
(18)	NexPoint Residential Trust Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
700	NextEra Energy Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
1.200	NIKE Inc Class B	Goldman Sachs International	(2.174)	(0,00)
1.100.000	NIO Inc	Nomura	(308.722)	(0,04)
1.000.000	NIO Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.716)	(0,00)
1.882.158.400	Nippon Steel Corp	Société Générale	(33.092)	(0,01)
1.500	NiSource Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
(400)	Nordson Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
77.322	Northern Trust Corp	Morgan Stanley	(1.841)	(0,00)
(1.900)	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Goldman Sachs International	(2)	(0,00)
283.341	NOV Inc	Goldman Sachs International	(317)	(0,00)
42.568	NOV Inc	Morgan Stanley	(530)	(0,00)
42.467	Novartis AG	Goldman Sachs International	(566)	(0,00)
95.765	Novartis AG	JPMorgan Chase Bank	(2.035)	(0,00)
(900)	NRG Energy Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
(11)	Nu Skin Enterprises Inc Class A	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
43.978	Nutanix Inc Class A	Morgan Stanley	(31)	(0,00)
(11)	NV5 Global Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(100)	NVIDIA Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
100	NXP Semiconductors NV	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
470.111	Ocado Group Plc	Société Générale	(11.575)	(0,00)
700	Occidental Petroleum Corp	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
76.655	Occidental Petroleum Corp	Morgan Stanley	(1.497)	(0,00)
342.062	Oddity Tech Ltd Class A	Goldman Sachs International	(26.382)	(0,01)
43.618	OGE Energy Corp	Morgan Stanley	(451)	(0,00)
123.094	Okta Inc	Goldman Sachs International	(4.152)	(0,00)
(59.608)	Okta Inc	Morgan Stanley	(1.264)	(0,00)
776.103	Old Dominion Freight Line	Goldman Sachs International	(29.901)	(0,01)
(85.797)	Olema Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	(18.157)	(0,00)
(101.951)	Olin Corp	Morgan Stanley	(15.373)	(0,00)
35.692	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Morgan Stanley	(8.812)	(0,00)
43.673	Omega Healthcare Investors Inc	Morgan Stanley	(982)	(0,00)
(400)	Omnicom Group Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(80.709)	ON Semiconductor Corp	Morgan Stanley	(7.755)	(0,00)
(1.200)	ON Semiconductor Corp	Goldman Sachs International	(722)	(0,00)
875.463	ONEOK Inc	JPMorgan Chase Bank	(30.724)	(0,01)
63.182	ONEOK Inc	Morgan Stanley	(15.435)	(0,00)
(400)	ONEOK Inc	Goldman Sachs International	(501)	(0,00)
(186.506)	Option Care Health Inc	Goldman Sachs International	(13.623)	(0,00)
25.716	Oracle Corp	Goldman Sachs International	(5.001)	(0,00)
9.265	Oracle Corp	JPMorgan Chase Bank	(2.092)	(0,00)
100	O'Reilly Automotive Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
77.607	O'Reilly Automotive Inc	Morgan Stanley	(467)	(0,00)
79.249	Orion Oyj	Goldman Sachs International	(9.810)	(0,00)
1.247.414	Ormat Technologies Inc	Goldman Sachs International	(25.186)	(0,01)
68.121.000	OSG Corp	Nomura	(2.564)	(0,00)
(94.625)	Oshkosh Corp	Morgan Stanley	(2.219)	(0,00)
(100)	Otis Worldwide Corp	Goldman Sachs International	(23)	(0,00)
(551.843)	PACCAR Inc	JPMorgan Chase Bank	(22.366)	(0,00)
(21.662)	PACCAR Inc	Goldman Sachs International	(459)	(0,00)
900	PACCAR Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
12.774	Pacira BioSciences Inc	JPMorgan Chase Bank	(506)	(0,00)
200	Packaging Corp of America	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
107.416	Pagseguro Digital Ltd Class A	Morgan Stanley	(3.611)	(0,00)
65.424	Palantir Technologies Inc Class A	Morgan Stanley	(10.486)	(0,00)
14	Palomar Holdings Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(2.166.713)	Pandora A/S	Goldman Sachs International	(14.919)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(422.553)	Pandora A/S	JPMorgan Chase Bank	(4.443)	(0,00)
(130.091)	Paramount Global Class B	Morgan Stanley	(6.162)	(0,00)
(1.000)	Paramount Global Class B	Goldman Sachs International	(129)	(0,00)
(548.726)	Parker-Hannifin Corp	Goldman Sachs International	(12.213)	(0,00)
(100)	Paychex Inc	Goldman Sachs International	(70)	(0,00)
300	Paycom Software Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(31.600)	PayPal Holdings Inc	Goldman Sachs International	(6.425)	(0,00)
(46)	PC Connection Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
8.150.000	Peabody Energy Corp	Nomura	(10.803)	(0,00)
35.634	Pegasystems Inc	JPMorgan Chase Bank	(1.036)	(0,00)
59.713	Pegasystems Inc	Goldman Sachs International	(1.305)	(0,00)
(786.338)	Pembina Pipeline Corp	Morgan Stanley	(1.913)	(0,00)
32.729	Penn Entertainment Inc	Morgan Stanley	(11.396)	(0,00)
(205.265)	Pentair Plc	Goldman Sachs International	(14.609)	(0,00)
(134.138)	PepsiCo Inc	Morgan Stanley	(1.191)	(0,00)
(614.621)	PepsiCo Inc	Goldman Sachs International	(24.073)	(0,01)
(44.687)	Perrigo Co Plc	Goldman Sachs International	(2.583)	(0,00)
(93.650)	Perrigo Co Plc	Morgan Stanley	(4.209)	(0,00)
(134.033)	Perrigo Co Plc	JPMorgan Chase Bank	(9.547)	(0,00)
15.149	Petco Health & Wellness Co Inc	Morgan Stanley	(20.174)	(0,00)
394.450	Petrovavlovsk Plc	Morgan Stanley	(5.992)	(0,00)
(45.022)	Pfizer Inc	Morgan Stanley	(694)	(0,00)
315.777	Pfizer Inc	Goldman Sachs International	(8.492)	(0,00)
76.919	Phillips 66	Morgan Stanley	(2.277)	(0,00)
300	Phillips 66	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
44.295	Pinnacle Financial Partners Inc	Morgan Stanley	(1.706)	(0,00)
52.671	Pinterest Inc Class A	Morgan Stanley	(24.295)	(0,01)
19	Pitney Bowes Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
36.942	Planet Fitness Inc Class A	Morgan Stanley	(7.048)	(0,00)
(200)	PNC Financial Services Group Inc	Goldman Sachs International	(497)	(0,00)
(103.831)	Polaris Inc	Morgan Stanley	(14.770)	(0,00)
(194.797)	POSCO Holdings Inc	Goldman Sachs International	(2.062)	(0,00)
37.762	Post Holdings Inc	Morgan Stanley	(6.906)	(0,00)
800	PPL Corp	Goldman Sachs International	(74)	(0,00)
(700)	Principal Financial Group Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
18	ProAssurance Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
79.058	PROCEPT BioRobotics Corp	Goldman Sachs International	(15.344)	(0,00)
697.501	Procter & Gamble Co	Goldman Sachs International	(20.704)	(0,00)
482.790	Procter & Gamble Co	Morgan Stanley	(22.576)	(0,00)
56.798	Progressive Corp	Morgan Stanley	(20.511)	(0,00)
(100)	Progressive Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
76.012	Prologis Inc	Morgan Stanley	(3.240)	(0,00)
800	Prologis Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
(42.298)	Prosus NV	JPMorgan Chase Bank	(1.501)	(0,00)
(60.723)	Prosus NV	Goldman Sachs International	(643)	(0,00)
(42)	Proto Labs Inc	Goldman Sachs International	(10)	(0,00)
77.210	PTC Inc	Morgan Stanley	(1.562)	(0,00)
400	PTC Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(300)	Public Storage	Goldman Sachs International	(559)	(0,00)
(122.243)	PulteGroup Inc	JPMorgan Chase Bank	(4.852)	(0,00)
(136.026)	PulteGroup Inc	Morgan Stanley	(1.833)	(0,00)
66.278	Pure Storage Inc Class A	Morgan Stanley	(16.149)	(0,00)
(89.171)	PVH Corp	Morgan Stanley	(661)	(0,00)
78.077	Qorvo Inc	Morgan Stanley	(2.911)	(0,00)
200	Qorvo Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
14.752	QUALCOMM Inc	Morgan Stanley	(3.084)	(0,00)
(1.196.786)	Quanta Services Inc	Goldman Sachs International	(22.549)	(0,01)
(318.521)	Quanta Services Inc	JPMorgan Chase Bank	(17.597)	(0,00)
58.039	Quanta Services Inc	Morgan Stanley	(16.623)	(0,00)
(432.010)	Quest Diagnostics Inc	Goldman Sachs International	(4.389)	(0,00)
49	QuinStreet Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
41.097	R1 RCM Inc	Morgan Stanley	(33)	(0,00)
500	Ralph Lauren Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(48.567)	Rambus Inc	Morgan Stanley	(1.781)	(0,00)
(500)	Raymond James Financial Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
39.981	RBC Bearings Inc	Morgan Stanley	(4.905)	(0,00)
143.705	REA Group Ltd	Goldman Sachs International	(5.339)	(0,00)
109.639	REA Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	(1.818)	(0,00)
(37)	Redwood Trust Inc	Goldman Sachs International	(4)	(0,00)
37.799	Regency Centers Corp	Morgan Stanley	(267)	(0,00)
400	Regency Centers Corp	Goldman Sachs International	(64)	(0,00)
485.967	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	(73.699)	(0,01)
(8.491)	Regeneron Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	(91)	(0,00)
64.798	Regions Financial Corp	Morgan Stanley	(13.533)	(0,00)
(244.217)	Relay Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	(74.405)	(0,01)
(36.183)	Relay Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(10.692)	(0,00)
7.510	RELX Plc	JPMorgan Chase Bank	(754)	(0,00)
49.913	RELX Plc	Goldman Sachs International	(13.228)	(0,00)
(101.813)	Remitly Global Inc	Goldman Sachs International	(25.385)	(0,00)
76.904	Republic Services Inc	Morgan Stanley	(1.012)	(0,00)
(600)	Republic Services Inc Class A	Goldman Sachs International	(958)	(0,00)
15.088	ResMed Inc	JPMorgan Chase Bank	(5.859)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
161.539	ResMed Inc	Goldman Sachs International	(5.695)	(0,00)
(14.300)	Resolute Forest Products Inc	Morgan Stanley	(8.294)	(0,00)
5	Retail Opportunity Investments Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(300)	Revvity Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
300.575	Reynolds Consumer Products Inc	JPMorgan Chase Bank	(575)	(0,00)
2.613.698	Rheinmetall AG	Bank of America Merrill Lynch	(908)	(0,00)
(83.491)	Rithm Capital Corp	Morgan Stanley	(723)	(0,00)
(100.511)	Robert Half International Inc	Morgan Stanley	(11.394)	(0,00)
106.814	Robinhood Markets Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(6.534)	(0,00)
(29.113)	Robinhood Markets Inc Class A	Goldman Sachs International	(108)	(0,00)
41.080	Robinhood Markets Inc Class A	Morgan Stanley	(34.211)	(0,01)
1.002.194	Roche Holding AG	Goldman Sachs International	(110.539)	(0,01)
(38.195)	Rocket Cos Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(1.746)	(0,00)
31.813	Rocket Cos Inc Class A	Morgan Stanley	(9.526)	(0,00)
(56.715)	Rocket Cos Inc Class A	Goldman Sachs International	(1.076)	(0,00)
(123.760)	Rocket Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	(4.645)	(0,00)
(247.906)	Rocket Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	(51.947)	(0,01)
1.206.346	Rockwell Automation Inc	Goldman Sachs International	(21.906)	(0,00)
78.419	Rockwell Automation Inc	Morgan Stanley	(2.768)	(0,00)
31.925	Rockwell Automation Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.085)	(0,00)
100	Roper Technologies Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
74.851	Roper Technologies Inc	Morgan Stanley	(3.359)	(0,00)
(300)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
600	RTX Corp	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
(521.671)	Ryanair Holdings Plc	JPMorgan Chase Bank	(55.543)	(0,01)
100	S&P Global Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(13)	Sabre Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
49	Safehold Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
38.568	Saia Inc	Morgan Stanley	(7.815)	(0,00)
(135.071)	Salesforce Inc	Morgan Stanley	(619)	(0,00)
159.493	Salesforce Inc	JPMorgan Chase Bank	(9.533)	(0,00)
500.000	Salini SpA	Nomura	(1.454)	(0,00)
121.802	Sampo Oyj	JPMorgan Chase Bank	(2.026)	(0,00)
114.002	Sampo Oyj Class A	Goldman Sachs International	(1.080)	(0,00)
94.665	Sanofi	JPMorgan Chase Bank	(3.339)	(0,00)
161.108	Sanofi	Goldman Sachs International	(562)	(0,00)
8.566	Sanofi SA	Goldman Sachs International	(510)	(0,00)
29.281	Sanofi SA	JPMorgan Chase Bank	(1.274)	(0,00)
61.135	SAP SE	Morgan Stanley	(11.120)	(0,00)
(130.551)	Sarepta Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	(6.678)	(0,00)
(306.605)	Sarepta Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(13.487)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
15	Saul Centers Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
700	Schlumberger NV	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
44.035	Schlumberger NV	Morgan Stanley	(298)	(0,00)
(544.363)	Scotts Miracle-Gro Co	Goldman Sachs International	(25.477)	(0,01)
(88.461)	Scotts Miracle-Gro Co	Morgan Stanley	(1.980)	(0,00)
(16)	Seacoast Banking Corp of Florida	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
93.890	Seagate Technology Holdings Plc	Morgan Stanley	(16.562)	(0,00)
3.900	Seagate Technology Holdings Plc	Goldman Sachs International	(3)	(0,00)
600	Semptra	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
76.365	Semptra	Morgan Stanley	(1.472)	(0,00)
44.027	Service Corp International	Morgan Stanley	(225)	(0,00)
(46)	Shenandoah Telecommunications Co	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
300	Sherwin-Williams Co	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(22.118)	Shopify Inc Class A	Morgan Stanley	(196)	(0,00)
(71.616)	Shopify Inc Class A	Goldman Sachs International	(2.143)	(0,00)
9.770.670	Shoprite Holdings Ltd	Goldman Sachs International	(40.930)	(0,01)
(1.352.021)	Signet Jewelers Ltd	Morgan Stanley	(125.631)	(0,02)
(20.686)	Simply Good Foods Co	JPMorgan Chase Bank	(2.945)	(0,00)
(21)	Simulations Plus Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(13)	SiriusPoint Ltd	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
4.200.000	SK Hynix Inc	Bank of America Merrill Lynch	(40.717)	(0,01)
(354.164)	Skechers USA Inc Class A	Goldman Sachs International	(144)	(0,00)
54.827	Skyworks Solutions Inc	Morgan Stanley	(2.186)	(0,00)
35.838	Smartsheet Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(1.900)	(0,00)
73.129	Smartsheet Inc Class A	Goldman Sachs International	(797)	(0,00)
(133.168)	Snap-on Inc	Morgan Stanley	(3.754)	(0,00)
(400)	Snap-on Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
2.500.000	Societe Generale SA	BNP Paribas	(4.780)	(0,00)
65.161	Solidcore Resources Plc	Morgan Stanley	(140.096)	(0,02)
77.031	Solventum Corp	Morgan Stanley	(2.864)	(0,00)
300	Solventum Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(87.975)	Sonoco Products Co	Morgan Stanley	(1.065)	(0,00)
(26)	Sotera Health Co	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
600	Southern Co	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
71.397	Southern Co	Morgan Stanley	(6.091)	(0,00)
(21)	Southside Bancshares Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
76.311	Southwest Airlines Co	Morgan Stanley	(1.079)	(0,00)
1.500	Southwest Airlines Co	Goldman Sachs International	(18)	(0,00)
38.241	Southwestern Energy Co	Morgan Stanley	(156)	(0,00)
29.718	Spirit AeroSystems Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	(13.817)	(0,00)
24.750	SpringBig Holdings Inc	Goldman Sachs International	(190)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(154.902)	SpringWorks Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(27.510)	(0,01)
(104.821)	SpringWorks Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	(18.023)	(0,00)
21.716	Sprout Social Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(1.867)	(0,00)
483.532	Sprouts Farmers Market Inc	Goldman Sachs International	(59.545)	(0,01)
(359.091)	Standard Chartered Plc	Société Générale	(1.253)	(0,00)
400	Stanley Black & Decker Inc	Goldman Sachs International	(1.036)	(0,00)
200	Starbucks Corp	Goldman Sachs International	(392)	(0,00)
(300)	State Street Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
44.129	Stericycle Inc	Morgan Stanley	(603)	(0,00)
78.126	STERIS Plc	Morgan Stanley	(1.641)	(0,00)
300	STERIS Plc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
1.800.000	Stillwater Mining Co	Bank of America Merrill Lynch	(13.773)	(0,00)
(222.931)	Structure Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(67.823)	(0,01)
47.949	Stryker Corp	Goldman Sachs International	(6.670)	(0,00)
38	Summit Hotel Properties Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(4.860)	Summit Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	(304)	(0,00)
(36)	SunCoke Energy Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(150.154)	Suncor Energy Inc	Goldman Sachs International	(3.460)	(0,00)
(200.620)	Suncor Energy Inc	JPMorgan Chase Bank	(13.413)	(0,00)
7.138	Supernus Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	(46)	(0,00)
2.691.311	Svenska Handelsbanken	Goldman Sachs International	(10.071)	(0,00)
960.833	Swedbank AB Class A	JPMorgan Chase Bank	(1.616)	(0,00)
803.552	Swedish Orphan Biovitrum AB	Goldman Sachs International	(3.138)	(0,00)
569.289	Swedish Orphan Biovitrum AB	JPMorgan Chase Bank	(2.549)	(0,00)
265.969	Swiss Life Holding AG	Goldman Sachs International	(13.950)	(0,00)
(122.595)	Swiss Prime Site AG	Société Générale	(196)	(0,00)
(309.869)	Swiss Re AG	Goldman Sachs International	(2.102)	(0,00)
(1.300)	Synchrony Financial	Goldman Sachs International	(1.803)	(0,00)
200	Synopsys Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
74.604	Synopsys Inc	Morgan Stanley	(3.218)	(0,00)
43.707	Synovus Financial Corp	Morgan Stanley	(2.812)	(0,00)
1.000	Sysco Corp	Goldman Sachs International	(1.484)	(0,00)
(200)	T Rowe Price Group Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(83.378)	Take-Two Interactive Software Inc	JPMorgan Chase Bank	(5.670)	(0,00)
(13.622)	Take-Two Interactive Software Inc	Goldman Sachs International	(336)	(0,00)
71.305	Take-Two Interactive Software Inc	Morgan Stanley	(6.249)	(0,00)
(68.304)	Talen Energy Corp	Morgan Stanley	(421)	(0,00)
28.721	Tandem Diabetes Care Inc	Morgan Stanley	(13.673)	(0,00)
(310.573)	Tandem Diabetes Care Inc	Goldman Sachs International	(47.605)	(0,01)
53.569	Targa Resources Corp	Morgan Stanley	(24.505)	(0,01)
(400)	Targa Resources Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
300	Target Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(586.392)	TC Energy Corp	JPMorgan Chase Bank	(27.911)	(0,01)
(462.538)	TC Energy Corp	Goldman Sachs International	(24.720)	(0,01)
(800)	TE Connectivity Ltd	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
(128.895)	TechnipFMC Plc	JPMorgan Chase Bank	(2.013)	(0,00)
35.571	TechnipFMC Plc	Morgan Stanley	(8.517)	(0,00)
46	TechTarget Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(300)	Teledyne Technologies Inc	Goldman Sachs International	(202)	(0,00)
77.983	Teledyne Technologies Inc	Morgan Stanley	(961)	(0,00)
200	Teleflex Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
41.296	Tempur Sealy International Inc	Morgan Stanley	(4.070)	(0,00)
108.629	Tencent Holdings Ltd	Morgan Stanley	(19.463)	(0,00)
1.385.798	Tencent Holdings Ltd	Goldman Sachs International	(2.327)	(0,00)
(87.947)	Tenet Healthcare Corp	Morgan Stanley	(807)	(0,00)
(102.556)	Teradata Corp	Morgan Stanley	(14.528)	(0,00)
(100)	Teradyne Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(69.859)	Terns Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	(13.432)	(0,00)
(66.539)	Terns Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	(9.688)	(0,00)
100	Texas Instruments Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
70.256	Texas Instruments Inc	Morgan Stanley	(8.124)	(0,00)
(89.282)	Texas Roadhouse Inc	Morgan Stanley	(684)	(0,00)
(800)	Textron Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
5.728	TG Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	(9.148)	(0,00)
48	Thryv Holdings Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(8)	Titan International Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
500	TJX Cos Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
67.541	T-Mobile US Inc	Morgan Stanley	(10.239)	(0,00)
49.297	T-Mobile US Inc	JPMorgan Chase Bank	(3.608)	(0,00)
89.287	T-Mobile US Inc	Goldman Sachs International	(10.040)	(0,00)
53.239	Toast Inc Class A	Morgan Stanley	(21.839)	(0,00)
84.070	Toast Inc Class A	Goldman Sachs International	(4.904)	(0,00)
105.239	Toast Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(8.703)	(0,00)
87.117.261	Tokyu Corp	Société Générale	(1.403)	(0,00)
(30.743)	Toll Brothers Inc	Goldman Sachs International	(1.741)	(0,00)
42.283	TopBuild Corp	Morgan Stanley	(3.061)	(0,00)
70.319	Toro Co	Morgan Stanley	(8.592)	(0,00)
63.552	Tractor Supply Co	Morgan Stanley	(15.534)	(0,00)
300	Tractor Supply Co	Goldman Sachs International	(951)	(0,00)
40.633	Trade Desk Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(259)	(0,00)
62.785	Tradeweb Markets Inc Class A	Morgan Stanley	(14.285)	(0,00)
(349.839)	Trane Technologies Plc	JPMorgan Chase Bank	(6.169)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(820.564)	Trane Technologies Plc	Goldman Sachs International	(21.499)	(0,00)
59.469.952	Transcosmos Inc	Nomura	(1.643)	(0,00)
(259.913)	TransUnion	JPMorgan Chase Bank	(1.878)	(0,00)
53.347	TransUnion	Morgan Stanley	(24.496)	(0,01)
(167.833)	TransUnion	Goldman Sachs International	(516)	(0,00)
100	Travelers Cos Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
19.146	TreeHouse Foods Inc	JPMorgan Chase Bank	(884)	(0,00)
(2.100)	Trimble Inc	Goldman Sachs International	(60)	(0,00)
(86.911)	Trip.com Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	(8.021)	(0,00)
(51.302)	Trip.com Group Ltd	Goldman Sachs International	(2.036)	(0,00)
329	Tritium DCFC Ltd	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
76.555	Truist Financial Corp	Morgan Stanley	(2.438)	(0,00)
74.073	Tyler Technologies Inc	Morgan Stanley	(5.208)	(0,00)
(103.448)	Tyson Foods Inc Class A	Morgan Stanley	(600)	(0,00)
400	Tyson Foods Inc Class A	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
71.452	Uber Technologies Inc	Morgan Stanley	(8.542)	(0,00)
(1.700)	Uber Technologies Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
(17.500.000)	Uber Technologies Inc1	Goldman Sachs International	(320.750)	(0,04)
44.099	Ubiquiti Inc	Morgan Stanley	(601)	(0,00)
(2.000)	UDR Inc	Goldman Sachs International	(24)	(0,00)
72.172	UDR Inc	Morgan Stanley	(5.919)	(0,00)
(92.380)	UGI Corp	Morgan Stanley	(5.810)	(0,00)
72.475	UiPath Inc Class A	Morgan Stanley	(840)	(0,00)
(273.015)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs International	(12.726)	(0,00)
(223.675)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	JPMorgan Chase Bank	(8.178)	(0,00)
39.596	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Morgan Stanley	(3.832)	(0,00)
(189.841)	Unicredit SpA	Goldman Sachs International	(9.268)	(0,00)
(136.356)	Union Pacific Corp	Morgan Stanley	(750)	(0,00)
(500)	Union Pacific Corp	Goldman Sachs International	(270)	(0,00)
(1.200)	United Airlines Holdings Inc	Goldman Sachs International	(143)	(0,00)
1.342.237	United Parcel Service Inc Class B	Goldman Sachs International	(2.708)	(0,00)
(1.190.500)	United Rentals Inc	Goldman Sachs International	(8.914)	(0,00)
100	UnitedHealth Group Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(27)	Universal Health Realty Income Trust	Goldman Sachs International	(9)	(0,00)
500.222	Universal Health Services Inc Class B	Goldman Sachs International	(21.588)	(0,00)
300	US Bancorp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
70.585	US Bancorp	Morgan Stanley	(6.196)	(0,00)
33	USANA Health Sciences Inc	Goldman Sachs International	(18)	(0,00)
9.512	Vail Resorts Inc	Morgan Stanley	(161)	(0,00)
200	Valero Energy Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(138.969)	Veeva Systems Inc Class A	Morgan Stanley	(6.466)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
7.239	Veralto Corp	Goldman Sachs International	(10.945)	(0,00)
(145.920)	VeriSign Inc	Morgan Stanley	(12.967)	(0,00)
183.930	VeriSign Inc	JPMorgan Chase Bank	(1.710)	(0,00)
93.921	VeriSign Inc	Goldman Sachs International	(767)	(0,00)
(300)	Verisk Analytics Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
41.535	Verizon Communications Inc	Morgan Stanley	(1.924)	(0,00)
(200)	Verizon Communications Inc	Goldman Sachs International	(145)	(0,00)
(44.510)	Vertex Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(544)	(0,00)
126.630	Vertex Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	(38.276)	(0,01)
(164.535)	VF Corp	Goldman Sachs International	(8.672)	(0,00)
(18)	Viad Corp	Goldman Sachs International	(4)	(0,00)
(3.000)	Viatis Inc	Goldman Sachs International	(225)	(0,00)
(2.100)	VICI Properties Inc	Goldman Sachs International	(310)	(0,00)
(171.340)	Visa Inc Class A	Goldman Sachs International	(8.264)	(0,00)
(800)	Vistra Corp	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
281.504	Vita Coco Co Inc	Goldman Sachs International	(34.655)	(0,01)
77.727	Vita Coco Co Inc	JPMorgan Chase Bank	(4.837)	(0,00)
(100)	Vulcan Materials Co	Goldman Sachs International	(181)	(0,00)
67.350	Vulcan Materials Co	Morgan Stanley	(11.412)	(0,00)
3.700	Walgreens Boots Alliance Inc	Goldman Sachs International	(5.484)	(0,00)
44.169	Walmart Inc	Morgan Stanley	(2.928)	(0,00)
(223.166)	Walt Disney Co	Morgan Stanley	(12.236)	(0,00)
400	Walt Disney Co	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
29.542	Warner Bros Discovery Inc	Morgan Stanley	(475)	(0,00)
(106.191)	Warner Music Group Corp Class A	Morgan Stanley	(15.462)	(0,00)
67.841	Waste Management Inc	Morgan Stanley	(10.512)	(0,00)
(500)	Waste Management Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
66.751	Watsco Inc	Morgan Stanley	(11.830)	(0,00)
(29.865)	WaVe Life Sciences Ltd	Morgan Stanley	(263)	(0,00)
(235.253)	Wayfair Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(24.712)	(0,01)
3.600.000	Wayfair Inc	Nomura	(5.402)	(0,00)
(500)	WEC Energy Group Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(100)	Wells Fargo & Co	Goldman Sachs International	(199)	(0,00)
70.914	Wells Fargo & Co	Morgan Stanley	(9.489)	(0,00)
200	Welltower Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
77.422	Welltower Inc	Morgan Stanley	(1.667)	(0,00)
100	West Pharmaceutical Services Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
52.195	Western Digital Corp	Morgan Stanley	(24.818)	(0,01)
(91.012)	Western Union Co	Morgan Stanley	(5.986)	(0,00)
500	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
69.371	Westlake Corp	Morgan Stanley	(7.860)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (1,10%) (31 de diciembre de 2023: (1,26%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
200	Westrock Co	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(136.305)	Weyerhaeuser Co	Morgan Stanley	(4.313)	(0,00)
2.600	Weyerhaeuser Co	Goldman Sachs International	(771)	(0,00)
42.292	Whirlpool Corp	Morgan Stanley	(3.248)	(0,00)
43.520	White Mountains Insurance Group	Morgan Stanley	(1.892)	(0,00)
62.570	Williams Cos Inc	Morgan Stanley	(14.703)	(0,00)
(1.400)	Williams Cos Inc	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
27.813	Wix.Com Ltd	Goldman Sachs International	(166)	(0,00)
(93.974)	WK Kellogg Co	Morgan Stanley	(10.119)	(0,00)
209.950	Woodside Energy Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	(6.442)	(0,00)
(18)	World Acceptance Corp	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(74.352)	Worldline SA	JPMorgan Chase Bank	(31)	(0,00)
71.244	WR Berkley Corp	Morgan Stanley	(5.405)	(0,00)
300	WR Berkley Corp	Goldman Sachs International	(696)	(0,00)
(300)	Wynn Resorts Ltd	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(459.862)	Wynn Resorts Ltd	Morgan Stanley	(52.939)	(0,01)
(70.839)	Xenon Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(13.284)	(0,00)
(216.995)	Xenon Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	(3.453)	(0,00)
4.081	Xero Ltd	Morgan Stanley	(60)	(0,00)
77.151	Xero Ltd	JPMorgan Chase Bank	(1.678)	(0,00)
5.511	Xero Ltd	Goldman Sachs International	(94)	(0,00)
1.159.842	Xero Ltd	Nomura	(662)	(0,00)
56.660	Xylem Inc	Morgan Stanley	(20.887)	(0,00)
300	Xylem Inc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
(10.596)	Zai Lab Ltd	Morgan Stanley	(308)	(0,00)
(251.251)	Zai Lab Ltd	JPMorgan Chase Bank	(57.691)	(0,01)
62.433	Zebra Technologies Corp Class A	Morgan Stanley	(16.089)	(0,00)
(400)	Zebra Technologies Corp Class A	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
64.843	Zillow Group Inc Class C	Morgan Stanley	(11.095)	(0,00)
(76.901)	Zillow Group Inc Class C	Goldman Sachs International	(101)	(0,00)
50.192	Zoetis Inc	Goldman Sachs International	(3.884)	(0,00)
(147.810)	Zoom Video Communications Inc Class A	Morgan Stanley	(12.460)	(0,00)
88.303	Zscaler Inc	JPMorgan Chase Bank	(5.953)	(0,00)
33.499	Zscaler Inc	Goldman Sachs International	(3.400)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos por diferencias ^{oo}			(9.751.332)	(1,10)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Swaptions vendidos(0,01%) (31 de diciembre de 2023: (0,00%))

Nocional Vega	Fecha de vencimiento	Descripción	Contraparte	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Swaptions de venta					
(120.000.000) EUR	17/07/2024	Swaption en EUR, en caso de que se ejerza la opción, la Cartera formalizará un swap con un valor nominal de 120.000.000 EUR en el que abonará un tipo del 1,00% y recibirá iTraxx EUR S41, ejercicio 8,00%	Merrill Lynch International	(42.212)	(0,01)
(60.000.000) EUR	17/07/2024	Swaption en EUR, en caso de que se ejerza la opción, la Cartera formalizará un swap con un valor nominal de 60.000.000 EUR en el que abonará un tipo del 1,00% y recibirá iTraxx EUR S41, ejercicio 8,00%	Merrill Lynch International	(21.106)	(0,00)
Total valor razonable en swaptions suscritos[∞] (Prima: 171.038 USD)				(63.318)	(0,01)

Contratos de credit default swap (0,04%) (31 de diciembre de 2023: (0,08%))

Importe nominal	Fecha de extinción	Contraparte	Obligación de referencia	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
1.000.000 USD	20/06/2025	Goldman Sachs International	Selling default protection on Meituan, 2.13%, 28/10/2025	(5.615)	(0,00)
1.040.000 USD	20/06/2027	Goldman Sachs International	Selling default protection on SK Hynix, 2.36%, 19/01/2031	(13.625)	(0,00)
1.100.000 USD	20/12/2026	JPMorgan Chase Bank	Selling default protection on Simon Property Group LP, 2.65%, 15/07/2030	(16.459)	(0,00)
2.500.000 USD	20/06/2027	Goldman Sachs International	Selling default protection on SK Hynix, 2.36%, 19/01/2031	(32.753)	(0,00)
13.000.000 EUR	20/12/2024	Nomura	Selling default protection on POSCO Holdings Inc, 2.75%, 15/07/2024	(41.029)	(0,00)
500.000.000 JPY	20/12/2026	Goldman Sachs International	Selling default protection on ANA Holdings Inc, 1.22%, 06/03/2024	(57.908)	(0,01)
750.000.000 JPY	20/12/2026	JPMorgan Chase Bank	Selling default protection on ANA Holdings Inc, 1.22%, 06/03/2024	(86.863)	(0,02)
17.700.000 USD	20/06/2025	Goldman Sachs International	Selling default protection on Meituan, 2.13%, 28/10/2025	(99.381)	(0,01)
Total valor razonable en contratos de credit default swap[∞]				(353.633)	(0,04)

Contratos de swap de tipos de interés (0,02%) (31 de diciembre de 2023: (0,56%))

	Importe nominal	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar) [#]	Tipo fijo	Tipo variable	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
EUR	200.000.000	20/11/2024	Merrill Lynch International	Recibir	3,52%	1D €STR	(4.574)	(0,00)
EUR	800.000.000	18/06/2025	Merrill Lynch International	Recibir	3,09%	1D €STR	(6.774)	(0,00)
EUR	800.000.000	18/06/2025	Merrill Lynch International	(Pagar)	2,98%	1D €STR	(20.878)	(0,00)
EUR	29.400.000	18/06/2026	Merrill Lynch International	(Pagar)	2,88%	1D €STR	(31.216)	(0,00)
EUR	32.389.000	18/06/2026	Merrill Lynch International	(Pagar)	2,88%	1D €STR	(35.685)	(0,01)
EUR	800.000.000	18/12/2024	Merrill Lynch International	Recibir	3,47%	1D €STR	(70.504)	(0,01)
Minusvalía latente total sobre contratos de swap de tipos de interés[∞]							(169.631)	(0,02)

[#] Recibir - El fondo recibe un tipo variable y paga un tipo fijo.

(Paga) – El Fondo paga un tipo variable y recibe un tipo fijo.

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de *swap* de rentabilidad total (0,18%) (31 de diciembre de 2023: (0,20%))

Importe nominal	Fecha de extinción	Tipo variable	Entidad de referencia	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
30.650 USD	24/09/2024	0,80 ¹	Morgan Stanley Basket MSCBSSHU ²	(127)	(0,00)
(111.645) USD	06/11/2024	5,11 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUIQQ ²	(536)	(0,00)
(346.454) USD	06/11/2024	5,33 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUXRT ²	(549)	(0,00)
(221.172) USD	06/11/2024	5,08 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUXLV ²	(784)	(0,00)
(21.972) USD	05/03/2025	5,02 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUIGV ²	(1.784)	(0,00)
(218.022) USD	06/11/2024	5,08 ³	Morgan Stanley Basket MSNBURSP ²	(2.356)	(0,00)
(43.401) USD	06/11/2024	5,11 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUIQQ ²	(2.728)	(0,00)
856.044 USD	06/11/2024	5,11 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUIQQ ²	(2.749)	(0,00)
(226.495) USD	06/11/2024	5,76 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUXBI ²	(3.056)	(0,00)
(750.409) USD	06/11/2024	5,33 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUXRT ²	(3.443)	(0,00)
584.249 USD	06/11/2024	5,76 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUIHI ²	(3.513)	(0,00)
(733.049) EUR	12/11/2025	3,15 ⁴	Morgan Stanley Basket MSABEUPH ²	(5.237)	(0,00)
(1.773.371) USD	06/11/2024	4,03 ³	Morgan Stanley Basket MSACHDGE ²	(6.149)	(0,00)
(364.112) USD	06/11/2024	5,33 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY ²	(7.692)	(0,00)
(562.947) USD	06/11/2024	5,33 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUXRT ²	(7.891)	(0,00)
(658.061) USD	06/11/2024	5,11 ³	Morgan Stanley Basket MSABHLTH ²	(8.907)	(0,00)
(135.129) USD	24/09/2024	(0,80) ¹	Morgan Stanley Basket MSCBSMMU ²	(9.075)	(0,00)
(551.142) USD	06/11/2024	5,76 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUIWM ²	(9.357)	(0,00)
(575.687) USD	06/11/2024	5,33 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY ²	(9.999)	(0,00)
(603.577) USD	06/11/2024	5,76 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUIWM ²	(10.480)	(0,00)
(713.549) USD	24/09/2024	(0,80) ¹	Morgan Stanley Basket MSCBSMMU ²	(12.129)	(0,00)
(676.207) USD	06/11/2024	5,33 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY ²	(14.128)	(0,00)
(495.549) EUR	12/11/2025	3,15 ⁴	Morgan Stanley Basket MSABMCPH ²	(14.186)	(0,00)
(444.086) USD	06/11/2024	4,54 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUIAM ²	(14.742)	(0,00)
(210.607) USD	06/11/2024	5,03 ⁵	Morgan Stanley Basket MSNBUXLC ²	(14.972)	(0,00)
(102.845) USD	24/09/2024	(0,80) ¹	Morgan Stanley Basket MSCBSMMU ²	(15.431)	(0,00)
(348.585) USD	10/03/2026	5,03 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUXLY ²	(15.578)	(0,00)
(205.496) USD	05/03/2025	5,02 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUIGV ²	(19.571)	(0,00)
(634.012) USD	10/03/2026	5,03 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUXLY ²	(21.482)	(0,00)
(222.501) USD	06/11/2024	5,76 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUIWM ²	(21.576)	(0,00)
(901.662) USD	24/09/2024	(0,80) ¹	Morgan Stanley Basket MSCBSMMU ²	(24.444)	(0,00)
(684.015) USD	25/02/2026	(0,90) ¹	Morgan Stanley Basket MSZZMOMO ²	(31.129)	(0,01)
(589.529) USD	06/11/2024	5,11 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUIQQ ²	(39.225)	(0,01)
(1.249.033) USD	06/11/2024	5,33 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUXLP ²	(48.449)	(0,01)
(843.562) USD	24/09/2024	(0,80) ¹	Morgan Stanley Basket MSCBSMMU ²	(50.353)	(0,01)
(625.279) USD	24/09/2024	(0,80) ¹	Morgan Stanley Basket MSCBSMMU ²	(69.519)	(0,01)
(1.165.110) USD	06/11/2024	5,76 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUXBI ²	(77.446)	(0,01)
(176.409) USD	06/11/2024	4,99 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUSMH ²	(103.632)	(0,01)
(903.962) USD	06/11/2024	5,33 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY ²	(169.875)	(0,02)
(857.317) USD	06/11/2024	5,11 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUIQQ ²	(209.213)	(0,02)
(880.935) USD	06/11/2024	5,03 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUXLK ²	(225.260)	(0,03)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de *swap* de rentabilidad total (0,18%) (31 de diciembre de 2023: (0,20%)) (cont.)

Importe nominal	Fecha de extinción	Tipo variable	Entidad de referencia	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(1.270.051) USD	06/11/2024	5,03 ³	Morgan Stanley Basket MSNBUXLC ²	(316.409)	(0,04)
Minusvalía latente total sobre contratos de <i>swap</i> de rentabilidad total [∞]				(1.625.161)	(0,18)

¹ Coste de financiación fijo.

² La contraparte en este contrato de *swap* de rentabilidad total es Morgan Stanley.

³ El FEDEF a 1 día es la referencia para este contrato de *swap* de rentabilidad total.

⁴ El EURIBOR a 1 meses es la referencia para este contrato de *swap* de rentabilidad total.

Contratos de *swap* de varianza (0,05 %) (31 de diciembre de 2023: (0,03%))

Importe teórico Vega	Fecha de extinción	Contraparte	Obligación de referencia	Tipo de ejercicio de varianza	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
500.000 USD	19/12/2025	BNP Paribas	S&P 500 Index vs Nikkei 225 Index	29,03% vs 32,03%	(2.171)	(0,00)
63.000 EUR	20/06/2025	BNP Paribas	BNP 15 Names EU Basket	Varios	(8.235)	(0,00)
100.000 USD	19/12/2025	BNP Paribas	UBS 50 Names Global Basket	27,55% vs 30,70%	(17.466)	(0,00)
40.000 EUR	19/12/2025	JPMorgan Chase Bank	Euro Stoxx Banks Index UpVar	21,45%	(19.951)	(0,00)
750.000 USD	19/12/2025	BNP Paribas	Russell 2000 Index vs Nasdaq-100 Index	24,60% vs 27,95%	(57.561)	(0,01)
100.000 EUR	20/06/2025	Citibank NA	CITI 20 Names EU Basket	Varios	(59.025)	(0,01)
27.500 EUR	20/09/2024	JPMorgan Chase Bank	Euro Stoxx Banks Index UpVar	11,40%	(87.348)	(0,01)
45.000 USD	20/12/2024	Goldman Sachs International	Euro Stoxx Banks Index vs S&P 500 Index	22,80% vs 16,40% ¹	(178.972)	(0,02)
Minusvalía latente total sobre contratos de <i>swap</i> de varianza [∞]					(430.729)	(0,05)

¹ Tipo de ejercicio de volatilidad

Contratos de *swap* sobre volatilidad (0,70%) (31 de diciembre de 2023: (0,56%))

Importe nominal	Fecha de extinción	Contraparte	Obligación de referencia ¹	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
20.000.000 USD	17/01/2025	Morgan Stanley	MS 31 Names US Basket	(6.176)	(0,00)
20.000.000 USD	17/01/2025	Morgan Stanley	MS 22 Names US Basket	(17.781)	(0,00)
40.000.000 EUR	20/12/2024	BNP	BNP 15 Names EU Basket	(19.854)	(0,00)
3.750.000 EUR	20/12/2024	BNP	BNP 20 Names EU Basket	(24.025)	(0,00)
21.363.700 USD	17/01/2025	Citibank NA	CITI 25 Names US Basket	(24.705)	(0,00)
17.500.000 USD	17/01/2025	Morgan Stanley	MS 27 Names US Basket	(25.225)	(0,00)
10.000.000 EUR	20/12/2024	BofA Securities	BAML 12 Names EU Basket	(28.396)	(0,00)
10.000.000 EUR	20/12/2024	BNP	BNP 20 Names EU Basket	(39.450)	(0,01)
30.000.000 USD	17/01/2025	BofA Securities	BAML 22 Names US Basket	(42.262)	(0,01)
30.000.000 USD	20/06/2025	Nomura	Nomura 20 Names Global Basket	(78.758)	(0,01)
11.500.000 USD	20/12/2024	BNP	BNP 16 Names EU Basket	(79.212)	(0,01)
10.000.000 EUR	20/12/2024	Morgan Stanley	MS 15 Names EU Basket	(127.302)	(0,01)
22.500.000 EUR	17/01/2025	BNP	BNP 38 Names Global Basket	(147.626)	(0,02)
35.000.000 EUR	20/12/2024	Société Générale	SG 12 Names EU Basket	(176.303)	(0,02)
20.000.000 USD	20/06/2025	BNP	BNP 31 Names Global Basket	(205.122)	(0,02)

Uncorrelated Strategies - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de *swap* sobre volatilidad (0,70%) (31 de diciembre de 2023: (0,56%)) (cont.)

Importe nominal	Fecha de extinción	Contraparte	Obligación de referencia ¹	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
12.500.000 EUR	20/12/2024	BNP	BNP 20 Names EU Basket	(210.318)	(0,02)
20.000.000 USD	17/01/2025	JPMorgan Chase Bank	JPMorgan Chase Bank 16 Names US Basket	(216.962)	(0,02)
40.000.000 USD	17/01/2025	UBS	UBS 29 Names US Basket	(220.975)	(0,03)
20.000.000 USD	17/01/2025	Morgan Stanley	MS 22 Names US Basket	(271.020)	(0,03)
30.000.000 EUR	20/12/2024	BNP	BNP 10 Names EU Basket	(334.175)	(0,04)
20.000.000 USD	17/01/2025	BofA Securities	BAML 19 Names US Basket	(373.877)	(0,04)
21.551.100 EUR	20/12/2024	Société Générale	SG 15 Names Global Basket	(401.895)	(0,05)
50.000.000 USD	17/01/2025	Citibank NA	CITI 24 Names US Basket	(444.215)	(0,05)
20.000.000 USD	17/01/2025	Morgan Stanley	MS 26 Names US Basket	(478.112)	(0,05)
23.500.000 EUR	17/01/2025	BNP	BNP 43 Names EU Basket	(486.853)	(0,06)
20.000.000 USD	17/01/2025	BofA Securities	BAML 27 Names US Basket	(528.240)	(0,06)
30.000.000 USD	17/01/2025	Morgan Stanley	MS 16 Names US Basket	(1.215.997)	(0,14)
Minusvalía latente total sobre contratos de <i>swap</i> de volatilidad [∞]				(6.224.836)	(0,70)

¹ Los contratos de *swap* de volatilidad están denominados en varias divisas extranjeras basadas en las divisas locales de las posiciones del *swap*.

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(195.262.421)	(21,88)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	534.936.916	59,92
Otro activo neto	357.773.470	40,08
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	892.710.386	100,00

Análisis de la cartera	USD	% de los activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	40.378.822	3,57
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	458.245.095	40,58
± Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	41.269.430	3,65
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC y compensados de forma centralizada	(4.956.431)	(0,44)
Total inversiones	534.936.916	47,36

US Equity - Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Número de acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 101,27% (31 de diciembre de 2023: 93,23%)			
Dólar estadounidense			
9.110	AbbVie Inc	1.562.547	2,12
585	Adobe Inc	324.991	0,44
4.978	Advanced Micro Devices Inc	807.481	1,09
19.172	Alphabet Inc Class A	3.492.180	4,73
31.720	Amazon.com Inc	6.129.890	8,31
3.485	Amphenol Corp Class A	234.784	0,32
4.189	Analog Devices Inc	956.181	1,30
18.955	Apple Inc	3.992.302	5,41
267	ASML Holding NV	273.069	0,37
3.568	Avery Dennison Corp	780.143	1,06
16.346	Boston Scientific Corp	1.258.805	1,71
1.664	Broadcom Inc	2.671.602	3,62
22.383	Brookfield Asset Management Ltd Class A	851.673	1,15
4.226	CDW Corp	945.948	1,28
20.221	Chewy Inc Class A	550.820	0,75
3.186	CME Group Inc Class A	626.368	0,85
1.393	Constellation Energy Corp	278.976	0,38
1.216	Costco Wholesale Corp	1.033.588	1,40
3.074	Dollar Tree Inc	328.211	0,44
660	Eli Lilly & Co	597.551	0,81
4.079	Equifax Inc	988.994	1,34
1.465	Home Depot Inc	504.312	0,68
2.543	Intuit Inc	1.671.285	2,27
25.922	Keurig Dr Pepper Inc	865.795	1,17
3.329	Mastercard Inc Class A	1.468.622	1,99
20.869	Match Group Inc	634.000	0,86
4.304	McDonald's Corp	1.096.831	1,49
8.158	Meta Platforms Inc Class A	4.113.427	5,57
1.848	Micron Technology Inc	243.067	0,33
15.819	Microsoft Corp	7.070.302	9,58
2.782	Netflix Inc	1.877.516	2,54
18.676	NextEra Energy Inc	1.322.448	1,79
13.658	NIKE Inc Class B	1.029.403	1,40
2.669	Novo Nordisk A/S ADR	380.973	0,52
45.557	NVIDIA Corp	5.628.112	7,63
7.818	Okta Inc Class A	731.843	0,99
3.080	S&P Global Inc	1.373.680	1,86
8.156	Salesforce Inc	2.096.908	2,84
1.797	ServiceNow Inc	1.413.646	1,92

US Equity - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Número de Acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 101,27% (31 de diciembre de 2023: 93,23%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
12.441	Sweetgreen Inc Class A	374.972	0,51
1.860	Synopsys Inc	1.106.812	1,50
6.209	TE Connectivity Ltd	934.020	1,27
2.687	Thermo Fisher Scientific Inc	1.485.911	2,01
14.688	TJX Cos Inc	1.617.149	2,19
6.526	Uber Technologies Inc	474.310	0,64
2.897	Union Pacific Corp	655.475	0,89
2.531	UnitedHealth Group Inc	1.288.937	1,75
6.887	Visa Inc Class A	1.807.631	2,45
16.593	Walmart Inc	1.123.512	1,52
2.461	Waste Management Inc	525.030	0,71
5.013	Workday Inc Class A	1.120.706	1,52
Total valores de renta variable *		74.722.739	101,27
Total inversiones		74.722.739	101,27

Contratos de divisas a plazo 0,55% (31 de diciembre de 2023: 2,55%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases EUR con cobertura</i>						
90 USD	83 EUR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
<i>Clases JPY con cobertura</i>						
2.516.589 USD	388.468.164 JPY	18/07/2024	Citibank NA	6	95.621	0,13
662.672 USD	100.518.440 JPY	18/07/2024	Royal Bank of Canada	2	36.232	0,05
197.691 USD	31.467.997 JPY	18/07/2024	UBS AG	1	1.579	0,00
8.245.106 USD	1.279.120.138 JPY	18/07/2024	Westpac Banking Corp	3	273.515	0,37
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					406.947	0,55

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	75.129.686	101,82

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (2,35%) (31 de diciembre de 2023: (0,24%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases EUR con cobertura</i>						
28.070 EUR	30.120 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	1	(13)	(0,00)
<i>Clases JPY con cobertura</i>						
4.556.102.117 JPY	29.998.549 USD	18/07/2024	Citibank NA	8	(1.604.514)	(2,17)
24.558.166 JPY	158.768 USD	18/07/2024	Royal Bank of Canada	1	(5.719)	(0,01)

US Equity - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo (2,35%) (31 de diciembre de 2023: (0,24%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases JPY con cobertura (cont.)</i>						
261.505.598 JPY	1.693.422 USD	18/07/2024	UBS AG	5	(63.696)	(0,09)
214.011.883 JPY	1.390.958 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	4	(57.217)	(0,08)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(1.731.159)	(2,35)

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(1.731.159)	(2,35)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	73.398.527	99,47
Otro activo neto	385.696	0,53
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	73.784.223	100,00

Análisis de la cartera	USD	% de los activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	74.722.739	98,56
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(1.324.212)	(1,75)
Total inversiones	73.398.527	96,81

US Equity Index PutWrite - Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Importe principal	Descripción de los valores	Cupón	Fecha de vencimiento	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Bonos del Estado 94,75% (31 de diciembre de 2023: 90,98%)					
Dólar estadounidense					
97.500.000	United States Treasury Note/Bond	4,00%	15/12/2025	96.256.494	13,54
96.900.000	United States Treasury Note/Bond	4,13%	15/06/2026	95.798.519	13,47
108.300.000	United States Treasury Note/Bond	4,25%	31/05/2025	107.400.491	15,10
87.200.000	United States Treasury Note/Bond	4,25%	31/01/2026	86.372.281	12,15
72.200.000	United States Treasury Note/Bond	4,63%	28/02/2025	71.905.490	10,11
102.200.000	United States Treasury Note/Bond	4,63%	15/03/2026	101.856.671	14,33
114.200.000	United States Treasury Note/Bond	5,00%	31/08/2025	114.126.395	16,05
Total bonos del Estado *				673.716.341	94,75
Total inversiones				673.716.341	94,75

Contratos de divisas a plazo 0,78% (31 de diciembre de 2023: 1,67%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases EUR con cobertura</i>						
10.417.968 EUR	11.144.279 USD	18/07/2024	Citibank NA	4	29.710	0,00
60.443 EUR	64.587 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	242	0,00
285.261 EUR	305.190 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	14	774	0,00
2.591.870 USD	2.386.704 EUR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	47	31.962	0,01
<i>Clases GBP con cobertura</i>						
5.524.042 GBP	6.897.478 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	2	86.139	0,01
268.375.482 GBP	335.307.309 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	42	3.979.015	0,56
1.056.680 USD	829.511 GBP	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	7.994	0,00
183.161.614 USD	143.769.855 GBP	18/07/2024	Westpac Banking Corp	45	1.404.528	0,20
<i>Clases SGD con cobertura</i>						
26.999 SGD	19.908 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	3	29	0,00
1.120.241 SGD	826.948 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	20	293	0,00
22.813 USD	30.716 SGD	18/07/2024	Citibank NA	2	131	0,00
14.668 USD	19.775 SGD	18/07/2024	Goldman Sachs International	2	65	0,00
30.413 USD	40.985 SGD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	11	146	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					5.541.028	0,78

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	679.257.369	95,53

US Equity Index PutWrite - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,04%) (31 de diciembre de 2023: (0,07%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases EUR con cobertura</i>						
105.151 EUR	114.629 USD	18/07/2024	Citibank NA	1	(1.847)	(0,00)
228.046 EUR	245.355 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	2	(760)	(0,00)
438.135 EUR	474.953 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	17	(5.021)	(0,00)
72.774 USD	68.035 EUR	18/07/2024	Citibank NA	1	(198)	(0,00)
103.587 USD	97.067 EUR	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	(525)	(0,00)
514.967 USD	481.577 EUR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	15	(1.558)	(0,00)
<i>Clases GBP con cobertura</i>						
2.960.139 GBP	3.762.502 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	2	(20.228)	(0,00)
7.980.616 GBP	10.125.880 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	18	(36.606)	(0,00)
4.677.025 USD	3.753.783 GBP	18/07/2024	Citibank NA	2	(68.592)	(0,01)
8.443.687 USD	6.771.003 GBP	18/07/2024	Goldman Sachs International	3	(116.368)	(0,02)
4.477.589 USD	3.585.442 GBP	18/07/2024	Westpac Banking Corp	20	(55.207)	(0,01)
<i>Clases SGD con cobertura</i>						
20.362 SGD	15.070 USD	18/07/2024	Citibank NA	1	(34)	(0,00)
41.138 SGD	30.611 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	3	(232)	(0,00)
2.201.708 SGD	1.635.245 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	40	(9.395)	(0,00)
11.249 USD	15.260 SGD	18/07/2024	Citibank NA	2	(19)	(0,00)
17.366 USD	23.581 SGD	18/07/2024	Goldman Sachs International	2	(47)	(0,00)
8 USD	11 SGD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	2	(0)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(316.637)	(0,04)

Contratos de opciones suscritos (0,75%) (31 de diciembre de 2023: (0,72%))

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de venta				
(66)	05/07/2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,375.00	(24.420)	(0,00)
(17)	05/07/2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,385.00	(7.905)	(0,00)
(101)	12/07/2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,440.00	(290.880)	(0,04)
(112)	05/07/2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,445.00	(181.440)	(0,03)
(149)	12/07/2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,445.00	(452.960)	(0,06)
(109)	26/07/2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,475.00	(614.760)	(0,09)
(58)	26/07/2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,480.00	(338.720)	(0,05)
(29)	26/07/2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,485.00	(167.765)	(0,02)
(129)	05/07/2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,490.00	(426.345)	(0,06)
(128)	26/07/2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,490.00	(766.080)	(0,11)
(2)	02/08/2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,490.00	(13.690)	(0,00)
(20)	12/07/2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,495.00	(103.800)	(0,01)
(55)	12/07/2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,500.00	(297.825)	(0,04)
(304)	19/07/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$5,480.00	(1.530.640)	(0,22)

US Equity Index PutWrite - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones suscritos (0,75%) (31 de diciembre de 2023: (0,72%)) (cont.)

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de venta (cont.)				
(6)	19/07/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$5,495.00	(34.200)	(0,01)
(13)	19/07/2024	S&P 500 Index, Strike Price \$5,500.00	(77.415)	(0,01)
Total valor razonable en contratos de opciones suscritos* (Prima: 7.109.854 USD)			(5.328.845)	(0,75)

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(5.645.482)	(0,79)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	673.611.887	94,74
Otro activo neto	37.461.689	5,26
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	711.073.576	100,00

Análisis de la cartera		USD	% de los activos totales
*	Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	673.716.341	93,80
±	Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	(5.328.845)	(0,74)
∞	Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	5.224.391	0,73
Total inversiones		673.611.887	93,79

US Large Cap Value - Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Número de acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 98,01% (31 de diciembre de 2023: 95,28%)			
Dólar estadounidense			
20.637	AbbVie Inc	3.539.658	0,36
24.722	Advanced Micro Devices Inc	4.010.156	0,41
355.118	Agnico Eagle Mines Ltd	23.224.717	2,35
123.479	American International Group Inc	9.167.081	0,93
25.347	Analog Devices Inc	5.785.706	0,59
9.785	Aon Plc Class A	2.872.680	0,29
22.006	Avery Dennison Corp	4.811.612	0,49
1.395	Baker Hughes Co Class A	49.062	0,01
395.633	Bank of America Corp	15.734.324	1,59
87.320	Becton Dickinson & Co	20.407.557	2,07
60.759	Berkshire Hathaway Inc Class B	24.716.761	2,50
8.468	BlackRock Inc Class A	6.667.026	0,67
23.232	Capital One Financial Corp	3.216.470	0,33
459.311	CenterPoint Energy Inc	14.229.455	1,44
159.567	Citigroup Inc	10.126.122	1,02
35.231	Clorox Co	4.807.975	0,49
130.801	Colgate-Palmolive Co	12.692.929	1,28
110.536	ConocoPhillips	12.643.108	1,28
25.408	Cummins Inc	7.036.238	0,71
92.644	Danaher Corp	23.147.103	2,34
230.434	Dominion Energy Inc	11.291.266	1,14
235.147	DTE Energy Co	26.103.669	2,64
326.757	Duke Energy Corp	32.750.854	3,31
35.211	Elevance Health Inc	19.079.433	1,93
413.205	Exelon Corp	14.301.025	1,45
349.016	Exxon Mobil Corp	40.178.722	4,07
215.097	FirstEnergy Corp	8.231.762	0,83
553.547	Freeport-McMoRan Inc	26.902.384	2,72
10.938	Goldman Sachs Group Inc	4.947.476	0,50
8.139	HCA Healthcare Inc	2.614.898	0,26
1.461	Humana Inc	545.903	0,06
70.521	International Business Machines Corp	12.196.607	1,23
229.228	Johnson & Johnson	33.503.965	3,39
135.671	JPMorgan Chase & Co	27.440.817	2,78
368.409	Kroger Co	18.394.661	1,86
128.837	Las Vegas Sands Corp	5.701.037	0,58
277.923	Merck & Co Inc	34.406.867	3,48

US Large Cap Value - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Número de Acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 98,01% (31 de diciembre de 2023: 95,28%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
41.306	Micron Technology Inc	5.432.978	0,55
245.517	Mondelez International Inc Class A	16.066.633	1,63
7.425	Moody's Corp	3.125.405	0,32
51.086	Morgan Stanley	4.965.048	0,50
462.148	Newmont Corp	19.350.137	1,96
134.125	NextEra Energy Inc	9.497.391	0,96
93.036	Occidental Petroleum Corp	5.864.059	0,59
56.533	Oracle Corp	7.982.460	0,81
96.368	PayPal Holdings Inc	5.592.235	0,57
943.187	Pfizer Inc	26.390.372	2,67
129.439	Philip Morris International Inc	13.116.054	1,33
176.285	PNC Financial Services Group Inc	27.408.792	2,77
282.334	Procter & Gamble Co	46.562.523	4,71
203.011	Public Service Enterprise Group Inc	14.961.911	1,51
58.599	QUALCOMM Inc	11.671.749	1,18
295.485	Rio Tinto Plc ADR	19.481.326	1,97
45.092	S&P Global Inc	20.111.032	2,04
388.837	Sempra	29.574.942	2,99
16.694	Sherwin-Williams Co	4.981.990	0,50
152.418	Southern Copper Corp	16.421.515	1,66
35.843	Stryker Corp	12.195.581	1,23
87.801	Suncor Energy Inc	3.345.218	0,34
336.714	Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	5.471.603	0,55
3.225	Thermo Fisher Scientific Inc	1.783.425	0,18
23.346	T-Mobile US Inc	4.113.098	0,42
140.712	Truist Financial Corp	5.466.661	0,55
35.488	UBS Group AG	1.048.316	0,11
35.212	Valero Energy Corp	5.519.833	0,56
301.572	Verizon Communications Inc	12.436.829	1,26
462.262	Walmart Inc	31.299.760	3,17
23.931	Waste Management Inc	5.105.440	0,52
212.880	Wells Fargo & Co	12.642.943	1,28
406.020	Wheaton Precious Metals Corp	21.283.568	2,15
146.369	Williams Cos Inc	6.220.683	0,63
41.446	Zimmer Biomet Holdings Inc	4.498.134	0,46
Total valores de renta variable *		968.466.730	98,01
Total inversiones		968.466.730	98,01

US Large Cap Value - Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo 0,01% (31 de diciembre de 2023: 0,06%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases EUR con cobertura</i>						
10.984.237 EUR	11.750.346 USD	18/07/2024	Citibank NA	2	31.004	0,00
11.161.820 EUR	11.940.285 USD	18/07/2024	Standard Chartered Bank	3	31.536	0,01
186.967 EUR	199.831 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	11	704	0,00
189.571 USD	174.546 EUR	18/07/2024	Citibank NA	1	2.359	0,00
199.984 USD	184.414 EUR	18/07/2024	Standard Chartered Bank	1	2.187	0,00
1.785.873 USD	1.645.828 EUR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	69	20.611	0,00
<i>Clases GBP con cobertura</i>						
471.345 GBP	588.884 USD	18/07/2024	Standard Chartered Bank	5	7.001	0,00
23.838 GBP	29.743 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	6	394	0,00
18.082 USD	14.189 GBP	18/07/2024	Standard Chartered Bank	3	145	0,00
29.147 USD	22.866 GBP	18/07/2024	Westpac Banking Corp	5	239	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					96.180	0,01

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	968.562.910	98,02

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,00%) (31 de diciembre de 2023: (0,01%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases EUR con cobertura</i>						
748.718 EUR	816.109 USD	18/07/2024	Citibank NA	3	(13.058)	(0,00)
437.409 EUR	474.878 USD	18/07/2024	Standard Chartered Bank	2	(5.727)	(0,00)
738.501 EUR	796.630 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	21	(4.536)	(0,00)
273.790 USD	255.982 EUR	18/07/2024	Citibank NA	1	(768)	(0,00)
183.225 USD	171.329 EUR	18/07/2024	Standard Chartered Bank	1	(537)	(0,00)
2.225.521 USD	2.082.810 EUR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	21	(8.437)	(0,00)
<i>Clases GBP con cobertura</i>						
20.821 GBP	26.491 USD	18/07/2024	Standard Chartered Bank	4	(169)	(0,00)
24.895 GBP	31.575 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	7	(103)	(0,00)
9.150 USD	7.347 GBP	18/07/2024	Citibank NA	1	(139)	(0,00)
6.942 USD	5.579 GBP	18/07/2024	Standard Chartered Bank	1	(111)	(0,00)
14.429 USD	11.487 GBP	18/07/2024	Westpac Banking Corp	3	(92)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(33.677)	(0,00)

US Large Cap Value - Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(33.677)	(0,00)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	968.529.233	98,02
Otro activo neto	19.559.016	1,98
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	988.088.249	100,00

Análisis de la cartera	USD	% de los activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	968.466.730	97,07
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	62.503	0,01
Total inversiones	968.529.233	97,08

US Long Short Equity – Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Número de Acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 88,95% (31 de diciembre de 2023: 85,22%)			
Euro			
10.679	Airbus SE*	1.466.752	0,75
	Total euro	1.466.752	0,75
Dólar estadounidense			
8.089	AbbVie Inc*	1.387.425	0,70
2.074	Adobe Inc*	1.152.190	0,59
3.712	Advanced Micro Devices Inc*	602.124	0,31
38.327	Alphabet Inc Class A*	6.981.263	3,54
43.026	Amazon.com Inc*	8.314.774	4,22
27.634	Amphenol Corp Class A*	1.861.703	0,95
9.216	Analog Devices Inc*	2.103.644	1,07
29.192	Apple Inc*	6.148.419	3,12
6.585	Asbury Automotive Group Inc*	1.500.524	0,76
8.812	Ashland Inc*	832.646	0,42
1.660	ASML Holding NV*	1.697.732	0,86
13.503	Avantor Inc*	286.264	0,15
9.639	Avery Dennison Corp*	2.107.567	1,07
12.608	BGC Group Inc Class A*	104.646	0,05
32.374	Boston Scientific Corp*	2.493.122	1,27
1.341	Broadcom Inc*	2.153.016	1,09
37.318	Brookfield Asset Management Ltd Class A*	1.419.950	0,72
20.920	Brookfield Corp*	869.017	0,44
7.808	CDW Corp*	1.747.743	0,89
102.578	Celebration Bidco Holdings LLC**	1.538.670	0,78
84.956	CenterPoint Energy Inc*	2.631.937	1,34
21.432	Chevron Corp*	3.352.393	1,70
44.460	Chewy Inc Class A*	1.211.090	0,62
11.149	Citigroup Inc*	707.516	0,36
13.010	CME Group Inc Class A*	2.557.766	1,30
2.670	Constellation Energy Corp*	534.721	0,27
849	Costco Wholesale Corp*	721.642	0,37
25.659	Dollar Tree Inc*	2.739.611	1,39
451	Eli Lilly & Co*	408.326	0,21
9.541	Equifax Inc*	2.313.311	1,17
43.272	European Wax Center Inc Class A*	429.691	0,22
21.658	First Watch Restaurant Group Inc*	380.314	0,19
62.586	FirstEnergy Corp*	2.395.166	1,22
4.639	General Electric Co*	737.462	0,37
3.508	Home Depot Inc*	1.207.594	0,61

US Long Short Equity – Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Número de Acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 88,95% (31 de diciembre de 2023: 85,22%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
364	HubSpot Inc*	214.684	0,11
1.731	Humana Inc*	646.788	0,33
3.487	Illumina Inc*	363.973	0,18
3.568	Intuit Inc*	2.344.925	1,19
14.850	Jacobs Solutions Inc*	2.074.693	1,05
9.146	Johnson & Johnson*	1.336.779	0,68
22.772	JPMorgan Chase & Co*	4.605.865	2,34
119.708	Keurig Dr Pepper Inc*	3.998.247	2,03
1.428	Klaviyo Inc Class A*	35.543	0,02
1.900	Loar Holdings Inc*	101.479	0,05
2.619	Marriott International Inc Class A*	633.196	0,32
7.078	Mastercard Inc Class A*	3.122.530	1,59
85.246	Match Group Inc*	2.589.773	1,32
17.270	McDonald's Corp*	4.401.087	2,23
11.641	Meta Platforms Inc Class A*	5.869.625	2,98
4.200	Micron Technology Inc*	552.426	0,28
22.878	Microsoft Corp*	10.225.322	5,19
17.006	Mondelez International Inc Class A*	1.112.873	0,57
2.041	MSCI Inc Class A*	983.252	0,50
4.157	Netflix Inc*	2.805.476	1,42
52.626	NextEra Energy Inc*	3.726.447	1,89
23.353	NIKE Inc Class B*	1.760.116	0,89
7.436	Norfolk Southern Corp*	1.596.435	0,81
2.155	Novo Nordisk A/S ADR*	307.605	0,16
26.947	nVent Electric Plc*	2.064.410	1,05
37.057	NVIDIA Corp*	4.578.022	2,32
16.100	Okta Inc Class A*	1.507.121	0,77
73.103	Paramount Global Class B*	759.540	0,39
77.520	Paycor HCM Inc*	984.504	0,50
6.469	Procter & Gamble Co*	1.066.867	0,54
94.768	Repay Holdings Corp Class A*	1.000.750	0,51
6.719	S&P Global Inc*	2.996.674	1,52
18.094	Salesforce Inc*	4.651.967	2,36
2.895	ServiceNow Inc*	2.277.410	1,16
40.837	Sweetgreen Inc Class A*	1.230.827	0,63
3.081	Synopsys Inc*	1.833.380	0,93
8.405	TE Connectivity Ltd*	1.264.364	0,64
3.405	Thermo Fisher Scientific Inc*	1.882.965	0,96
34.350	TJX Cos Inc*	3.781.935	1,92

US Long Short Equity – Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Número de Acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 88,95% (31 de diciembre de 2023: 85,22%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
17.867	Uber Technologies Inc*	1.298.574	0,66
14.096	Union Pacific Corp*	3.189.361	1,62
3.432	UnitedHealth Group Inc*	1.747.780	0,89
3.150	Viking Holdings Ltd*	106.911	0,05
11.437	Visa Inc Class A*	3.001.869	1,52
33.745	Walmart Inc*	2.284.874	1,16
9.326	Waste Management Inc*	1.989.609	1,01
89.500	Waystar Holding Corp*	1.924.250	0,98
16.584	WEC Energy Group Inc*	1.301.181	0,66
8.671	Workday Inc Class A*	1.938.489	0,98
Total dólar estadounidense		173.703.752	88,20
Total valores de renta variable		175.170.504	88,95

Fondos de inversión inmobiliaria 1,53% (31 de diciembre de 2023: 1,81%)			
Dólar estadounidense			
2.104	Equinix Inc	1.591.886	0,81
7.251	SBA Communications Corp Class A	1.423.371	0,72
Total fondos de inversión inmobiliaria *		3.015.257	1,53

Importe principal	Descripción de los valores	Cupón	Fecha de vencimiento	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Bonos de empresa 0,21% (31 de diciembre de 2023: 3,92%)					
Dólar estadounidense					
1.095.119	Anagram Holdings LLC/Anagram International Inc	10,00%	15/08/2026	0	0,00
410.000	Uber Technologies Inc	8,00%	01/11/2026	414.009	0,21
Total bonos de empresa **				414.009	0,21
Préstamos a plazo^ 0,25% (sábado, 31 de diciembre de 2023: 0,25%)					
Dólar estadounidense					
487.831	Celebration Bidco LLC	15,50%	29/12/2028	487.831	0,25
Total préstamos a plazo †				487.831	0,25
Total inversiones				179.087.601	90,94

Contratos de divisas a plazo 0,14% (31 de diciembre de 2023: 1,68%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases EUR con cobertura</i>						
35.745.602 EUR	38.240.917 USD	18/07/2024	Citibank NA	1	98.706	0,05
35.745.602 EUR	38.237.679 USD	18/07/2024	UBS AG	1	101.944	0,05
2.070.187 EUR	2.219.083 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	12	1.336	0,00
701.974 USD	647.841 EUR	18/07/2024	UBS AG	1	7.120	0,00

US Long Short Equity – Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo 0,14% (31 de diciembre de 2023: 1,68%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases EUR con cobertura (cont.)</i>						
3.708.946 USD	3.421.954 EUR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	49	38.662	0,02
<i>Clases GBP con cobertura</i>						
22.248 GBP	27.824 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	302	0,00
983.897 GBP	1.229.511 USD	18/07/2024	UBS AG	2	14.353	0,01
1.276.574 GBP	1.596.677 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	6	17.197	0,01
54.464 USD	42.794 GBP	18/07/2024	Goldman Sachs International	2	363	0,00
451.766 USD	355.194 GBP	18/07/2024	Westpac Banking Corp	4	2.723	0,00
<i>Clases SGD con cobertura</i>						
730 SGD	538 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	1	0,00
264.532 SGD	195.304 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	4	39	0,00
1.871 USD	2.523 SGD	18/07/2024	UBS AG	2	8	0,00
8.579 USD	11.578 SGD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	7	29	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					282.783	0,14

Contratos de futuros 0,01% (31 de diciembre de 2023: 0,00%)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(25)	Nasdaq 100 E-mini Future September 2024	10.919	0,01
Plusvalía latente total sobre contratos de futuros [±]		10.919	0,01

Contratos por diferencias 0,25% (31 de diciembre de 2023: 0,32%)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
153.987	Agilent Technologies Inc	JPMorgan Chase Bank	2.589	0,00
70.975	Agilon Health Inc	Goldman Sachs International	1.382	0,00
56.668	Best Buy Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	115	0,00
562.591	Best Buy Co Inc	Goldman Sachs International	43.444	0,02
421.111	Cava Group Inc	JPMorgan Chase Bank	5.392	0,00
61.805	Cava Group Inc	Goldman Sachs International	791	0,00
27.603	Cava Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	353	0,00
354.749	Centene Corp	Goldman Sachs International	10.030	0,01
282.623	Conagra Brands Inc	Goldman Sachs International	2.857	0,00
175.036	Conagra Brands Inc	JPMorgan Chase Bank	1.769	0,00
291.123	Darden Restaurants Inc	JPMorgan Chase Bank	4.312	0,00
114.130	Darden Restaurants Inc	Goldman Sachs International	1.690	0,00
393.233	Davita Healthcare Partner Inc	Goldman Sachs International	7.487	0,01
255.884	Dayforce Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.192	0,00
202.037	Dominion Energy Inc	Goldman Sachs International	1.877	0,00
302.921	Estee Lauder Companies Class A	Bank of America Merrill Lynch	22.557	0,01
454.871	Exelon Corp	Goldman Sachs International	7.455	0,01

US Long Short Equity – Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias 0,25% (31 de diciembre de 2023: 0,32%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
130.296	Floor & Decor Holdings Inc Class A	Bank of America Merrill Lynch	21.160	0,01
879.060	Floor & Decor Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	142.757	0,07
94.462	Floor & Decor Holdings Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	15.340	0,01
233.346	General Mills Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.295	0,00
339.312	General Mills Inc	Goldman Sachs International	15.747	0,01
202.785	Graco Inc	JPMorgan Chase Bank	2.153	0,00
66.638	Guess? Inc	Goldman Sachs International	3.142	0,00
24.147	Guess? Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.139	0,00
274.832	Illinois Tool Works Inc	JPMorgan Chase Bank	2.298	0,00
273.880	Illinois Tool Works Inc	Goldman Sachs International	2.290	0,00
187.000	Ingersoll Rand Inc	Goldman Sachs International	4.984	0,00
440.904	Interpublic Group of Cos Inc	Goldman Sachs International	7.559	0,01
171.680	Interpublic Group of Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.943	0,00
231.477	JM Smucker Co	JPMorgan Chase Bank	6.537	0,00
229.909	JM Smucker Co	Goldman Sachs International	3.133	0,00
93.828	Kontoor Brands Inc	Goldman Sachs International	1.315	0,00
105.418	Kontoor Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.459	0,00
97.226	Levi Strauss & Co Class A	Goldman Sachs International	18.165	0,01
98.252	Lululemon Athletica Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.476	0,00
630.508	Omnicom Group Inc	Goldman Sachs International	2.690	0,00
240.245	Oxford Industries Inc	Goldman Sachs International	4.070	0,00
456.602	PayPal Holdings Inc	Goldman Sachs International	16.216	0,01
657.960	Shutterstock Inc	Goldman Sachs International	15.174	0,01
78.646	Shutterstock Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.814	0,00
327.255	Sonic Automotive Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	17.824	0,01
243.504	Sonic Automotive Inc Class A	Goldman Sachs International	13.262	0,01
95.237	Southern Co	JPMorgan Chase Bank	137	0,00
300.049	Southern Co	Goldman Sachs International	430	0,00
139.166	Super Micro Computer Inc	Goldman Sachs International	10.685	0,01
333.267	T Rowe Price Group Inc	JPMorgan Chase Bank	4.969	0,00
976.825	T Rowe Price Group Inc	Goldman Sachs International	14.563	0,01
454.889	Texas Instruments Inc	JPMorgan Chase Bank	868	0,00
637.218	Trade Desk Inc Class A	Goldman Sachs International	66	0,00
227.971	Trade Desk Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	24	0,00
283.417	Upbound Group Inc	Goldman Sachs International	10.742	0,01
143.986	Waters Corp	JPMorgan Chase Bank	2.028	0,00
1.003.065	WW Grainger Inc	Goldman Sachs International	6.294	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos por diferencias [∞]			500.040	0,25

US Long Short Equity – Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de *swap* de rentabilidad total 0,00% (31 de diciembre de 2023: 0,00%)

Importe nocional	Fecha de extinción	Tipo variable	Entidad de referencia	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
USD (1.943.893)	08/09/2025	5,86 ¹	JPMorgan Basket JPNBSX ²	3.638	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de <i>swap</i> de rentabilidad total [∞]				3.638	0,00

¹ El tipo de interés de la financiación bancaria a un día es la referencia para este contrato de *swap* de rentabilidad total.

² La contraparte en el contrato de *swap* de rentabilidad total es JPMorgan Chase Bank.

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	179.884.981	91,34

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,06%) (31 de diciembre de 2023: (0,18%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases EUR con cobertura</i>						
433.120 EUR	472.163 USD	18/07/2024	Citibank NA	1	(7.612)	(0,00)
1.114.579 EUR	1.199.530 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	2	(4.067)	(0,00)
782.332 EUR	847.283 USD	18/07/2024	UBS AG	2	(8.178)	(0,01)
8.060.713 EUR	8.719.884 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	37	(74.213)	(0,04)
2.175.563 USD	2.033.597 EUR	18/07/2024	Citibank NA	2	(5.610)	(0,00)
2.167.806 USD	2.026.523 EUR	18/07/2024	UBS AG	1	(5.780)	(0,00)
2.521.874 USD	2.359.961 EUR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	16	(9.347)	(0,01)
<i>Clases GBP con cobertura</i>						
12.518 GBP	16.084 USD	18/07/2024	UBS AG	1	(258)	(0,00)
396.070 GBP	503.615 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	12	(2.894)	(0,00)
32.485 USD	26.106 GBP	18/07/2024	Goldman Sachs International	2	(519)	(0,00)
29.248 USD	23.415 GBP	18/07/2024	Westpac Banking Corp	2	(354)	(0,00)
<i>Clases SGD con cobertura</i>						
863 SGD	641 USD	18/07/2024	UBS AG	1	(4)	(0,00)
18.567 SGD	13.810 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	11	(98)	(0,00)
666 USD	904 SGD	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	(1)	(0,00)
96.578 USD	130.825 SGD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	8	(30)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(118.965)	(0,06)

Contratos de futuros (0,08%) (31 de diciembre de 2023: (0,51%))

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(165)	S&P 500 E-mini Future September 2024	(154.275)	(0,08)
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros [±]		(154.275)	(0,08)

US Long Short Equity – Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de opciones suscritos (0,00%) (31 de diciembre de 2023: (0,01%))

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de compra				
(100)	19/07/2024	Chewy Inc, Strike Price \$45.00	(4.650)	(0,00)
Total valor razonable en contratos de opciones suscritos* (Prima: 14.455 USD)			(4.650)	(0,00)

Contratos por diferencias (0,27%) (31 de diciembre de 2023: (1,40%))

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
254.068	Arm Holdings Plc	JPMorgan Chase Bank	(5.311)	(0,00)
68.176	Arm Holdings Plc	Goldman Sachs International	(1.425)	(0,00)
122.972	Arm Holdings Plc ADR	Bank of America Merrill Lynch	(2.571)	(0,00)
222.993	Asana Inc Class A	Goldman Sachs International	(36.118)	(0,02)
513.659	Campbell Soup Co	Goldman Sachs International	(3.275)	(0,00)
96.758	CarMax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.190)	(0,00)
887.032	CarMax Inc	Goldman Sachs International	(19.678)	(0,01)
566.256	Credit Acceptance Corp	Goldman Sachs International	(37.318)	(0,02)
300.625	Dollar General Corp	Goldman Sachs International	(12.752)	(0,01)
257.319	Dollar General Corp	JPMorgan Chase Bank	(10.915)	(0,01)
688.415	Everest Group Ltd	Goldman Sachs International	(5.881)	(0,00)
23.501	Exlservice Holdings Inc	Goldman Sachs International	(1.728)	(0,00)
232.066	Exlservice Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17.069)	(0,01)
219.088	Genpact Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7.632)	(0,00)
19.320	Genpact Ltd	Goldman Sachs International	(673)	(0,00)
321.161	International Business Machines Corp	Goldman Sachs International	(6.576)	(0,00)
454.415	Iron Mountain Inc	JPMorgan Chase Bank	(7.029)	(0,00)
124.447	Iron Mountain Inc	Goldman Sachs International	(1.925)	(0,00)
339.219	ITT Inc	Goldman Sachs International	(1.997)	(0,00)
147.501	JM Smucker Co	Bank of America Merrill Lynch	(730)	(0,00)
662.984	Lamar Advertising Co Class A	JPMorgan Chase Bank	(30.298)	(0,02)
119.698	Lamar Advertising Co Class A	Goldman Sachs International	(5.470)	(0,00)
90.368	Lemonade Inc	Goldman Sachs International	(10.475)	(0,01)
268.579	Marketaxess Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.584)	(0,00)
271.555	Marketaxess Holdings Inc	Goldman Sachs International	(1.602)	(0,00)
190.822	Moelis & Co Class A	Bank of America Merrill Lynch	(13.793)	(0,01)
587.633	Moelis & Co Class A	Goldman Sachs International	(50.735)	(0,03)
774.765	Palantir Technologies Inc Class A	Goldman Sachs International	(9.999)	(0,01)
243.767	Paycom Software Inc	Goldman Sachs International	(258)	(0,00)
80.528	Procore Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.114)	(0,00)
845.625	Procore Technologies Inc	Goldman Sachs International	(40.110)	(0,02)
196.431	Restaurant Brands International Inc	Goldman Sachs International	(3.077)	(0,00)
245.648	Sally Beauty Holdings Inc	Goldman Sachs International	(8.354)	(0,00)

US Long Short Equity – Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos por diferencias (0,27%) (31 de diciembre de 2023: (1,40%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
571.680	Samsara Inc Class A	Goldman Sachs International	(113.583)	(0,06)
157.875	Sprouts Farmers Market Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12.157)	(0,01)
178.521	Sprouts Farmers Market Inc	Goldman Sachs International	(13.747)	(0,01)
181.402	Target Corp	Goldman Sachs International	(3.868)	(0,00)
417.253	Tesla Inc	Bank of America Merrill Lynch	(23.365)	(0,01)
559	Tesla Inc	Goldman Sachs International	(31)	(0,00)
85.871	Wendy's Co	Goldman Sachs International	(1.925)	(0,00)
99.797	Wendy's Co	Bank of America Merrill Lynch	(1.118)	(0,00)
196.685	World Acceptance Corp	JPMorgan Chase Bank	(3.611)	(0,00)
Minusvalía total sobre contratos por diferencias [∞]			(535.067)	(0,27)

Contratos de *swap* de rentabilidad total (0,90%) (31 de diciembre de 2023: (2,37%))

Importe nominal	Fecha de extinción	Tipo variable	Entidad de referencia	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
USD (111.720)	19/11/2024	4,57 ¹	S&P Retail Select Industry Index ²	(23.419)	(0,01)
USD (274.838)	19/11/2024	4,57 ¹	S&P Retail Select Industry Index ²	(35.186)	(0,02)
USD (1.089.980)	19/11/2024	4,57 ¹	S&P Retail Select Industry Index ²	(142.167)	(0,07)
USD (1.554.290)	02/05/2025	5,67 ¹	S&P 500 Equal Weight Total Return Index ²	(273.758)	(0,14)
USD (3.796.688)	19/07/2024	5,35 ¹	JPMorgan Basket JPNBLQGS ²	(1.284.785)	(0,66)
Minusvalía latente total sobre contratos de <i>swap</i> de rentabilidad total [∞]				(1.759.315)	(0,90)

¹ El tipo de interés de la financiación bancaria a un día es la referencia para este contrato de *swap* de rentabilidad total.

² La contraparte en el contrato de *swap* de rentabilidad total es JPMorgan Chase Bank.

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(2.572.272)	(1,31)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	177.312.709	90,03
Otro activo neto	19.625.191	9,97
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	196.937.900	100,00

Análisis de la cartera	USD	% de los activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	176.647.091	88,18
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	1.952.679	0,98
† Otros valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario	487.831	0,24
± Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	(148.006)	(0,07)
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC y compensados de forma centralizada	(1.626.886)	(0,81)
Total inversiones	177.312.709	88,52

US Multi Cap Opportunities - Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Número de acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 99,95% (31 de diciembre de 2023: 99,12%)			
Dólar estadounidense			
102.000	Alphabet Inc Class C	18.708.840	5,46
67.000	Amazon.com Inc	12.947.750	3,78
92.800	Apollo Global Management Inc	10.956.896	3,20
71.000	Apple Inc	14.954.020	4,36
319.000	Aramark	10.852.380	3,17
32.800	Avery Dennison Corp	7.171.720	2,09
78.000	Ball Corp	4.681.560	1,37
32.200	Becton Dickinson & Co	7.525.462	2,20
44.000	Berkshire Hathaway Inc Class B	17.899.200	5,22
52.000	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	4.567.680	1,33
975	Booking Holdings Inc	3.862.463	1,13
304.000	Brookfield Corp	12.628.160	3,69
18.000	Charles River Laboratories International Inc	3.718.440	1,09
28.000	Chubb Ltd	7.142.240	2,08
277.000	CSX Corp	9.265.650	2,70
6.000	Deere & Co	2.241.780	0,65
36.100	Eagle Materials Inc	7.850.306	2,29
68.200	EOG Resources Inc	8.584.334	2,50
440.000	Graphic Packaging Holding Co	11.532.400	3,37
37.000	HCA Healthcare Inc	11.887.360	3,47
57.000	Intercontinental Exchange Inc	7.802.730	2,28
49.000	JPMorgan Chase & Co	9.910.740	2,89
17.300	Lowe's Cos Inc	3.813.958	1,11
26.000	McDonald's Corp	6.625.840	1,93
45.500	Microsoft Corp	20.336.225	5,93
95.800	Mondelez International Inc Class A	6.269.152	1,83
31.000	Motorola Solutions Inc	11.967.550	3,49
80.000	Nasdaq Inc	4.820.800	1,41
60.000	NextEra Energy Inc	4.248.600	1,24
26.400	Nordson Corp	6.123.216	1,79
54.000	Oracle Corp	7.624.800	2,22
39.100	QUALCOMM Inc	7.787.938	2,27
17.400	Rockwell Automation Inc	4.789.872	1,40
45.000	TJX Cos Inc	4.954.500	1,45
56.000	T-Mobile US Inc	9.866.080	2,88
79.900	TransUnion	5.925.384	1,73
192.000	US Foods Holding Corp	10.172.160	2,97
54.600	Veralto Corp	5.212.662	1,52
26.000	Verisk Analytics Inc Class A	7.008.300	2,05

US Multi Cap Opportunities – Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Número de Acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 99,95% (31 de diciembre de 2023: 99,12%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
5.600	WD-40 Co	1.229.984	0,36
44.500	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	7.033.225	2,05
Total valores de renta variable *		342.502.357	99,95
Total inversiones		342.502.357	99,95

Contratos de divisas a plazo 0,15% (31 de diciembre de 2023: 0,46%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases AUD con cobertura</i>						
285.609 AUD	188.451 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	8	2.375	0,00
26.050 AUD	17.300 USD	18/07/2024	UBS AG	1	105	0,00
6.831.421 AUD	4.443.093 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	48	121.201	0,04
282.754 USD	422.796 AUD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	7	271	0,00
<i>Clases EUR con cobertura</i>						
7.651.879 EUR	8.185.479 USD	18/07/2024	UBS AG	4	21.688	0,01
18.841 EUR	20.189 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	7	19	0,00
42.034 USD	38.624 EUR	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	607	0,00
248.781 USD	228.686 EUR	18/07/2024	UBS AG	3	3.499	0,00
754.612 USD	698.592 EUR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	25	5.324	0,00
<i>Clases GBP con cobertura</i>						
106 GBP	134 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
<i>Clases SGD con cobertura</i>						
711.882 SGD	524.799 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	2	890	0,00
36.942.625 SGD	27.274.100 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	23	6.177	0,00
324.086 USD	434.973 SGD	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	2.880	0,00
1.123.943 USD	1.513.534 SGD	18/07/2024	UBS AG	5	6.275	0,00
1.226.463 USD	1.652.695 SGD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	37	6.028	0,00
<i>Clases ZAR con cobertura</i>						
50.572 USD	918.150 ZAR	18/07/2024	UBS AG	1	351	0,00
2.221.166 USD	40.234.620 ZAR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	9	20.411	0,01
119.124.531 ZAR	6.236.652 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	11	279.228	0,08
2.433.156 ZAR	130.880 USD	18/07/2024	UBS AG	1	2.209	0,00
55.842.435 ZAR	3.003.099 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	54	51.376	0,01
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					530.914	0,15

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	343.033.271	100,10

US Multi Cap Opportunities – Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,04%) (31 de diciembre de 2023: (0,08%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases AUD con cobertura</i>						
45.349 AUD	30.344 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	4	(45)	(0,00)
51.098 USD	76.970 AUD	18/07/2024	Goldman Sachs International	4	(327)	(0,00)
29.593 USD	44.500 AUD	18/07/2024	UBS AG	2	(139)	(0,00)
2.315.606 USD	3.552.219 AUD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	40	(57.749)	(0,02)
<i>Clases EUR con cobertura</i>						
367.503 EUR	396.876 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	4	(2.703)	(0,00)
350.184 EUR	377.179 USD	18/07/2024	UBS AG	5	(1.584)	(0,00)
344.559 EUR	375.453 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	11	(5.890)	(0,00)
91.367 USD	85.617 EUR	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	(463)	(0,00)
108.711 USD	101.550 EUR	18/07/2024	UBS AG	2	(208)	(0,00)
391.584 USD	366.122 EUR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	11	(1.106)	(0,00)
<i>Clases GBP con cobertura</i>						
23.562 GBP	29.891 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	1	(104)	(0,00)
<i>Clases SGD con cobertura</i>						
1.599.797 SGD	1.191.152 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	4	(9.782)	(0,00)
4.236.937 SGD	3.144.698 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	54	(15.932)	(0,01)
1.977.173 USD	2.683.541 SGD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	14	(4.487)	(0,00)
<i>Clases ZAR con cobertura</i>						
319.487 USD	6.039.497 ZAR	18/07/2024	Goldman Sachs International	6	(10.862)	(0,00)
206.705 USD	3.879.420 ZAR	18/07/2024	UBS AG	3	(5.492)	(0,00)
1.296.227 USD	24.150.094 ZAR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	44	(24.738)	(0,01)
2.731.833 ZAR	150.111 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	2	(686)	(0,00)
276.586 ZAR	15.255 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	8	(127)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(142.424)	(0,04)

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(142.424)	(0,04)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	342.890.847	100,06
Otro pasivo neto	(215.355)	(0,06)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	342.675.492	100,00

Análisis de la cartera	USD	% de los activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	342.502.357	99,45
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	388.490	0,11
Total inversiones	342.890.847	99,56

US Real Estate Securities - Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Número de acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 1,14% (31 de diciembre de 2023: 0,00%)			
Dólar estadounidense			
116.460	Brookfield Corp	4.837.748	1,14
Total valores de renta variable *		4.837.748	1,14
Fondos de inversión inmobiliaria 97,58% (31 de diciembre de 2023: 97,54%)			
Dólar estadounidense			
290.652	American Healthcare REIT Inc	4.246.426	1,00
191.259	American Tower Corp	37.176.924	8,76
126.830	AvalonBay Communities Inc	26.239.859	6,18
134.861	Camden Property Trust	14.714.684	3,47
105.420	Crown Castle Inc	10.299.534	2,43
60.617	Digital Realty Trust Inc	9.216.815	2,17
44.371	Equinix Inc	33.571.099	7,91
118.930	Equity LifeStyle Properties Inc	7.745.911	1,82
173.311	Essential Properties Realty Trust Inc	4.802.448	1,13
77.919	Extra Space Storage Inc	12.109.392	2,85
62.253	Federal Realty Investment Trust	6.285.685	1,48
132.826	Gaming & Leisure Properties Inc	6.005.063	1,41
1.419.986	Hudson Pacific Properties Inc	6.830.133	1,61
201.679	Invitation Homes Inc	7.238.259	1,70
193.065	Iron Mountain Inc	17.302.485	4,08
377.229	Kimco Realty Corp	7.340.876	1,73
401.199	Macerich Co	6.194.513	1,46
225.423	Omega Healthcare Investors Inc	7.720.738	1,82
272.927	Prologis Inc	30.652.431	7,22
91.511	Public Storage	26.323.139	6,20
249.252	Realty Income Corp	13.165.491	3,10
337.034	Retail Opportunity Investments Corp	4.189.333	0,99
137.629	Rexford Industrial Realty Inc	6.136.877	1,45
67.531	SBA Communications Corp Class A	13.256.335	3,12
130.074	Simon Property Group Inc	19.745.233	4,65
126.812	Sun Communities Inc	15.260.556	3,59
264.232	UDR Inc	10.873.147	2,56
343.993	Ventas Inc	17.633.081	4,15
147.164	VICI Properties Inc Class A	4.214.777	0,99
182.627	Welltower Inc	19.038.865	4,48
309.272	Weyerhaeuser Co	8.780.232	2,07
Total fondos de inversión inmobiliaria *		414.310.341	97,58
Total inversiones		419.148.089	98,72

US Real Estate Securities – Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo 0,29% (31 de diciembre de 2023: 0,44%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases AUD con cobertura</i>						
1.929.283 AUD	1.274.794 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	9	14.223	0,01
192.563 AUD	127.973 USD	18/07/2024	UBS AG	2	684	0,00
19.590.773 AUD	12.748.087 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	50	341.143	0,08
111.927 USD	167.287 AUD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	3	157	0,00
<i>Clases CHF con cobertura</i>						
1.443.813 CHF	1.598.060 USD	18/07/2024	UBS AG	8	11.838	0,00
64.276 CHF	71.462 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	8	207	0,00
41.409 USD	37.025 CHF	18/07/2024	Goldman Sachs International	2	125	0,00
11.688 USD	10.435 CHF	18/07/2024	UBS AG	1	52	0,00
107.021 USD	95.687 CHF	18/07/2024	Westpac Banking Corp	2	326	0,00
<i>Clases EUR con cobertura</i>						
13.125.288 EUR	14.040.681 USD	18/07/2024	UBS AG	4	37.096	0,01
158.284 EUR	169.449 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	13	323	0,00
76.228 USD	70.414 EUR	18/07/2024	Goldman Sachs International	2	703	0,00
471.914 USD	433.620 EUR	18/07/2024	UBS AG	5	6.826	0,00
1.009.200 USD	935.125 EUR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	37	6.214	0,00
<i>Clases HKD con cobertura</i>						
17.726.966 HKD	2.270.579 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	2	1.106	0,00
19.152.766 HKD	2.453.120 USD	18/07/2024	UBS AG	7	1.280	0,00
2.902.822 HKD	371.748 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	23	246	0,00
29.793 USD	232.355 HKD	18/07/2024	UBS AG	1	17	0,00
125.420 USD	977.748 HKD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	16	123	0,00
<i>Clases SGD con cobertura</i>						
7.992 SGD	5.892 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	2	10	0,00
603.143 SGD	445.258 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	22	135	0,00
6.640 USD	8.943 SGD	18/07/2024	Goldman Sachs International	2	36	0,00
20.528 USD	27.639 SGD	18/07/2024	UBS AG	4	118	0,00
48.234 USD	64.883 SGD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	15	320	0,00
<i>Clases ZAR con cobertura</i>						
234.655 USD	4.277.507 ZAR	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	684	0,00
119.304 USD	2.165.989 ZAR	18/07/2024	UBS AG	1	829	0,00
167.253 USD	3.034.550 ZAR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	12	1.269	0,00
309.790.295 ZAR	16.229.523 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	16	715.403	0,17
10.845.518 ZAR	583.384 USD	18/07/2024	UBS AG	1	9.845	0,00
43.738.807 ZAR	2.319.813 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	37	72.613	0,02
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					1.223.951	0,29

US Real Estate Securities – Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	420.372.040	99,01

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,04%) (31 de diciembre de 2023: (0,08%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patri- monio neto
<i>Clases AUD con cobertura</i>						
387.110 AUD	258.877 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	2	(236)	(0,00)
145.403 AUD	97.391 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	7	(243)	(0,00)
984.080 USD	1.489.745 AUD	18/07/2024	Goldman Sachs International	7	(11.267)	(0,00)
265.197 USD	401.157 AUD	18/07/2024	UBS AG	3	(2.829)	(0,00)
2.196.026 USD	3.345.709 AUD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	55	(39.349)	(0,01)
<i>Clases CHF con cobertura</i>						
58.599 CHF	65.642 USD	18/07/2024	UBS AG	5	(302)	(0,00)
40.423 CHF	45.327 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	3	(254)	(0,00)
31.244 USD	28.216 CHF	18/07/2024	Goldman Sachs International	3	(218)	(0,00)
132.752 USD	120.176 CHF	18/07/2024	UBS AG	6	(1.247)	(0,00)
139.020 USD	125.596 CHF	18/07/2024	Westpac Banking Corp	11	(1.024)	(0,00)
<i>Clases EUR con cobertura</i>						
335.944 EUR	361.974 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	5	(1.650)	(0,00)
371.955 EUR	402.155 USD	18/07/2024	UBS AG	4	(3.208)	(0,00)
572.793 EUR	622.584 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	29	(8.225)	(0,00)
151.614 USD	141.755 EUR	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	(428)	(0,00)
2.822.680 USD	2.638.900 EUR	18/07/2024	UBS AG	4	(7.723)	(0,00)
6.595.942 USD	6.153.290 EUR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	12	(3.884)	(0,00)
<i>Clases HKD con cobertura</i>						
1.551.619 HKD	198.947 USD	18/07/2024	UBS AG	3	(108)	(0,00)
1.533.597 HKD	196.744 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	11	(216)	(0,00)
40.074 USD	312.925 HKD	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	(27)	(0,00)
255.710 USD	1.996.006 HKD	18/07/2024	UBS AG	4	(76)	(0,00)
821.617 USD	6.416.558 HKD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	20	(655)	(0,00)
<i>Clases SGD con cobertura</i>						
14.517 SGD	10.803 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	2	(83)	(0,00)
14.482 SGD	10.743 USD	18/07/2024	UBS AG	2	(49)	(0,00)
96.165 SGD	71.405 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	34	(393)	(0,00)
3.850 USD	5.224 SGD	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	(7)	(0,00)
6.186 USD	8.398 SGD	18/07/2024	UBS AG	1	(15)	(0,00)
25.788 USD	35.013 SGD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	6	(68)	(0,00)
<i>Clases ZAR con cobertura</i>						
1.038.871 USD	19.597.022 ZAR	18/07/2024	Goldman Sachs International	9	(33.048)	(0,01)
788.696 USD	14.828.335 ZAR	18/07/2024	UBS AG	3	(22.385)	(0,01)

US Real Estate Securities – Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo (0,04%) (31 de diciembre de 2023: (0,08%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases ZAR con cobertura (cont.)</i>						
1.916.667 USD	36.039.150 ZAR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	56	(54.603)	(0,01)
8.779.092 ZAR	481.151 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	3	(952)	(0,00)
123.186 ZAR	6.763 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	6	(25)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(194.797)	(0,04)

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(194.797)	(0,04)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	420.177.243	98,97
Otro activo neto	4.380.861	1,03
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	424.558.104	100,00

Análisis de la cartera	USD	% de los activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	419.148.089	97,38
[∞] Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	1.029.154	0,24
Total inversiones	420.177.243	97,62

US Small Cap – Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Número de acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 98,31% (31 de diciembre de 2023: 98,17%)			
Dólar estadounidense			
34.577	Advanced Energy Industries Inc*	3.760.594	0,62
3.335	American States Water Co*	242.021	0,04
72.254	AMERISAFE Inc*	3.171.228	0,52
66.247	Amphastar Pharmaceuticals Inc*	2.649.880	0,44
42.799	AptarGroup Inc*	6.026.527	1,00
70.028	Arcosa Inc*	5.841.035	0,97
15.787	Armstrong World Industries Inc*	1.787.720	0,30
43.106	Asbury Automotive Group Inc*	9.822.564	1,62
32.501	Aspen Technology Inc*	6.455.674	1,07
1.621	Atrion Corp*	733.389	0,12
48.990	Bank of Hawaii Corp*	2.802.718	0,46
125.018	Bio-Techne Corp*	8.957.540	1,48
40.954	Bright Horizons Family Solutions Inc*	4.508.216	0,75
6.053	Cable One Inc*	2.142.762	0,35
68.702	Cactus Inc Class A*	3.623.343	0,60
28.214	Casella Waste Systems Inc Class A*	2.799.393	0,46
42.118	CBIZ Inc*	3.120.944	0,52
19.036	Chemed Corp*	10.328.553	1,71
25.064	Church & Dwight Co Inc*	2.598.635	0,43
216.900	CNX Resources Corp*	5.270.670	0,87
12.941	Colliers International Group Inc*	1.444.863	0,24
111.717	Community Financial System Inc*	5.274.160	0,87
59.028	CommVault Systems Inc*	7.176.034	1,19
164.779	Computer Modelling Group Ltd**	1.580.231	0,26
11.251	CorVel Corp*	2.860.792	0,47
27.029	CRA International Inc*	4.654.934	0,77
28.184	Crane Co*	4.086.116	0,68
37.336	CSW Industrials Inc*	9.905.614	1,64
53.808	Cullen/Frost Bankers Inc*	5.468.507	0,90
48.229	Eagle Materials Inc*	10.487.878	1,73
209.472	Element Solutions Inc*	5.680.881	0,94
71.930	Enerpac Tool Group Corp Class A*	2.746.287	0,45
15.113	Enpro Inc*	2.199.999	0,36
70.978	ESAB Corp*	6.702.453	1,11
37.755	ESCO Technologies Inc*	3.965.785	0,66
93.603	Exponent Inc*	8.903.517	1,47
9.759	Fair Isaac Corp*	14.527.833	2,40
37.335	Federal Signal Corp*	3.123.819	0,52
125.284	First Financial Bankshares Inc*	3.699.637	0,61

US Small Cap – Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Número de Acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 98,31% (31 de diciembre de 2023: 98,17%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
59.116	FirstService Corp*	9.007.505	1,49
54.954	Floor & Decor Holdings Inc Class A*	5.462.977	0,90
64.295	Fox Factory Holding Corp*	3.098.376	0,51
25.915	FTI Consulting Inc*	5.585.460	0,92
113.464	Glacier Bancorp Inc*	4.234.476	0,70
65.804	Graco Inc*	5.216.941	0,86
79.008	Grocery Outlet Holding Corp*	1.747.657	0,29
124.456	Haemonetics Corp*	10.296.245	1,70
165.461	Hagerty Inc Class A*	1.720.794	0,28
25.416	Hamilton Lane Inc Class A*	3.140.909	0,52
282.963	Hayward Holdings Inc*	3.480.445	0,58
331.969	Hillman Solutions Corp*	2.937.926	0,49
37.212	Houlihan Lokey Inc Class A*	5.018.410	0,83
18.976	ICON Plc*	5.948.407	0,98
16.367	IDACORP Inc*	1.524.586	0,25
17.894	Installed Building Products Inc*	3.680.438	0,61
22.882	Jack Henry & Associates Inc*	3.798.870	0,63
33.837	Kadant Inc*	9.940.634	1,64
117.955	Kirby Corp*	14.122.752	2,34
42.750	Lakeland Financial Corp*	2.629.980	0,44
163.480	Lattice Semiconductor Corp*	9.480.205	1,57
15.468	LCI Industries*	1.599.082	0,26
32.944	Lindsay Corp*	4.048.159	0,67
39.200	Littelfuse Inc*	10.019.128	1,66
55.498	Manhattan Associates Inc*	13.690.247	2,26
63.183	Matador Resources Co*	3.765.707	0,62
36.338	MKS Instruments Inc*	4.745.016	0,78
52.979	Nexstar Media Group Inc Class A*	8.795.044	1,45
20.597	Nordson Corp*	4.777.268	0,79
33.674	Novanta Inc*	5.492.566	0,91
186.193	Oceaneering International Inc*	4.405.326	0,73
21.635	Omega Flex Inc*	1.109.443	0,18
24.311	Pool Corp*	7.471.500	1,24
129.759	Power Integrations Inc*	9.107.784	1,51
75.022	Prosperity Bancshares Inc*	4.586.845	0,76
8.408	Quaker Chemical Corp*	1.426.838	0,24
67.627	Qualys Inc*	9.643.610	1,60
41.370	RBC Bearings Inc*	11.160.799	1,85
97.563	Richelieu Hardware Ltd**	2.936.836	0,49

US Small Cap – Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Número de Acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 98,31% (31 de diciembre de 2023: 98,17%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
41.020	RLI Corp*	5.771.104	0,95
28.529	Rogers Corp*	3.440.883	0,57
100.961	Rollins Inc*	4.925.887	0,81
50.919	Shift4 Payments Inc Class A*	3.734.909	0,62
45.990	Simply Good Foods Co*	1.661.619	0,28
8.849	Simpson Manufacturing Co Inc*	1.491.322	0,25
56.750	Simulations Plus Inc*	2.759.185	0,46
22.426	SiteOne Landscape Supply Inc*	2.722.741	0,45
233.132	Sitio Royalties Corp Class A*	5.504.247	0,91
61.362	SPS Commerce Inc*	11.545.874	1,91
63.473	SPX Technologies Inc*	9.022.052	1,49
34.049	Standex International Corp*	5.486.996	0,91
165.575	Stevanato Group SpA*	3.036.645	0,50
48.119	Stewart Information Services Corp*	2.987.228	0,49
55.377	Stock Yards Bancorp Inc*	2.750.576	0,46
55.696	TechTarget Inc*	1.736.044	0,29
53.510	Tetra Tech Inc*	10.941.725	1,81
2.953	Texas Pacific Land Corp*	2.168.299	0,36
57.537	Texas Roadhouse Inc Class A*	9.879.678	1,63
88.233	Tidewater Inc*	8.400.664	1,39
76.359	Toro Co*	7.140.330	1,18
19.124	Tractor Supply Co*	5.163.480	0,85
42.374	Transcat Inc*	5.071.320	0,84
485.872	Transocean Ltd*	2.599.415	0,43
13.455	Tyler Technologies Inc*	6.764.905	1,12
27.109	UFP Technologies Inc*	7.153.252	1,18
143.860	United Community Banks Inc*	3.662.676	0,61
152.076	Utz Brands Inc*	2.530.545	0,42
37.295	Valmont Industries Inc*	10.235.613	1,69
35.178	Valvoline Inc*	1.519.690	0,25
138.535	Vertex Inc Class A*	4.994.187	0,83
67.930	Viper Energy Inc Class A*	2.549.413	0,42
16.469	Watsco Inc*	7.629.100	1,26
20.978	WD-40 Co*	4.607.608	0,76
14.109	West Pharmaceutical Services Inc*	4.647.363	0,77
650	White Mountains Insurance Group Ltd*	1.181.342	0,20
14.159	Winmark Corp*	4.992.888	0,83
Total valores de renta variable		594.398.742	98,31
Total inversiones		594.398.742	98,31

US Small Cap – Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo 0,04% (31 de diciembre de 2023: 0,12%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases AUD con cobertura</i>						
515.997 AUD	341.182 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	10	3.573	0,01
118.311 AUD	78.570 USD	18/07/2024	UBS AG	1	477	0,00
6.659.887 AUD	4.342.862 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	48	106.826	0,02
33.696 USD	50.297 AUD	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	91	0,00
24.079 USD	35.942 AUD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	5	65	0,00
<i>Clases EUR con cobertura</i>						
5.105.488 EUR	5.461.564 USD	18/07/2024	UBS AG	3	14.424	0,01
45.776 EUR	49.016 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	12	82	0,00
34.205 USD	31.749 EUR	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	152	0,00
327.063 USD	300.702 EUR	18/07/2024	UBS AG	6	4.540	0,00
1.016.983 USD	940.707 EUR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	24	8.010	0,00
<i>Clases ZAR con cobertura</i>						
34.144 USD	621.353 ZAR	18/07/2024	Goldman Sachs International	3	158	0,00
66.570 USD	1.214.938 ZAR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	4	115	0,00
27.656.842 ZAR	1.448.402 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	13	64.372	0,01
641.162 ZAR	34.488 USD	18/07/2024	UBS AG	1	582	0,00
5.964.524 ZAR	320.061 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	45	6.184	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					209.651	0,04

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	594.608.393	98,35

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,01%) (31 de diciembre de 2023: (0,02%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases AUD con cobertura</i>						
35.648 AUD	23.826 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	(8)	(0,00)
127.195 AUD	85.118 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	6	(134)	(0,00)
258.717 USD	390.744 AUD	18/07/2024	Goldman Sachs International	8	(2.351)	(0,00)
195.415 USD	294.376 AUD	18/07/2024	UBS AG	5	(1.268)	(0,00)
946.226 USD	1.442.526 AUD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	36	(17.572)	(0,01)
<i>Clases EUR con cobertura</i>						
361.028 EUR	389.743 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	6	(2.516)	(0,00)
170.856 EUR	184.181 USD	18/07/2024	UBS AG	4	(927)	(0,00)
304.842 EUR	331.201 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	21	(4.234)	(0,00)
54.997 USD	51.536 EUR	18/07/2024	Goldman Sachs International	1	(278)	(0,00)
502.739 USD	469.887 EUR	18/07/2024	UBS AG	5	(1.247)	(0,00)
370.697 USD	346.863 EUR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	11	(1.338)	(0,00)

US Small Cap – Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Contratos de divisas a plazo (0,01%) (31 de diciembre de 2023: (0,02%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases ZAR con cobertura</i>						
131.277 USD	2.469.982 ZAR	18/07/2024	Goldman Sachs International	11	(3.826)	(0,00)
64.554 USD	1.212.683 ZAR	18/07/2024	UBS AG	3	(1.778)	(0,00)
360.210 USD	6.716.205 ZAR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	33	(7.157)	(0,00)
515.526 ZAR	28.357 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	3	(159)	(0,00)
161.627 ZAR	8.903 USD	18/07/2024	UBS AG	1	(62)	(0,00)
226.469 ZAR	12.420 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	8	(32)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(44.887)	(0,01)

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(44.887)	(0,01)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	594.563.506	98,34
Otro activo neto	10.032.988	1,66
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	604.596.494	100,00

Análisis de la cartera	USD	% de los activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	589.881.675	97,28
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	4.517.067	0,74
[∞] Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	164.764	0,03
Total inversiones	594.563.506	98,05

US Small Cap Intrinsic Value - Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Número de acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 94,81% (31 de diciembre de 2023: 93,24%)			
Dólar estadounidense			
86.330	Acadia Healthcare Co Inc	5.830.728	1,75
389.031	Accuray Inc	708.037	0,21
254.134	Adeia Inc	2.842.489	0,85
88.050	AerCap Holdings NV	8.206.260	2,46
261.104	Alight Inc Class A	1.926.947	0,57
58.192	ALLETE Inc	3.628.271	1,09
260.388	Amneal Pharmaceuticals Inc	1.653.464	0,49
52.970	Arcosa Inc	4.418.228	1,32
35.106	Atmos Energy Corp	4.095.115	1,23
75.165	AtriCure Inc	1.711.507	0,51
82.189	Avanos Medical Inc	1.637.205	0,49
37.557	Avery Dennison Corp	8.211.838	2,46
492.501	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	714.127	0,21
226.868	Banc of California Inc	2.899.373	0,87
141.189	Bloom Energy Corp Class A	1.728.153	0,52
73.269	Box Inc Class A	1.937.232	0,58
32.029	Bread Financial Holdings Inc	1.427.212	0,43
71.033	Caleres Inc	2.386.709	0,71
47.458	Cannae Holdings Inc	860.888	0,26
56.166	CEVA Inc	1.083.442	0,32
14.903	Charles River Laboratories International Inc	3.078.662	0,92
167.941	Ciena Corp	8.091.397	2,42
14.153	Clean Harbors Inc	3.200.701	0,96
312.673	Cleveland-Cliffs Inc	4.812.038	1,44
139.881	CNX Resources Corp	3.399.108	1,02
438.568	Cognyte Software Ltd	3.350.660	1,00
38.680	Coherent Corp	2.802.753	0,84
1.083.447	Conduent Inc	3.532.037	1,06
295.578	Criteo SA ADR	11.149.202	3,34
95.537	CytoSorbents Corp	67.162	0,02
122.619	Devon Energy Corp	5.812.141	1,74
59.105	Dril-Quip Inc	1.099.353	0,33
375.663	Enviri Corp	3.241.972	0,97
42.548	Haemonetics Corp	3.519.996	1,05
199.203	Hain Celestial Group Inc	1.376.493	0,41
27.867	Helios Technologies Inc	1.330.649	0,40
346.852	Huntington Bancshares Inc	4.571.509	1,37
218.492	indie Semiconductor Inc Class A	1.348.096	0,40
213.569	Infinera Corp	1.300.635	0,39

US Small Cap Intrinsic Value – Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Número de Acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 94,81% (31 de diciembre de 2023: 93,24%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
345.599	Innoviz Technologies Ltd	320.543	0,10
72.041	Integra LifeSciences Holdings Corp	2.099.275	0,63
407.371	International Game Technology Plc	8.334.811	2,50
11.018	ION Geophysical Corp	0	0,00
19.040	IPG Photonics Corp	1.606.786	0,48
29.057	Itron Inc	2.875.481	0,86
162.694	KBR Inc	10.435.193	3,12
389.622	Kyndryl Holdings Inc	10.250.955	3,07
509.648	Lions Gate Entertainment Corp Class B	4.367.683	1,31
70.471	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	7.855.402	2,35
297.010	Markforged Holding Corp	121.774	0,04
86.226	Mercury Systems Inc	2.327.240	0,70
13.054	Molina Healthcare Inc	3.880.954	1,16
96.858	New Jersey Resources Corp	4.139.711	1,24
83.078	nLight Inc	908.042	0,27
81.984	Northwestern Energy Group Inc	4.105.759	1,23
72.587	ODP Corp	2.850.492	0,86
121.952	OneSpan Inc	1.563.425	0,47
245.695	OPENLANE Inc	4.076.080	1,22
313.058	OraSure Technologies Inc	1.333.627	0,40
120.078	Ormat Technologies Inc	8.609.593	2,58
24.123	OSI Systems Inc	3.317.395	0,99
108.733	Patterson Cos Inc	2.622.640	0,78
146.158	Patterson-UTI Energy Inc	1.514.197	0,45
97.504	Portland General Electric Co	4.216.073	1,26
700.683	Quantum Corp	286.650	0,09
85.789	Radware Ltd	1.564.791	0,47
100.284	Rambus Inc	5.892.688	1,76
292.191	Resideo Technologies Inc	5.715.256	1,71
1.054.222	Ribbon Communications Inc	3.468.390	1,04
100.034	Semtech Corp	2.989.016	0,90
331.203	Standard BioTools Inc	586.229	0,18
322.898	Stratasys Ltd	2.709.114	0,81
236.466	TechnipFMC Plc	6.183.586	1,85
6.639	Teledyne Technologies Inc	2.575.799	0,77
70.583	Tempur Sealy International Inc	3.341.399	1,00
714.411	TETRA Technologies Inc	2.471.862	0,74
68.607	Texas Capital Bancshares Inc	4.194.632	1,26
82.756	TreeHouse Foods Inc	3.032.180	0,91

US Small Cap Intrinsic Value – Cartera de inversiones (cont.)

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados (cont.)

Número de Acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 94,81% (31 de diciembre de 2023: 93,24%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
14.272	Twin Discount Inc	168.124	0,05
311.677	Under Armour Inc Class C	2.035.251	0,61
400.857	Unisys Corp	1.655.539	0,49
38.327	United Parks & Resorts Inc	2.081.539	0,62
103.824	Varex Imaging Corp	1.529.328	0,46
36.746	Varonis Systems Inc Class B	1.762.706	0,53
281.835	Veeco Instruments Inc	13.164.513	3,94
88.633	Verint Systems Inc	2.853.982	0,86
335.906	Viasat Inc	4.266.006	1,28
194.460	Viavi Solutions Inc	1.335.940	0,40
128.177	Vistra Corp	11.020.658	3,30
9.001	Whirlpool Corp	919.902	0,28
24.562	Wix.com Ltd	3.907.077	1,17
111.916	Wolfspeed Inc	2.547.208	0,76
203.303	Xperi Inc	1.669.118	0,50
108.423	Zimvie Inc	1.978.720	0,59
Total valores de renta variable *		316.632.123	94,81

Importe principal	Descripción de los valores	Cupón	Fecha de vencimiento	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Bonos de empresa 0,00% (31 de diciembre de 2023: 0,00%)					
Dólar estadounidense					
32.000	Ion Geophysical Escrow Corp	8,00%	15/12/2025	0	0,00
Total bonos de empresa *				0	0,00
Total inversiones				316.632.123	94,81

Contratos de divisas a plazo 0,00% (31 de diciembre de 2023: 0,00%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases EUR con cobertura</i>						
1.045.491 EUR	1.118.411 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	3	2.950	0,00
22.254 USD	20.630 EUR	18/07/2024	Goldman Sachs International	2	126	0,00
101.587 USD	93.725 EUR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	8	1.063	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					4.139	0,00

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	316.636.262	94,81

US Small Cap Intrinsic Value – Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,00%) (31 de diciembre de 2023: (0,00%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
<i>Clases EUR con cobertura</i>						
58.989 EUR	63.726 USD	18/07/2024	Goldman Sachs International	4	(456)	(0,00)
100.737 EUR	109.208 USD	18/07/2024	Westpac Banking Corp	10	(1.161)	(0,00)
28.066 USD	26.287 EUR	18/07/2024	Goldman Sachs International	2	(128)	(0,00)
57.325 USD	53.585 EUR	18/07/2024	Westpac Banking Corp	4	(148)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(1.893)	(0,00)

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(1.893)	(0,00)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	316.634.369	94,81
Otro activo neto	17.328.738	5,19
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	333.963.107	100,00

Análisis de la cartera	USD	% de los activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	316.632.123	94,53
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	2.246	0,00
Total inversiones	316.634.369	94,53

Balances

		5G Connectivity	Absolute Return	China A-Share	China Bond	China Equity	Climate Innovation	CLO Income	Commodities
		A	Multi Strategy	Equity					
		A	A	A	A	A	A	A	A
		30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de
		2024	2024*	2024	2024	2024	2024	2024	2024
		USD	USD	CNY	CNY	USD	USD	USD	USD
Activo circulante									
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		1.134.381.062	—	14.032.190	174.092.568	134.306.732	3.038.979	468.768.927	144.228.976
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	44.831.055	93.271	787.495	14.995.185	6.168.312	137.005	24.828.272	21.314.182
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		2.987.728	13.359	—	7	—	10.062	—	—
Cuentas a percibir por acciones emitidas		7.614.872	—	—	343	435.974	—	—	294.887
Cuentas por cobrar de intermediarios		—	—	—	523.667	—	—	—	—
Ingresos a percibir y otros activos		246.145	1.049	98.754	1.973.769	463.307	12.529	6.920.464	753.346
Activos totales		1.190.060.862	107.679	14.918.439	191.585.539	141.374.325	3.198.575	500.517.663	166.591.391
Pasivo circulante									
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		607.196	—	—	1.118.018	23.531	—	378.552	66.805
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		8.692.699	—	—	2.783	436.340	—	—	207.831
Gastos devengados		1.469.195	4.860	325.170	373.081	208.767	6.973	252.644	125.989
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		4.478.446	—	61.260	—	227.348	50	57.704.970	744.150
Otras cuentas por pagar		80.834	102.819	84.932	190.052	41.059	7.959	316.586	20.026
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		15.328.370	107.679	471.362	1.683.934	937.045	14.982	58.652.752	1.164.801
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		1.174.732.492	—	14.447.077	189.901.605	140.437.280	3.183.593	441.864.911	165.426.590

* Absolute Return Multi Strategy se liquidó el 20 de diciembre de 2021.

Balances (cont.)

		Corporate Hybrid Bond	Developed Market FMP – 2027	Emerging Market Debt - Hard Currency	Emerging Market Debt - Local Currency	Emerging Market Debt Blend	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Emerging Markets Equity	Euro Bond
	Nota	A 30 de junio de 2024 EUR	A 30 de junio de 2024 USD	A 30 de junio de 2024 USD	A 30 de junio de 2024 USD	A 30 de junio de 2024 USD	A 30 de junio de 2024 USD	A 30 de junio de 2024 USD	A 30 de junio de 2024 EUR
Activo circulante									
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		1.965.166.961	125.999.339	2.579.415.266	1.096.901.732	473.236.805	60.998.924	113.055.631	14.307.045
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	68.511.690	9.458.247	25.508.028	27.533.340	17.777.015	366.041	5.315.701	54.173
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		1.304	–	–	42.043.947	8.456.162	732.142	–	177.894
Cuentas a percibir por acciones emitidas		2.987.553	–	5.205.207	887.744	119.102	94	161.978	–
Cuentas por cobrar de intermediarios		–	–	15.596.265	24.432.589	8.042.286	993.557	–	204.052
Ingresos a percibir y otros activos		37.894.247	1.389.382	48.971.298	26.707.757	10.143.011	1.006.755	350.612	209.523
Activos totales		2.074.561.755	136.846.968	2.674.696.064	1.218.507.109	517.774.381	64.097.513	118.883.922	14.952.687
Pasivo circulante									
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		5.662.368	172	10.733.896	30.217.066	9.904.154	208.749	260.167	67.700
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		12.939.503	–	9.725.630	32.003.586	199.282	–	2.603.242	–
Adeudado a los intermediarios		–	–	–	2.070.000	600.000	–	–	–
Gastos devengados		1.237.844	104.430	1.864.528	848.687	400.498	66.738	151.029	37.194
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		–	–	12.985.993	20.989.469	7.003.147	317.280	571.866	754.445
Otras cuentas por pagar		123.791	6.611	226.585	3.284.349	953.391	48.150	1.375.065	22.752
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		19.963.506	111.213	35.536.632	89.413.157	19.060.472	640.917	4.961.369	882.091
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		2.054.598.249	136.735.755	2.639.159.432	1.129.093.952	498.713.909	63.456.596	113.922.553	14.070.596

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Balances (cont.)

		Euro Bond Absolute Return	European High Yield Bond	European Sustainable Equity	Event Driven	Global Bond	Global Diversified Income FMP – 2024	Global Equity Megatrends	Global Flexible Credit Income
		A	A	A	A	A	A	A	A
	Nota	30 de junio de 2024	30 de junio de 2024	30 de junio de 2024	30 de junio de 2024	30 de junio de 2024	30 de junio de 2024*	30 de junio de 2024	30 de junio de 2024
		EUR	EUR	EUR	USD	USD	USD	USD	USD
Activo circulante									
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		52.068.784	505.851.385	147.657.183	132.033.196	109.443.290	39.188	228.302.772	409.782.698
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	730.799	11.456.697	2.531.691	4.991.886	4.127.590	102.064.901	7.822.399	1.343.192
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		1.146.344	5.981.759	1.063.411	–	491.503	–	–	366.886
Cuentas a percibir por acciones emitidas		470.000	111.827	160.174	3.130.906	14.344	–	4.389.479	320.564
Cuentas por cobrar de intermediarios		1.010.605	–	–	–	526.629	–	–	2.342.927
Ingresos a percibir y otros activos		739.820	7.629.377	115.671	522.772	936.303	175.501	699.950	6.156.370
Activos totales		56.166.352	531.031.045	151.528.130	140.678.760	115.539.659	102.279.590	241.214.600	420.312.637
Pasivo circulante									
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		462.769	1.030.935	–	166.820	1.435.071	1.221	2.045	1.161.512
Descubierto bancario	3	86.386	–	–	–	–	–	–	–
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		–	144.529	–	66.656	5.007	101.951.468	1.325.575	173.000
Gastos devengados		40.651	124.912	75.114	90.024	75.893	106.610	274.352	209.335
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		2.177.168	14.925.432	1.832	633.645	2.513.002	342	1.192.378	5.854.124
Otras cuentas por pagar		131.622	37.278	13.756	1.030.217	37.700	219.949	15.667	26.611
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		2.898.596	16.263.086	90.702	1.987.362	4.066.673	102.279.590	2.810.017	7.424.582
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		53.267.756	514.767.959	151.437.428	138.691.398	111.472.986	–	238.404.583	412.888.055

* Global Diversified Income FMP – 2024 se liquidó el 28 de junio de 2024.

Balances (cont.)

		Global High Yield SDG Engagement	Global Investment Grade Credit	Global Opportunistic Bond	Global Real Estate Securities	Global Sustainable Equity	Global Sustainable Value	High Yield Bond	InnovAsia 5G
		A	A	A	A	A	A	A	A
Nota		30 de junio de 2024	30 de junio de 2024	30 de junio de 2024	30 de junio de 2024	30 de junio de 2024	30 de junio de 2024	30 de junio de 2024	30 de junio de 2024
		USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Activo circulante									
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		613.672.808	84.513.121	65.135.981	19.750.983	156.728.176	77.181.125	2.132.931.018	20.914.842
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	9.940.922	2.728.010	3.245.372	215.085	2.239.859	512.843	19.126.776	765.493
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		853.785	—	274.201	5	—	—	7.366.399	121.582
Cuentas a percibir por acciones emitidas		7.006.797	—	14.687	—	70.818	230.870	3.977.243	—
Cuentas por cobrar de intermediarios		153.187	—	1.748.899	—	—	—	270.000	—
Ingresos a percibir y otros activos		10.892.823	1.093.366	792.130	81.173	67.371	119.751	35.229.790	23.786
Activos totales		642.520.322	88.334.497	71.211.270	20.047.246	159.106.224	78.044.589	2.198.901.226	21.825.703
Pasivo circulante									
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		532.720	155.977	2.607.917	1.869	—	3.747	3.591.696	16.298
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		713.868	—	56	15.726	8.267	5.266	3.730.625	—
Gastos devengados		250.987	38.129	68.325	54.679	69.720	62.989	1.999.688	51.545
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		7.083.847	381.549	1.653.037	—	67	54	17.501.942	51
Otras cuentas por pagar		60.284	7.005	177.458	18.530	18.043	35.652	348.275	114.388
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		8.641.706	582.660	4.506.793	90.804	96.097	107.708	27.172.226	182.282
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		633.878.616	87.751.837	66.704.477	19.956.442	159.010.127	77.936.881	2.171.729.000	21.643.421

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Balances (cont.)

		Japan Equity Engagement	Macro Opportunities FX	Next Generation Mobility	Next Generation Space Economy	Responsible Asian Debt - Hard Currency	Short Duration Emerging Market Debt	Short Duration High Yield SDG Engagement	Strategic Income
		A	A	A	A	A	A	A	A
	Nota	30 de junio de 2024 JPY	30 de junio de 2024* EUR	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD
Activo circulante									
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		17.688.029.737	—	145.923.726	30.059.270	61.233.595	3.751.799.290	686.418.320	3.397.768.710
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	376.498.754	70.541	2.432.025	1.707.587	4.043.493	21.147.814	10.215.327	29.194.938
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		57.459.010	—	470.283	—	203.750	112.919	5.737.664	98.737.092
Cuentas a percibir por acciones emitidas		8.124.772	—	1.010.219	298.842	—	4.361.375	409.379	16.820.260
Cuentas por cobrar de intermediarios		—	—	—	—	258.923	—	—	4.408.246
Ingresos a percibir y otros activos		24.182.427	16	90.613	16.045	756.178	54.406.806	10.772.223	24.192.153
Activos totales		18.154.294.700	70.557	149.926.866	32.081.744	66.495.939	3.831.828.204	713.552.913	3.571.121.399
Pasivo circulante									
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		93.694	—	616	—	54.952	32.012.576	6.439.402	14.456.683
Descubierto bancario	3	46.966	5.877	—	—	—	—	—	351
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		1.849.658	—	230.203	4.301	—	4.385.621	4.961.788	32.067.205
Adeudado a los intermediarios		—	—	—	—	—	—	—	470.000
Gastos devengados		9.123.993	30.727	241.941	49.491	42.747	2.149.206	467.476	2.282.893
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		10.223	—	590.751	264	1.347.361	21.927.487	4.757.096	525.020.103
Otras cuentas por pagar		1.966.252	33.953	30.651	21.008	18.660	229.737	87.155	1.808.244
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		13.090.786	70.557	1.094.162	75.064	1.463.720	60.704.627	16.712.917	576.105.479
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		18.141.203.914	—	148.832.704	32.006.680	65.032.219	3.771.123.577	696.839.996	2.995.015.920

*Macro Opportunities FX se liquidó el 8 de febrero de 2024.

Balances (cont.)

		Sustainable Asia High Yield	Sustainable Emerging Market Corporate Debt	Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency	Tactical Macro	Ultra Short Term Euro Bond	Uncorrelated Strategies	US Equity	US Equity Index PutWrite
	Nota	A 30 de junio de 2024 USD	A 30 de junio de 2024 USD	A 30 de junio de 2024 USD	A 30 de junio de 2024 USD	A 30 de junio de 2024 EUR	A 30 de junio de 2024 USD	A 30 de junio de 2024 USD	A 30 de junio de 2024 USD
Activo circulante									
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		29.656.305	114.794.495	555.365.700	24.372.147	1.130.841.971	730.199.337	75.129.686	679.257.369
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	428.632	1.915.815	8.393.987	8.676.068	49.636.298	129.913.148	607.244	30.249.985
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		203.750	3.881	—	13.196	22.136.187	25.184.094	—	972.407
Cuentas a percibir por acciones emitidas		—	2.123.721	12.039.610	—	3.226.349	900.616	66.950	1.075.438
Cuentas por cobrar de intermediarios		68.946	304.676	7.863.926	606.268	8.230.936	237.812.173	—	—
Ingresos a percibir y otros activos		530.825	1.906.408	9.538.047	7.264	11.444.725	5.584.103	10.697	6.690.641
Activos totales		30.888.458	121.048.996	593.201.270	33.674.943	1.225.516.466	1.129.593.471	75.814.577	718.245.840
Pasivo circulante									
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		5.195	816.943	6.650.411	207.399	3.871.204	195.262.421	1.731.159	5.645.482
Descubierto bancario	3	—	—	—	661	—	522.654	—	—
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		—	86.419	35.120	—	975.916	7.152.254	209.617	1.068.166
Adeudado a los intermediarios		—	—	—	—	—	8.727.959	—	—
Gastos devengados		71.310	140.950	235.804	11.740	284.191	740.661	80.658	309.062
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		599.434	2.219.175	9.618.596	27.806	20.624.007	16.705.043	—	92.599
Otras cuentas por pagar		7.297	36.470	42.157	19.058	263.149	7.772.093	8.920	56.955
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		683.236	3.299.957	16.582.088	266.664	26.018.467	236.883.085	2.030.354	7.172.264
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		30.205.222	117.749.039	576.619.182	33.408.279	1.199.497.999	892.710.386	73.784.223	711.073.576

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Balances (cont.)

		US Large Cap Value A 30 de junio de 2024 USD	US Long Short Equity A 30 de junio de 2024 USD	US Multi Cap Opportunities A 30 de junio de 2024 USD	US Real Estate Securities A 30 de junio de 2024 USD	US Small Cap A 30 de junio de 2024 USD	US Small Cap Intrinsic Value A 30 de junio de 2024 USD	Total Sociedad* A 30 de junio de 2024 USD
Nota								
Activo circulante								
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		968.562.910	179.884.981	343.033.271	420.372.040	594.608.393	316.636.262	27.620.427.787
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	16.895.412	8.379.117	288.588	5.188.259	9.988.504	17.381.878	800.697.373
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		8.963.062	759.832	184.597	3.424.962	426.428	—	242.168.647
Cuentas a percibir por acciones emitidas		2.561.727	23.305	763.440	433.999	1.184.375	816.071	82.122.385
Cuentas por cobrar de intermediarios		—	11.176.608	—	—	—	—	326.801.489
Ingresos a percibir y otros activos		637.890	94.882	150.474	990.819	203.412	125.953	333.095.012
Activos totales		997.621.001	200.318.725	344.420.370	430.410.079	606.411.112	334.960.164	29.405.312.693
Pasivo circulante								
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		33.677	2.572.272	142.424	194.797	44.887	1.893	340.395.862
Descubierto bancario	3	—	—	—	—	—	—	622.841
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		3.237.366	100.798	1.069.939	1.379.899	756.717	256.432	233.946.600
Adeudado a los intermediarios		—	—	—	—	—	—	11.867.959
Gastos devengados		734.504	254.085	470.502	702.198	618.751	270.486	20.845.877
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		5.427.863	188.023	—	3.508.610	327.710	443.701	775.890.902
Otras cuentas por pagar		99.342	265.647	62.013	66.471	66.553	24.545	20.017.496
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		9.532.752	3.380.825	1.744.878	5.851.975	1.814.618	997.057	1.403.587.537
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		988.088.249	196.937.900	342.675.492	424.558.104	604.596.494	333.963.107	28.001.725.156

* Las Cuentas consolidadas han sido ajustadas para contabilizar los saldos mantenidos a nombre de la Sociedad y las inversiones cruzadas entre Carteras. La información sobre inversiones cruzadas entre Carteras se recoge en la nota 8 de las Notas a las cuentas abreviadas no auditadas.

Balances (cont.)

		5G Connectivity	Absolute Return	China A-Share	China Bond	China Equity	Climate Innovation	CLO Income	Commodities
		A	A	A	A	A	A	A	A
	Nota	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023*	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023
		USD	USD	CNY	CNY	USD	USD	USD	USD
Activo circulante									
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		996.857.530	6.311	13.480.937	447.117.129	172.463.571	2.831.398	179.297.062	122.546.345
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	43.643.862	98.859	1.074.845	9.446.611	6.017.190	83.875	12.287.210	33.206.631
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		11.966.904	737	26.607	—	908.831	27.029	—	306
Cuentas a percibir por acciones emitidas		871.569	—	—	—	—	—	—	589.538
Cuentas por cobrar de intermediarios		—	—	—	682.867	—	—	—	7.330.000
Ingresos a percibir y otros activos		360.533	1.078	192.783	5.178.845	92.331	14.640	3.974.020	662.121
Activos totales		1.053.700.398	106.985	14.775.172	462.425.452	179.481.923	2.956.942	195.558.292	164.334.941
Pasivo circulante									
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		1.033.321	—	—	2.361.945	423.344	—	2.570.754	210.126
Descubierto bancario	3	68	—	—	—	—	—	—	—
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		5.027.207	—	—	637.738	561.527	—	—	90.830
Gastos devengados		1.457.148	11.217	359.457	422.278	244.205	3.183	149.265	135.790
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		2.582.227	—	150.009	606	451	27.707	7.173.352	10.239.576
Otras cuentas por pagar		73.484	95.768	51.874	156.777	26.109	3.497	18.616	12.060
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		10.173.455	106.985	561.340	3.579.344	1.255.636	34.387	9.911.987	10.688.382
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		1.043.526.943	—	14.213.832	458.846.108	178.226.287	2.922.555	185.646.305	153.646.559

* Absolute Return Multi Strategy se liquidó el 20 de diciembre de 2021.

Balances (cont.)

		Corporate Hybrid Bond	Developed Market FMP – 2027	Emerging Market Debt - Hard Currency	Emerging Market Debt - Local Currency	Emerging Market Debt Blend	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Emerging Markets Equity	Emerging Markets Select Equity
	Nota	A 31 de diciembre de 2023 EUR	A 31 de diciembre de 2023 USD	A 31 de diciembre de 2023 USD	A 31 de diciembre de 2023 USD	A 31 de diciembre de 2023 USD	A 31 de diciembre de 2023 USD	A 31 de diciembre de 2023 USD	A 31 de diciembre de 2023* USD
Activo circulante									
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		1.766.641.213	135.817.055	2.588.612.804	1.244.671.584	504.428.604	61.503.601	89.056.214	—
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	79.423.824	503.437	2.306.275	34.899.630	15.095.815	2.754.078	3.296.182	163.972
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		1.744	—	23.722	838	252.512	20.345	194	—
Cuentas a percibir por acciones emitidas		7.249.268	—	8.718.437	1.094.199	178.023	1.182	25.864	—
Cuentas por cobrar de intermediarios		—	—	22.175.962	16.010.321	7.902.696	679.691	—	—
Ingresos a percibir y otros activos		30.551.766	1.479.818	55.368.515	25.831.472	10.166.996	915.984	271.103	20.832
Activos totales		1.883.867.815	137.800.310	2.677.205.715	1.322.508.044	538.024.646	65.874.881	92.649.557	184.804
Pasivo circulante									
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		7.732.130	393	15.874.903	27.976.015	8.849.676	679.582	787.152	—
Descubierto bancario	3	—	—	31.716	—	—	—	—	—
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		5.064.442	239.940	8.966.177	781.709	500.516	—	128.823	—
Adeudado a los intermediarios		—	—	—	2.230.000	390.000	—	—	—
Gastos devengados		1.188.602	100.867	1.919.504	1.023.619	449.175	70.618	142.423	47.821
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		—	35	—	—	393	243	409.316	—
Otras cuentas por pagar		66.178	1.256	594.760	4.629.054	1.047.079	56.889	494.342	136.983
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		14.051.352	342.491	27.387.060	36.640.397	11.236.839	807.332	1.962.056	184.804
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		1.869.816.463	137.457.819	2.649.818.655	1.285.867.647	526.787.807	65.067.549	90.687.501	—

* Emerging Markets Select Equity se liquidó el 7 de septiembre de 2023.

Balances (cont.)

		Euro Bond	Euro Bond	European High	European	Event Driven	Global Bond	Global Diversified	Global Equity
		Absolute Return	Absolute Return	Yield Bond	Sustainable Equity			Income FMP –	Megatrends
		A	A	A	A	A	A	2024	A
Nota	31 de diciembre	31 de diciembre	31 de diciembre	31 de diciembre	31 de diciembre	31 de diciembre	31 de diciembre	31 de diciembre	31 de diciembre
	de 2023	de 2023	de 2023	de 2023	de 2023	de 2023	de 2023	de 2023	de 2023
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	USD	USD	USD	USD
Activo circulante									
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		10.219.503	33.385.909	387.635.250	171.225.790	120.057.191	111.175.172	144.239.599	141.493.045
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	127.676	460.317	16.624.528	1.127.268	13.500.176	1.162.072	11.026.949	5.262.402
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		–	–	10	1.032.578	253	–	–	1.620
Cuentas a percibir por acciones emitidas		–	–	102.548	443	441.776	240	–	788.588
Cuentas por cobrar de intermediarios		217.984	1.822.858	–	–	–	802.148	–	–
Ingresos a percibir y otros activos		145.715	473.859	6.544.828	120.283	10.722	1.061.825	1.098.172	273.742
Activos totales		10.710.878	36.142.943	410.907.164	173.506.362	134.010.118	114.201.457	156.364.720	147.819.397
Pasivo circulante									
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		81.140	1.615.336	1.281.452	–	155.365	3.890.491	–	–
Descubierto bancario	3	–	412.247	–	42	–	–	13	–
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		–	–	98.287	1.292.679	161.583	14.939	–	3.100.333
Gastos devengados		42.325	47.082	110.226	84.070	79.389	80.067	123.837	224.956
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		–	–	963.852	1.639	5.896.768	1.438.589	–	–
Otras cuentas por pagar		14.319	41.451	37.030	30.381	1.304.865	34.571	41.217	11.252
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		137.784	2.116.116	2.490.847	1.408.811	7.597.970	5.458.657	165.067	3.336.541
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		10.573.094	34.026.827	408.416.317	172.097.551	126.412.148	108.742.800	156.199.653	144.482.856

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Balances (cont.)

		Global Flexible Credit Income	Global High Yield SDG Engagement	Global High Yield Sustainable Action	Global Investment Grade Credit	Global Opportunistic Bond	Global Real Estate Securities	Global Sustainable Equity	Global Sustainable Value
		A	A	A	A	A	A	A	A
	Nota	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023*	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023
		USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Activo circulante									
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		368.099.040	544.440.088	—	83.459.890	70.656.593	20.510.136	153.603.419	54.991.923
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	25.482.094	10.709.205	52.318	3.401.463	1.529.454	211.649	781.170	544.936
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		—	820.711	—	—	110.692	—	618.618	—
Cuentas a percibir por acciones emitidas		435.297	187.598	—	—	19.690	12.500	159.181	20.869
Cuentas por cobrar de intermediarios		3.225.584	—	—	—	1.153.721	—	—	—
Ingresos a percibir y otros activos		5.792.332	9.463.589	1	1.093.184	732.900	102.538	72.293	84.087
Activos totales		403.034.347	565.621.191	52.319	87.954.537	74.203.050	20.836.823	155.234.681	55.641.815
Pasivo circulante									
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		8.620.881	6.738.234	—	1.107.450	7.756.007	250.684	—	46.897
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		1.835.312	345.199	—	—	—	54.826	9.808	17.218
Adeudado a los intermediarios		200.000	—	—	—	—	—	—	—
Gastos devengados		238.837	244.147	29.617	46.561	72.646	58.316	77.887	65.609
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		1.500.862	97.458	—	—	911.501	1	540.903	6
Otras cuentas por pagar		25.474	32.248	22.702	22.701	53.133	12.983	32.788	46.191
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		12.421.366	7.457.286	52.319	1.176.712	8.793.287	376.810	661.386	175.921
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		390.612.981	558.163.905	—	86.777.825	65.409.763	20.460.013	154.573.295	55.465.894

*Global High Yield Sustainable Action se liquidó el 16 de junio de 2023.

Balances (cont.)

		High Yield Bond	InnovAsia 5G	Japan Equity Engagement	Macro Opportunities FX	Multi-Asset Income	Next Generation Mobility	Next Generation Space Economy	Responsible Asian Debt - Hard Currency
		A	A	A	A	A	A	A	A
	Nota	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023*	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023
		USD	USD	JPY	EUR	USD	USD	USD	USD
Activo circulante									
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		2.133.705.667	22.824.022	16.090.377.079	7.381.837	—	152.835.153	18.674.716	60.597.643
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	73.617.932	1.128.943	90.965.141	126.875	58.916	11.689.060	943.288	2.708.868
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		27.132.212	—	—	—	—	415.564	294	—
Cuentas a percibir por acciones emitidas		8.426.020	—	9.477.834	22.386	—	323.006	167.685	—
Cuentas por cobrar de intermediarios		—	—	—	—	—	—	—	128.088
Ingresos a percibir y otros activos		37.739.993	20.417	43.887.262	17.813	231	69.192	5.544	850.351
Activos totales		2.280.621.824	23.973.382	16.234.707.316	7.548.911	59.147	165.331.975	19.791.527	64.284.950
Pasivo circulante									
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		15.443.334	60.136	42.002.252	4.613.695	—	10.365	—	263.464
Descubierto bancario	3	—	6.560	69.286	—	—	—	—	—
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		4.565.230	16.084	2.684.590	4.194	—	486.682	—	14.879
Gastos devengados		2.119.832	54.304	11.646.832	33.119	39.739	276.843	35.580	50.885
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		6.528.399	86	—	44	—	179.180	—	—
Otras cuentas por pagar		154.310	66.092	775.641	16.053	19.408	22.840	12.017	13.858
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		28.811.105	203.262	57.178.601	4.667.105	59.147	975.910	47.597	343.086
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		2.251.810.719	23.770.120	16.177.528.715	2.881.806	—	164.356.065	19.743.930	63.941.864

* Multi-Asset Income se liquidó el 6 de julio de 2023.

Balances (cont.)

		Short Duration Emerging Market Debt	Short Duration High Yield SDG Engagement	Strategic Income	Sustainable Asia High Yield	Sustainable Emerging Market Corporate Debt	Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency	Tactical Macro	Ultra Short Term Euro Bond
	Nota	A 31 de diciembre de 2023 USD	A 31 de diciembre de 2023 USD	A 31 de diciembre de 2023 USD	A 31 de diciembre de 2023 USD	A 31 de diciembre de 2023 USD	A 31 de diciembre de 2023 USD	A 31 de diciembre de 2023 USD	A 31 de diciembre de 2023 EUR
Activo circulante									
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		3.882.376.064	692.929.732	2.163.075.623	26.910.034	92.566.505	432.174.496	23.429.706	965.478.305
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	14.257.955	44.469.256	55.205.634	1.163.077	3.976.271	7.042.532	3.554.300	11.222.572
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		11.329.362	10.775.834	22.831.706	—	—	—	—	—
Cuentas a percibir por acciones emitidas		5.275.293	336.109	91.892.501	—	30.010	—	—	3.219.672
Cuentas por cobrar de intermediarios		5.350.000	—	22.631.176	108.311	425.554	4.811.634	526.958	11.144.095
Ingresos a percibir y otros activos		51.967.946	11.302.348	16.507.617	513.607	1.463.373	7.824.139	6.453	10.766.896
Activos totales		3.970.556.620	759.813.279	2.372.144.257	28.695.029	98.461.713	451.852.801	27.517.417	1.001.831.540
Pasivo circulante									
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		9.131.675	3.114.085	25.175.764	58.767	472.118	5.706.695	262.401	8.016.867
Descubierto bancario	3	—	—	377	—	—	—	68.223	—
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		2.760.383	241.544	3.405.075	746	28.695	16.636	—	440.357
Adeudado a los intermediarios		—	—	520.000	—	—	—	—	—
Gastos devengados		2.320.930	510.397	1.529.024	58.670	146.162	215.044	10.585	258.073
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		1.500.740	11.465.702	321.393.124	—	—	90	93	—
Otras cuentas por pagar		73.325	47.104	517.312	11.895	25.601	22.066	13.807	243.945
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		15.787.053	15.378.832	352.540.676	130.078	672.576	5.960.531	355.109	8.959.242
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		3.954.769.567	744.434.447	2.019.603.581	28.564.951	97.789.137	445.892.270	27.162.308	992.872.298

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Balances (cont.)

		Uncorrelated Strategies	Uncorrelated Trading	US Equity	US Equity Index PutWrite	US Large Cap Value	US Long Short Equity	US Multi Cap Opportunities	US Real Estate Securities
		A	A	A	A	A	A	A	A
	Nota	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023*	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023	31 de diciembre de 2023
		USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Activo circulante									
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		1.476.262.171	—	47.126.139	675.485.941	1.852.695.638	182.183.949	398.826.631	522.351.479
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	215.995.568	198.922	2.317.070	56.170.541	129.487.412	4.926.902	2.020.942	12.824.749
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		15.185.048	—	3.038	1.711.903	27.677.469	466.494	2.749.439	1.290.830
Cuentas a percibir por acciones emitidas		43.677.979	—	266.617	1.578.418	1.825.988	43.717	937.914	3.439.184
Cuentas por cobrar de intermediarios		456.802.391	—	—	—	—	18.176.471	—	—
Ingresos a percibir y otros activos		76.645.645	1.324	37.095	1.742.599	2.702.827	559.458	211.780	1.534.038
Activos totales		2.284.568.802	200.246	49.749.959	736.689.402	2.014.389.334	206.356.991	404.746.706	541.440.280
Pasivo circulante									
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		499.958.213	—	118.963	5.789.899	115.827	8.738.101	325.170	441.683
Descubierto bancario	3	659	—	—	—	—	—	—	—
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		4.375.209	—	349.690	1.255.511	11.729.299	692.205	3.342.769	6.007.211
Gastos devengados		1.133.015	110.069	74.355	349.539	1.158.780	280.090	547.484	895.622
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		81.242.292	—	—	165.070	62.146.829	14.013	—	941.735
Otras cuentas por pagar		71.157.993	90.177	4.802	31.383	48.221	1.162.291	39.248	44.044
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		657.867.381	200.246	547.810	7.591.402	75.198.956	10.886.700	4.254.671	8.330.295
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		1.626.701.421	—	49.202.149	729.098.000	1.939.190.378	195.470.291	400.492.035	533.109.985

* Uncorrelated Trading se liquidó el 24 de mayo de 2023.

Balances (cont.)

	Nota	US Small Cap A 31 de diciembre de 2023 USD	US Small Cap Intrinsic Value A 31 de diciembre de 2023 USD	Total Sociedad* A 31 de diciembre de 2023 USD
Activo circulante				
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		623.039.280	301.736.793	27.392.822.906
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	12.744.703	18.299.118	1.025.815.249
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		369	1.402.699	138.871.900
Cuentas a percibir por acciones emitidas		2.127.779	477.091	185.808.216
Cuentas por cobrar de intermediarios		—	—	582.901.730
Ingresos a percibir y otros activos		193.802	125.377	385.748.047
Activos totales		638.105.933	322.041.078	29.711.968.048
Pasivo circulante				
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		137.144	398	688.709.657
Descubierto bancario	3	—	—	563.542
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		3.284.597	40.900	72.180.295
Adeudado a los intermediarios		—	—	3.340.000
Gastos devengados		639.284	275.610	22.069.430
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		154.493	140.859	517.779.908
Otras cuentas por pagar		38.646	14.694	82.992.460
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		4.254.164	472.461	1.387.635.292
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		633.851.769	321.568.617	28.324.332.756

* Las Cuentas consolidadas han sido ajustadas para contabilizar los saldos mantenidos a nombre de la Sociedad y las inversiones cruzadas entre Carteras. La información sobre inversiones cruzadas entre Carteras se recoge en la nota 8 de las Notas a las cuentas abreviadas no auditadas.

Cuentas de pérdidas y ganancias

		5G Connectivity	Absolute Return	China A-Share	China Bond	China Equity	Climate Innovation	CLO Income	Commodities
		Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado
		el	el	el	el	el	el	el	el
		30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de
		2024	2024*	2024	2024	2024	2024	2024	2024
		USD	USD	CNY	CNY	USD	USD	USD	USD
Nota									
Ingresos									
Ingresos por intereses		980.327	2.379	248	4.185.247	48.623	2.246	14.040.192	2.732.530
Ingresos por dividendos		3.498.123	—	192.443	—	2.166.947	36.136	—	—
Ingresos varios		26.801	3	20.946	—	—	—	4.249	—
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		281.032.084	(2.382)	152.193	10.497.342	7.328.932	232.532	9.953.402	6.474.331
		285.537.335	—	365.830	14.682.589	9.544.502	270.914	23.997.843	9.206.861
Gastos									
Comisión de gestión	5	7.646.229	—	64.052	64.238	911.400	151	858.813	345.400
Comisión de distribución	5	376.266	—	—	—	78	—	—	1.512
Comisión de administración	5	323.031	—	119.851	211.697	57.566	11.102	72.343	57.613
Comisión de compromiso	16	83.938	—	1.107	28.218	12.902	222	15.932	11.939
Comisión de depósito	5	56.840	—	41.635	119.909	21.491	3.240	5.810	5.784
Comisión del Depositario	5	22.036	—	283	5.946	2.831	63	5.609	3.279
Honorarios profesionales	7	105.424	—	139.634	253.529	52.559	20.003	35.824	25.441
Honorarios de los Consejeros	6	1.634	—	11.771	11.563	1.629	1.730	1.647	1.637
Costes de transacciones	7	1.134.372	—	168.921	71.831	169.566	6.292	8.681	17.521
Honorarios de auditoría	7	5.015	—	35.249	36.199	5.185	4.977	5.148	5.029
Reembolso de IVA		(3.873)	—	(54)	(1.564)	(641)	(11)	(762)	(572)
Otros gastos	7	8.315	—	31.014	101.325	10.631	11.862	4.234	5.131
Gastos no asumidos	5	—	—	(604.541)	(426.451)	—	(55.117)	—	—
Gastos totales		9.759.227	—	8.922	476.440	1.245.197	4.514	1.013.279	479.714
Costes financieros									
Gastos por intereses		—	—	—	—	—	—	168	—
Repartos de dividendos abonados	1	—	—	105.250	62.455	163	—	5.370.533	—
		—	—	105.250	62.455	163	—	5.370.701	—
Impuestos retenidos en origen		791.730	—	18.413	—	143.307	5.362	—	21.544
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		274.986.378	—	233.245	14.143.694	8.155.835	261.038	17.613.863	8.705.603

* Absolute Return Multi Strategy se liquidó el 20 de diciembre de 2021.

Cuentas de pérdidas y ganancias (cont.)

		Corporate Hybrid Bond	Developed Market FMP – 2027	Emerging Market Debt - Hard Currency	Emerging Market Debt - Local Currency	Emerging Market Debt Blend	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Emerging Markets Equity	Euro Bond
	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 EUR	Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 EUR
Ingresos									
Ingresos por intereses		47.940.250	2.938.519	74.387.402	38.523.712	16.422.450	1.530.193	67.201	200.327
Ingresos por dividendos		–	–	–	–	–	–	1.446.721	–
Ingresos varios		–	–	–	203.671	63.822	4.464	2.532	2.499
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		41.332.731	(481.249)	26.799.207	(89.707.161)	(23.606.263)	(3.846.843)	15.042.447	(93.820)
		89.272.981	2.457.270	101.186.609	(50.979.778)	(7.119.991)	(2.312.186)	16.558.901	109.006
Gastos									
Comisión de gestión	5	6.533.809	391.020	9.513.104	4.037.655	1.700.715	126.330	413.969	18.814
Comisión de distribución	5	87.994	–	139.580	75.970	16.588	–	17.820	–
Comisión de administración	5	410.435	35.707	678.394	353.034	196.604	52.457	83.067	26.896
Comisión de compromiso	16	145.500	8.969	207.364	95.697	40.636	4.923	7.509	819
Comisión de depósito	5	59.604	3.461	86.517	399.416	90.019	7.129	27.586	5.328
Comisión del Depositario	5	40.527	2.806	51.788	23.915	10.371	1.263	1.927	242
Honorarios profesionales	7	134.993	28.398	183.849	126.805	69.299	23.131	68.228	17.389
Honorarios de los Consejeros	6	1.486	1.729	1.633	1.613	1.647	1.626	1.614	1.553
Costes de transacciones	7	33.145	545	152.100	136.523	103.311	33.309	248.784	4.908
Honorarios de auditoría	7	5.384	7.131	6.065	6.123	5.812	4.902	5.426	4.437
Reembolso de IVA		(7.165)	(507)	(9.731)	(4.665)	(1.937)	(238)	(340)	(41)
Otros gastos	7	4.550	3.342	8.711	10.948	7.070	4.237	5.298	5.060
Gastos no asumidos	5	–	–	–	(46.450)	–	(62.741)	(119.214)	(53.332)
Gastos totales		7.450.262	482.601	11.019.374	5.216.584	2.240.135	196.328	761.674	32.073
Costes financieros									
Gastos por intereses		1.534	–	1.225	17.137	3.406	–	1.500	208
Repartos de dividendos abonados	1	8.699.251	682.902	16.984.685	8.423.284	3.428.980	–	67.046	118.318
		8.700.785	682.902	16.985.910	8.440.421	3.432.386	–	68.546	118.526
Impuestos retenidos en origen		–	8.942	51.657	675.603	192.233	26.253	161.687	–
Impuesto sobre las plusvalías		–	–	–	(451.616)	(75.671)	(6.936)	1.109.844	–
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		73.121.934	1.282.825	73.129.668	(64.860.770)	(12.909.074)	(2.527.831)	14.457.150	(41.593)

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Cuentas de pérdidas y ganancias (cont.)

		Euro Bond Absolute Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 EUR	European High Yield Bond Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 EUR	European Sustainable Equity Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 EUR	Event Driven Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Global Bond Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Global Diversified Income FMP – 2024 Semestre finalizado el 30 de junio de 2024* USD	Global Equity Megatrends Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Global Flexible Credit Income Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD
	Nota								
Ingresos									
Ingresos por intereses		761.941	12.624.642	29.096	824.267	2.244.449	2.223.103	106.870	12.925.815
Ingresos por dividendos		–	–	2.268.710	–	–	–	1.451.942	1.188
Ingresos varios		6.553	–	24.247	–	–	23.776	–	76.735
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		1.737.711	5.980.195	7.441.490	4.323.280	(5.090.623)	1.409.273	23.650.882	337.160
		2.506.205	18.604.837	9.763.543	5.147.547	(2.846.174)	3.656.152	25.209.694	13.340.898
Gastos									
Comisión de gestión	5	13.813	423.853	238.506	311.192	8.791	372.992	970.800	939.359
Comisión de distribución	5	–	3.183	210	–	3.053	–	166.606	31.456
Comisión de administración	5	31.173	126.430	52.560	45.512	80.162	42.390	85.135	113.193
Comisión de compromiso	16	2.592	31.125	13.473	8.255	8.563	13.351	12.554	30.465
Comisión de depósito	5	5.330	11.251	9.820	5.661	5.790	5.000	5.814	6.091
Comisión del Depositario	5	838	10.385	3.486	3.569	2.159	2.534	3.781	8.224
Honorarios profesionales	7	15.411	49.146	32.989	42.270	36.726	38.792	33.669	42.465
Honorarios de los Consejeros	6	1.554	1.485	1.516	1.545	1.618	1.291	1.638	1.628
Comisión de rentabilidad	5	–	–	–	990.102	–	–	–	–
Costes de transacciones	7	13.046	19.505	96.992	15.804	47.441	5.197	65.005	37.281
Honorarios de auditoría	7	4.500	4.912	4.702	5.055	4.996	10.946	4.976	7.339
Reembolso de IVA		(138)	(1.592)	(650)	(460)	(403)	(552)	(565)	(1.460)
Otros gastos	7	4.518	5.076	4.331	4.748	4.719	6.630	22.009	5.733
Gastos no asumidos	5	(32.518)	–	–	–	(58.502)	–	–	–
Renuncia a la comisión de asesoría	5	–	–	–	–	–	–	–	(154)
Gastos totales		60.119	684.759	457.935	1.433.253	145.113	498.571	1.371.422	1.221.620
Costes financieros									
Gastos por intereses		5.942	174	–	33	192	–	437	653
Repartos de dividendos abonados	1	115	145.373	730.669	–	1.484	1.311.432	–	12.332
		6.057	145.547	730.669	33	1.676	1.311.432	437	12.985
Impuestos retenidos en origen		–	54.409	345.663	7.895	31.394	7.458	157.570	61.163
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		2.440.029	17.720.122	8.229.276	3.706.366	(3.024.357)	1.838.691	23.680.265	12.045.130

* Global Diversified Income FMP – 2024 se liquidó el 28 de junio de 2024.

Cuentas de pérdidas y ganancias (cont.)

		Global High Yield SDG Engagement Semestre finalizado el	Global Investment Grade Credit Semestre finalizado el	Global Opportunistic Bond Semestre finalizado el	Global Real Estate Securities Semestre finalizado el	Global Sustainable Equity Semestre finalizado el	Global Sustainable Value Semestre finalizado el	High Yield Bond Semestre finalizado el	InnovAsia 5G Semestre finalizado el
	Nota	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD
Ingresos									
Ingresos por intereses		18.203.643	1.991.396	1.472.848	5.692	29.511	9.105	73.646.457	18.994
Ingresos por dividendos		—	—	376	425.149	965.545	1.033.375	64.197	82.076
Ingresos varios		199.059	17.111	23.106	—	23.256	—	1.447.568	12.848
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(8.768.913)	(921.284)	(1.381.561)	(1.586.504)	9.611.749	3.528.187	(17.610.014)	2.035.406
		9.633.789	1.087.223	114.769	(1.155.663)	10.630.061	4.570.667	57.548.208	2.149.324
Gastos									
Comisión de gestión	5	1.026.705	22.718	52.974	77.331	194.510	89.033	9.427.215	122.115
Comisión de distribución	5	3.714	—	—	7.911	1.572	2.184	729.343	193
Comisión de administración	5	166.004	52.377	76.451	34.506	51.635	41.212	708.619	28.627
Comisión de compromiso	16	43.220	6.638	5.045	1.708	12.318	4.283	171.253	1.847
Comisión de depósito	5	9.110	5.829	5.813	5.767	5.775	5.789	13.932	5.919
Comisión del Depositario	5	11.452	1.734	1.285	379	3.198	1.312	43.597	735
Honorarios profesionales	7	61.433	17.836	25.271	33.438	36.397	32.214	195.105	35.052
Honorarios de los Consejeros	6	1.635	1.604	1.637	1.640	1.630	1.658	1.650	1.516
Costes de transacciones	7	56.945	4.388	23.933	38.133	12.650	78.221	99.230	116.514
Honorarios de auditoría	7	5.411	4.910	5.023	5.095	5.100	5.019	8.538	5.205
Reembolso de IVA		(2.073)	(320)	(241)	(75)	(573)	(215)	(8.239)	(86)
Otros gastos	7	5.913	4.234	4.655	4.704	4.877	5.453	8.133	4.713
Gastos no asumidos	5	(27.881)	(10.759)	(80.918)	(78.476)	—	(33.919)	—	(69.206)
Renuncia a la comisión de asesoría	5	—	—	—	—	—	—	(8.359)	—
Gastos totales		1.361.588	111.189	120.928	132.061	329.089	232.244	11.390.017	253.144
Costes financieros									
Gastos por intereses		2.383	6	49	323	263	750	52.127	25
Repartos de dividendos abonados	1	225.898	—	176.021	398	—	—	49.641.286	—
		228.281	6	176.070	721	263	750	49.693.413	25
Impuestos retenidos en origen		—	2.016	5.194	61.590	266.712	175.362	164.022	11.048
Impuesto sobre las plusvalías		—	—	945	—	—	(1.449)	—	88.281
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		8.043.920	974.012	(188.368)	(1.350.035)	10.033.997	4.163.760	(3.699.244)	1.796.826

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Cuentas de pérdidas y ganancias (cont.)

		Japan Equity Engagement	Macro Opportunities FX	Next Generation Mobility	Next Generation Space Economy	Responsible Asian Debt - Hard Currency	Short Duration Emerging Market Debt	Short Duration High Yield SDG Engagement	Strategic Income
		Semestre finalizado el	Semestre finalizado el	Semestre finalizado el	Semestre finalizado el	Semestre finalizado el	Semestre finalizado el	Semestre finalizado el	Semestre finalizado el
	Nota	30 de junio de 2024 JPY	30 de junio de 2024* EUR	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD
Ingresos									
Ingresos por intereses		—	1.924	95.960	31.737	1.360.689	85.974.995	22.322.766	64.072.992
Ingresos por dividendos		182.032.228	—	1.081.317	149.092	—	—	4.285	2.592
Ingresos varios		—	92	—	—	634	—	466.803	404.949
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		1.777.667.064	11.479	12.683.821	2.023.243	352.196	(82.974.288)	(25.916.720)	(62.231.712)
		1.959.699.292	13.495	13.861.098	2.204.072	1.713.519	3.000.707	(3.122.866)	2.248.821
Gastos									
Comisión de gestión	5	33.173.489	1.241	1.036.693	120.181	11.440	10.789.002	2.259.897	11.064.267
Comisión de distribución	5	—	—	179.143	28.922	1.534	341.110	30.965	604.122
Comisión de administración	5	7.624.231	15.857	69.886	27.231	57.586	847.649	210.564	757.053
Comisión de compromiso	16	1.425.360	1.691	12.215	1.727	4.923	286.173	55.601	181.056
Comisión de depósito	5	981.046	1.875	5.736	5.971	5.774	132.666	5.720	23.973
Comisión del Depositario	5	333.525	11	3.031	994	1.280	75.051	14.034	54.728
Honorarios profesionales	7	4.244.279	24.787	42.027	28.380	42.801	263.765	85.777	168.188
Honorarios de los Consejeros	6	237.495	914	1.635	1.645	1.611	1.663	1.614	1.627
Costes de transacciones	7	15.887.334	14.952	105.212	20.552	6.165	64.501	35.856	370.578
Honorarios de auditoría	7	745.606	9.033	5.144	4.851	5.122	6.366	6.715	4.336
Reembolso de IVA		(63.222)	(9)	(595)	(77)	(236)	(14.453)	(2.703)	(7.739)
Otros gastos	7	460.178	6.503	5.797	8.397	4.930	5.444	6.142	5.742
Gastos no asumidos	5	—	(73.559)	—	(60.523)	(75.259)	—	—	—
Renuncia a la comisión de asesoría	5	—	—	—	—	—	—	(556)	(337)
Gastos totales		65.049.321	3.296	1.465.924	188.251	67.671	12.798.937	2.709.626	13.227.594
Costes financieros									
Gastos por intereses		297.093	163	—	—	—	6.192	—	1.466
Repartos de dividendos abonados	1	222.657	—	—	—	9.707	16.030.616	7.754.816	41.733.492
		519.750	163	—	—	9.707	16.036.808	7.754.816	41.734.958
Impuestos retenidos en origen		27.304.834	—	197.689	15.952	9	—	20.461	284.584
Impuesto sobre las plusvalías		—	—	—	—	—	—	—	58.784
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		1.866.825.387	10.036	12.197.485	1.999.869	1.636.132	(25.835.038)	(13.607.769)	(53.057.099)

*Macro Opportunities FX se liquidó el 8 de febrero de 2024.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Cuentas de pérdidas y ganancias (cont.)

		Sustainable Asia High Yield	Sustainable Emerging Market Corporate Debt	Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency	Tactical Macro	Ultra Short Term Euro Bond	Uncorrelated Strategies	US Equity	US Equity Index PutWrite
		Semestre finalizado el	Semestre finalizado el	Semestre finalizado el	Semestre finalizado el	Semestre finalizado el	Semestre finalizado el	Semestre finalizado el	Semestre finalizado el
	Nota	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 EUR	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD	30 de junio de 2024 USD
Ingresos									
Ingresos por intereses		771.806	2.908.996	13.044.695	307.449	15.128.541	18.575.092	36.569	16.026.580
Ingresos por dividendos		–	–	–	552	–	165.445	277.703	–
Ingresos varios		–	–	–	–	79.553	537	–	–
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		1.530.702	(1.932.234)	(9.709.685)	336.057	20.853.631	(55.620.556)	4.301.133	39.732.113
		2.302.508	976.762	3.335.010	644.058	36.061.725	(36.879.482)	4.615.405	55.758.693
Gastos									
Comisión de gestión	5	718	345.622	994.785	5.421	964.147	4.082.687	253.775	1.670.590
Comisión de asesoría	5	–	–	–	–	–	4.530.690	–	–
Comisión de distribución	5	–	13.609	–	–	20.769	37.353	19.916	5.441
Comisión de administración	5	30.899	67.027	102.175	13.375	239.340	854.084	34.563	196.078
Comisión de compromiso	16	2.212	7.739	37.715	2.146	79.345	110.075	4.583	60.071
Comisión de depósito	5	5.830	5.702	14.395	5.175	33.671	94.032	5.785	5.796
Comisión del Depositario	5	589	2.095	10.034	640	21.944	82.560	1.375	15.969
Honorarios profesionales	7	33.548	45.718	34.260	23.262	69.553	295.825	21.402	77.169
Honorarios de los Consejeros	6	1.648	1.614	1.645	1.603	1.495	1.644	1.657	1.592
Costes de transacciones	7	4.228	15.372	34.894	12.083	41.668	3.544.780	13.350	55.476
Honorarios de auditoría	7	4.978	5.620	4.958	4.985	4.775	5.350	4.889	5.349
Reembolso de IVA		(106)	(367)	(1.695)	(104)	(3.807)	(5.608)	(195)	(2.765)
Otros gastos	7	7.631	4.657	4.132	8.538	4.508	272.661	4.332	4.294
Gastos no asumidos	5	(59.628)	(66.946)	–	(33.052)	–	(186.088)	(11.089)	–
Gastos totales		32.547	447.462	1.237.298	44.072	1.477.408	13.720.045	354.343	2.095.060
Costes financieros									
Gastos por intereses		–	–	339	1.541	–	61.654	3.713	–
Repartos de dividendos abonados	1	146.711	107.157	–	–	59.642	–	–	3.580.434
		146.711	107.157	339	1.541	59.642	61.654	3.713	3.580.434
Impuestos retenidos en origen		8.070	14	381.988	–	–	1.448.431	80.543	–
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		2.115.180	422.129	1.715.385	598.445	34.524.675	(52.109.612)	4.176.806	50.083.199

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Cuentas de pérdidas y ganancias (cont.)

		US Large Cap Value Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	US Long Short Equity Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	US Multi Cap Opportunities Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	US Real Estate Securities Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	US Small Cap Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	US Small Cap Intrinsic Value Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Total Sociedad* Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD
	Nota							
Ingresos								
Ingresos por intereses		842.895	627.268	45.936	156.589	371.023	479.064	577.040.616
Ingresos por dividendos		17.656.851	1.031.113	1.920.394	8.387.643	2.668.519	1.188.729	49.387.148
Ingresos varios		12.552	19.562	—	—	—	—	3.159.230
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		65.873.311	2.198.936	36.638.292	(27.963.771)	19.432.810	5.969.663	257.209.188
		84.385.609	3.876.879	38.604.622	(19.419.539)	22.472.352	7.637.456	886.796.182
Gastos								
Comisión de gestión	5	4.071.871	1.217.514	2.224.111	3.099.492	3.129.728	1.330.694	96.377.003
Comisión de asesoría	5	—	—	—	—	—	—	4.530.690
Comisión de distribución	5	77.606	15.164	178.970	478.434	110.231	3.303	3.821.100
Comisión de administración	5	309.514	98.095	177.110	330.477	207.708	95.740	9.007.088
Comisión de compromiso	16	118.273	15.284	28.896	38.387	48.703	25.102	2.161.113
Comisión de depósito	5	12.665	5.767	5.784	5.723	5.737	5.761	1.317.822
Comisión del Depositario	5	23.948	3.779	6.973	9.078	12.398	6.557	621.856
Honorarios profesionales	7	123.552	43.214	77.588	87.950	83.806	43.415	3.446.509
Honorarios de los Consejeros	6	1.648	1.640	1.681	1.634	1.614	1.624	85.500
Comisión de rentabilidad	5	—	138.911	—	—	—	—	1.129.013
Costes de transacciones	7	484.376	48.830	110.487	242.947	111.071	55.068	8.328.307
Honorarios de auditoría	7	5.423	5.278	5.664	6.044	5.509	4.997	295.688
Reembolso de IVA		(6.512)	(717)	(1.435)	(1.900)	(2.321)	(1.185)	(104.403)
Otros gastos	7	7.818	4.383	4.704	5.253	5.235	19.063	614.249
Gastos no asumidos	5	—	—	—	—	—	—	(1.451.429)
Renuncia a la comisión de asesoría	5	—	—	—	—	—	—	(9.406)
Gastos totales		5.230.182	1.597.142	2.820.533	4.303.519	3.719.419	1.590.139	130.170.700
Costes financieros								
Gastos por intereses		—	203	59	—	—	—	166.482
Repartos de dividendos abonados	1	15.934.212	91.812	10.296	1.978.486	—	—	184.288.900
		15.934.212	92.015	10.355	1.978.486	—	—	184.455.382
Impuestos retenidos en origen		4.882.865	292.328	555.158	1.941.504	714.386	294.415	14.763.568
Impuesto sobre las plusvalías		—	—	—	—	—	—	722.183
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		58.338.350	1.895.394	35.218.576	(27.643.048)	18.038.547	5.752.902	556.684.349

Únicamente se generaron ingresos y gastos de las operaciones continuas, salvo en el caso de Absolute Return Multi Strategy, Global Diversified Income FMP – 2024 y Macro Opportunities FX, que se liquidaron el 20 de diciembre de 2021, el 28 de junio de 2024 y el 8 de febrero de 2024, respectivamente. No existen ganancias y pérdidas reconocidas en el periodo financiero distintas de las que constan en la Cuenta de pérdidas y ganancias consolidada.

* Las Cuentas consolidadas se han ajustado para tener en cuenta las inversiones cruzadas entre Carteras. La información sobre inversiones cruzadas entre Carteras se recoge en la nota 8 de las Notas a las cuentas abreviadas no auditadas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Cuentas de pérdidas y ganancias (cont.)

		5G Connectivity	Absolute Return	China A-	China Bond	China Equity	CLO Income	Commodities	Corporate Hybrid
		Semestre finalizado	Semestre finalizado	Share Equity	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Bond
		el	el	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado
Nota		30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de
		2023	2023*	2023	2023	2023	2023	2023	2023
		USD	USD	CNY	CNY	USD	USD	USD	EUR
Ingresos									
Ingresos por intereses		708.077	2.250	49	7.232.460	50.537	7.589.008	1.225.148	36.107.542
Ingresos por dividendos		2.394.114	13.148	214.795	—	4.181.209	217.245	—	—
Ingresos varios		—	1.832	—	—	—	—	—	—
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		209.834.008	(17.230)	(711.393)	31.770.361	(31.713.085)	5.010.161	(6.897.537)	4.697.512
		212.936.199	—	(496.549)	39.002.821	(27.481.339)	12.816.414	(5.672.389)	40.805.054
Gastos									
Comisión de gestión	5	7.049.822	—	72.941	155.200	1.835.198	379.682	165.439	5.689.682
Comisión de distribución	5	310.464	—	—	—	99	—	1.232	100.046
Comisión de administración	5	271.063	—	80.572	239.700	87.421	43.932	31.756	384.653
Comisión de compromiso	16	95.433	—	1.044	17.387	19.662	8.985	6.895	123.931
Comisión de depósito	5	63.226	—	38.110	130.146	37.867	5.689	5.580	62.530
Comisión del Depositario	5	25.215	—	405	11.480	7.687	3.347	2.311	43.848
Honorarios profesionales	7	91.925	—	143.791	204.648	52.360	25.345	17.720	83.514
Honorarios de los Consejeros	6	2.400	—	15.245	14.814	2.447	2.258	2.328	2.050
Costes de transacciones	7	1.254.317	—	62.617	131.408	243.310	26.170	13.032	43.832
Honorarios de auditoría	7	4.858	—	31.888	26.760	4.564	4.676	5.227	4.819
Reembolso de IVA		(2.234)	—	(40)	(2.085)	(742)	(404)	(302)	(8.051)
Otros gastos	7	22.147	—	16.205	112.507	10.582	1.005	1.535	4.597
Gastos no asumidos	5	—	—	(352.629)	(289.561)	—	—	—	—
Gastos totales		9.188.636	—	110.149	752.404	2.300.455	500.685	252.753	6.535.451
Costes financieros									
Gastos por intereses		641	—	—	8.303	—	—	—	136.188
Repartos de dividendos abonados	1	—	—	15.082	137.148	3.216	5.413.500	—	8.023.661
		641	—	15.082	145.451	3.216	5.413.500	—	8.159.849
Impuestos retenidos en origen		527.142	—	21.220	5.743	279.784	—	—	—
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		203.219.780	—	(643.000)	38.099.223	(30.064.794)	6.902.229	(5.925.142)	26.109.754

* Absolute Return Multi Strategy se liquidó el 20 de diciembre de 2021.

Cuentas de pérdidas y ganancias (cont.)

		Emerging Market Debt - Hard Currency	Emerging Market Debt - Local Currency	Emerging Market Debt Blend	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Emerging Markets Equity	Emerging Markets Select Equity	Euro Bond	Euro Bond Absolute Return
	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 EUR	Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 EUR
Ingresos									
Ingresos por intereses		72.179.288	37.580.057	13.321.574	1.304.157	118.430	56.878	143.081	668.520
Ingresos por dividendos		–	113.951	75.335	–	1.786.378	1.046.958	–	–
Ingresos varios		–	832.193	185.553	3.693	131	4.061	1.183	2.891
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		61.016.046	73.227.074	18.916.573	(607.068)	8.032.589	2.337.756	185.227	(113.093)
		133.195.334	111.753.275	32.499.035	700.782	9.937.528	3.445.653	329.491	558.318
Gastos									
Comisión de gestión	5	9.383.425	4.423.000	1.606.572	145.046	779.682	406.099	16.560	25.668
Comisión de distribución	5	128.406	116.918	13.881	–	23.323	–	–	–
Comisión de administración	5	636.474	400.452	204.271	47.499	111.957	31.626	21.425	33.684
Comisión de compromiso	16	173.309	90.481	33.745	3.868	12.855	6.234	639	3.174
Comisión de depósito	5	88.161	434.480	83.125	6.088	62.548	26.629	5.580	5.524
Comisión del Depositario	5	62.342	31.594	11.760	1.460	3.933	2.390	237	1.190
Honorarios profesionales	7	131.406	117.539	62.035	18.551	67.467	31.002	14.656	16.862
Honorarios de los Consejeros	6	2.432	2.384	2.334	2.424	2.421	2.427	2.252	2.253
Costes de transacciones	7	167.037	314.790	157.104	34.816	538.001	162.200	8.431	17.553
Honorarios de auditoría	7	4.488	4.740	5.243	5.085	4.256	4.774	3.925	3.960
Reembolso de IVA		(11.092)	(5.982)	(2.112)	(217)	(695)	(419)	(43)	(216)
Otros gastos	7	5.039	16.189	15.483	2.821	2.822	2.758	2.825	2.841
Gastos no asumidos	5	–	(52.448)	(4.691)	(57.102)	(123.252)	–	(48.444)	(32.670)
Gastos totales		10.771.427	5.894.137	2.188.750	210.339	1.485.318	675.720	28.043	79.823
Costes financieros									
Gastos por intereses		767	35.706	8.636	78	539	–	8	1.176
Repartos de dividendos abonados	1	17.257.280	10.217.619	2.192.115	–	211.792	–	96.302	76
		17.258.047	10.253.325	2.200.751	78	212.331	–	96.310	1.252
Impuestos retenidos en origen		–	356.428	12.508	11.976	195.699	132.528	–	–
Impuesto sobre las plusvalías		–	673.345	96.371	13.795	180.671	87.263	–	–
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		105.165.860	94.576.040	28.000.655	464.594	7.863.509	2.550.142	205.138	477.243

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Cuentas de pérdidas y ganancias (cont.)

		European High Yield Bond	European Sustainable Equity	Event Driven	Global Bond	Global Diversified Income FMP – 2024	Global Equity Megatrends	Global Flexible Credit Income	Global High Yield SDG Engagement
		Semestre finalizado el	Semestre finalizado el	Semestre finalizado el	Semestre finalizado el	Semestre finalizado el	Semestre finalizado el	Semestre finalizado el	Semestre finalizado el
	Nota	30 de junio de 2023 EUR	30 de junio de 2023 EUR	30 de junio de 2023 USD	30 de junio de 2023 USD	30 de junio de 2023 USD	30 de junio de 2023 USD	30 de junio de 2023 USD	30 de junio de 2023 USD
Ingresos									
Ingresos por intereses		1.351.236	29.487	213.608	2.511.947	3.484.238	23.886	10.847.451	13.724.612
Ingresos por dividendos		–	2.089.868	–	–	–	573.655	12.914	–
Ingresos varios		–	–	–	4.311	–	6.970	97	3.578
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		397.944	21.509.454	3.595.406	(45.955)	1.094.703	12.702.921	16.539.736	2.309.957
		1.749.180	23.628.809	3.809.014	2.470.303	4.578.941	13.307.432	27.400.198	16.038.147
Gastos									
Comisión de gestión	5	32.889	277.005	147.300	3.716	451.201	613.815	776.349	835.729
Comisión de distribución	5	1.935	147	–	2.665	–	122.385	24.275	3.629
Comisión de administración	5	45.120	47.016	22.237	74.733	48.916	57.629	99.038	138.787
Comisión de compromiso	16	3.140	11.163	1.749	9.703	11.044	6.033	24.861	28.103
Comisión de depósito	5	5.331	9.287	4.542	5.477	5.951	5.703	7.922	6.087
Comisión del Depositario	5	1.333	4.402	706	3.495	3.981	2.267	8.681	11.806
Honorarios profesionales	7	27.529	23.829	27.304	29.865	30.609	18.538	36.591	37.498
Honorarios de los Consejeros	6	2.035	2.112	1.923	2.429	2.246	2.439	2.317	2.252
Comisión de rentabilidad	5	–	–	211.938	–	–	–	–	–
Costes de transacciones	7	9.902	49.203	4.831	32.322	3.038	20.639	37.159	65.522
Honorarios de auditoría	7	4.318	4.036	5.098	4.415	4.713	4.529	4.958	4.576
Reembolso de IVA		(212)	(547)	(211)	(614)	(382)	(230)	(849)	(1.577)
Otros gastos	7	2.642	2.474	2.672	2.385	2.894	13.107	3.365	3.593
Gastos no asumidos	5	(44.351)	–	(22.212)	(9.385)	–	–	–	(32.415)
Renuncia a la comisión de asesoría	5	–	–	–	–	–	–	(701)	–
Gastos totales		91.611	430.127	407.877	161.206	564.211	866.854	1.023.966	1.103.590
Costes financieros									
Gastos por intereses		2	–	127	20	–	26	–	6
Repartos de dividendos abonados	1	11.380	1.048.292	–	1.109	1.932.504	–	9.063	148.757
		11.382	1.048.292	127	1.129	1.932.504	26	9.063	148.763
Impuestos retenidos en origen		1.915	369.229	4.281	19.816	1.695	87.327	26.804	–
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		1.644.272	21.781.161	3.396.729	2.288.152	2.080.531	12.353.225	26.340.365	14.785.794

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Cuentas de pérdidas y ganancias (cont.)

		Global High Yield Sustainable Action Semestre finalizado el	Global Investment Grade Credit Semestre finalizado el	Global Opportunistic Bond Semestre finalizado el	Global Real Estate Securities Semestre finalizado el	Global Sustainable Equity Semestre finalizado el	Global Sustainable Value Semestre finalizado el	High Yield Bond Semestre finalizado el	InnovAsia 5G Semestre finalizado el
	Nota	30 de junio de 2023* USD	30 de junio de 2023 USD	30 de junio de 2023 USD	30 de junio de 2023 USD	30 de junio de 2023 USD	30 de junio de 2023 USD	30 de junio de 2023 USD	30 de junio de 2023 USD
Ingresos									
Ingresos por intereses		380.455	1.693.072	1.452.317	27.424	30.199	7.013	75.652.442	14.435
Ingresos por dividendos		—	—	4.090	723.396	833.357	857.017	697.828	79.819
Ingresos varios		47	—	29.537	—	—	3.964	323.809	—
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		302.666	1.077.872	495.428	(47.627)	19.966.585	3.309.467	20.518.228	3.399.353
		683.168	2.770.944	1.981.372	703.193	20.830.141	4.177.461	97.192.307	3.493.607
Gastos									
Comisión de gestión	5	36.223	23.614	55.110	124.243	188.507	58.102	9.987.791	84.920
Comisión de distribución	5	—	—	—	9.543	1.764	2.067	908.028	165
Comisión de administración	5	70.047	39.390	69.879	33.056	48.564	29.364	772.201	26.255
Comisión de compromiso	16	1.194	7.105	4.742	2.338	8.550	2.714	155.346	1.013
Comisión de depósito	5	6.000	5.942	5.697	5.951	5.951	5.785	15.995	5.808
Comisión del Depositario	5	462	2.154	1.669	906	3.548	1.204	56.815	218
Honorarios profesionales	7	38.938	16.547	23.495	28.288	28.885	31.643	181.785	40.955
Honorarios de los Consejeros	6	2.387	2.102	2.253	2.236	2.238	2.298	2.338	2.007
Costes de transacciones	7	2.818	2.063	32.610	49.744	18.200	73.660	136.448	73.810
Honorarios de auditoría	7	10.617	5.716	4.904	4.726	4.710	4.522	6.465	5.734
Reembolso de IVA		(44)	(249)	(338)	(170)	(338)	(219)	(6.839)	(42)
Otros gastos	7	5.121	1.030	3.600	2.971	1.158	2.722	5.803	2.220
Gastos no asumidos	5	(122.957)	(20.390)	(65.637)	(44.740)	—	(45.185)	—	(101.872)
Renuncia a la comisión de asesoría	5	—	—	(222)	—	—	—	(37.869)	—
Gastos totales		50.806	85.024	137.762	219.092	311.737	168.677	12.184.307	141.191
Costes financieros									
Gastos por intereses		25	101	68	—	649	211	—	—
Repartos de dividendos abonados	1	289.047	—	143.211	140.153	—	—	43.826.657	—
		289.072	101	143.279	140.153	649	211	43.826.657	—
Impuestos retenidos en origen		—	—	1.939	137.925	227.315	172.475	254.577	9.673
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		343.290	2.685.819	1.698.392	206.023	20.290.440	3.836.098	40.926.766	3.342.743

* Global High Yield Sustainable Action se liquidó el 16 de junio de 2023.

Cuentas de pérdidas y ganancias (cont.)

		Japan Equity Engagement Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 JPY	Macro Opportunities FX Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 EUR	Multi-Asset Income Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Next Generation Mobility Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Next Generation Space Economy Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Responsible Asian Debt - Hard Currency Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Short Duration Emerging Market Debt Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Short Duration High Yield SDG Engagement Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD
	Nota								
Ingresos									
Ingresos por intereses		—	100.878	143.181	238.086	9.480	926.410	103.141.171	19.740.389
Ingresos por dividendos		225.363.637	—	76.971	878.990	67.976	—	—	46.575
Ingresos varios		—	—	185	—	—	1.046	—	47.823
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		4.242.762.887	(1.146.642)	122.546	33.472.595	1.727.044	148.134	14.940.138	(7.515.909)
		4.468.126.524	(1.045.764)	342.883	34.589.671	1.804.500	1.075.590	118.081.309	12.318.878
Gastos									
Comisión de gestión	5	35.481.710	75.149	65.813	1.107.812	45.208	14.782	13.525.302	2.055.746
Comisión de distribución	5	—	—	15.904	182.960	6.835	2.132	362.688	56.819
Comisión de administración	5	5.850.914	30.852	85.816	68.262	12.251	32.249	1.016.745	190.804
Comisión de compromiso	16	1.465.972	2.167	746	10.909	693	2.154	342.360	41.696
Comisión de depósito	5	1.231.491	5.744	6.569	5.304	5.730	5.973	187.271	6.112
Comisión del Depositario	5	537.464	792	368	4.029	134	1.038	124.180	15.909
Honorarios profesionales	7	2.805.402	20.107	55.886	32.611	24.602	22.773	214.731	73.295
Honorarios de los Consejeros	6	310.557	2.080	2.450	2.433	2.341	2.208	2.405	2.421
Costes de transacciones	7	14.704.177	22.954	48.717	27.620	11.703	5.416	76.146	37.392
Honorarios de auditoría	7	549.772	4.353	11.145	5.071	6.812	4.856	5.402	5.304
Reembolso de IVA		(67.540)	(90)	(47)	(655)	(32)	(211)	(22.608)	(2.733)
Otros gastos	7	383.450	3.135	9.532	5.399	740	2.719	7.959	3.777
Gastos no asumidos	5	—	(58.267)	(206.453)	—	(52.532)	(44.375)	—	—
Renuncia a la comisión de asesoría	5	—	—	—	—	—	—	—	(2.527)
Gastos totales		63.253.369	108.976	96.446	1.451.755	64.485	51.714	15.842.581	2.484.015
Costes financieros									
Gastos por intereses		—	195	1.058	—	—	49	22.571	—
Repartos de dividendos abonados	1	111.381.658	5	4.025	—	—	375.286	27.272.467	2.729.818
		111.381.658	200	5.083	—	—	375.335	27.295.038	2.729.818
Impuestos retenidos en origen		33.921.407	—	7.319	154.852	7.945	24	—	6.018
Impuesto sobre las plusvalías		—	—	709	—	—	—	—	—
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		4.259.570.090	(1.154.940)	233.326	32.983.064	1.732.070	648.517	74.943.690	7.099.027

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Cuentas de pérdidas y ganancias (cont.)

		Strategic Income	Sustainable Asia	Sustainable	Sustainable		Ultra Short Term	Uncorrelated	Uncorrelated
		Semestre finalizado	Semestre finalizado	Emerging Market	Emerging Market	Tactical Macro	Euro Bond	Strategies	Trading
		el	el	Corporate Debt	Debt - Hard	el	el	el	el
		30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de
		2023	2023	2023	2023	2023*	2023	2023	2023**
		USD	USD	USD	USD	USD	EUR	USD	USD
Ingresos									
Ingresos por intereses		31.064.030	917.330	2.537.550	5.877.340	1.333	9.761.262	20.162.574	3.568.239
Ingresos por dividendos		28.176	—	—	—	—	—	—	—
Ingresos varios		119.770	—	—	—	—	43.432	—	8.248
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(4.695.469)	(433.446)	1.262.661	5.520.039	—	5.647.618	(103.720.069)	(12.686.374)
		26.516.507	483.884	3.800.211	11.397.379	1.333	15.452.312	(83.557.495)	(9.109.887)
Gastos									
Comisión de gestión	5	4.750.284	4.463	346.500	448.124	—	628.851	19.704.011	2.845.723
Comisión de distribución	5	487.344	—	14.761	—	—	936	84.068	—
Comisión de administración	5	462.404	26.622	65.509	59.198	—	202.483	1.428.365	347.786
Comisión de compromiso	16	95.410	2.399	6.181	16.222	—	52.962	201.105	54.101
Comisión de depósito	5	18.410	5.716	5.933	5.692	—	33.409	160.166	62.274
Comisión del Depositario	5	35.510	756	2.393	5.754	—	20.854	139.287	45.183
Honorarios profesionales	7	82.872	40.403	50.173	21.729	—	41.597	313.720	68.646
Honorarios de los Consejeros	6	2.385	2.403	2.421	2.318	—	2.078	2.318	2.397
Costes de transacciones	7	155.360	8.302	21.211	24.446	—	44.854	9.693.000	1.040.743
Honorarios de auditoría	7	10.373	4.288	4.974	5.141	—	4.414	4.530	9.096
Reembolso de IVA		(6.275)	(83)	(440)	(1.050)	—	(3.714)	(8.044)	(1.707)
Otros gastos	7	4.601	2.311	2.427	1.762	—	3.386	2.638.950	287.209
Gastos no asumidos	5	—	(69.080)	(76.526)	(6.420)	—	—	—	(155.312)
Renuncia a la comisión de asesoría	5	(1.529)	—	—	—	—	—	—	—
Gastos totales		6.097.149	28.500	445.517	582.916	—	1.032.110	34.361.476	4.606.139
Costes financieros									
Gastos por intereses		2.516	—	1.353	92	—	—	77.487	83.462
Repartos de dividendos abonados	1	8.040.452	187.353	98.923	—	—	14.618	—	—
		8.042.968	187.353	100.276	92	—	14.618	77.487	83.462
Impuestos retenidos en origen		236.777	1.827	196	121.222	—	—	5.314.284	366.026
Impuesto sobre las plusvalías		9.919	—	—	—	—	—	—	—
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		12.129.694	266.204	3.254.222	10.693.149	1.333	14.405.584	(123.310.742)	(14.165.514)

* Tactical Macro se lanzó el 30 de junio de 2023.

** Uncorrelated Trading se liquidó el 24 de mayo de 2023.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Cuentas de pérdidas y ganancias (cont.)

		US Equity	US Equity Index	US Large Cap Value	US Long Short	US Multi Cap	US Real Estate	US Small Cap	US Small Cap
		Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado
		el	el	el	el	el	el	el	el
Nota	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de
	2023	2023	2023	2023	2023	2023	2023	2023	2023
	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Ingresos									
Ingresos por intereses		40.612	2.436.978	1.636.743	1.109.734	35.692	489.958	231.380	476.416
Ingresos por dividendos		157.055	—	23.918.038	1.084.012	2.480.438	11.307.531	2.871.389	795.985
Ingresos varios		—	—	—	—	—	—	61	—
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		4.777.206	79.192.712	(46.458.604)	15.671.790	48.684.450	7.974.525	69.246.916	18.972.106
		4.974.873	81.629.690	(20.903.823)	17.865.536	51.200.580	19.772.014	72.349.746	20.244.507
Gastos									
Comisión de gestión	5	119.556	1.382.114	5.145.192	1.463.065	2.593.881	4.088.051	3.014.213	1.002.700
Comisión de distribución	5	3.470	5.969	173.028	17.201	219.236	649.075	90.952	2.589
Comisión de administración	5	21.642	168.013	375.561	87.727	179.950	414.454	197.305	71.148
Comisión de compromiso	16	2.120	41.531	134.969	18.558	28.976	41.751	43.798	15.076
Comisión de depósito	5	5.999	5.678	9.917	5.951	5.758	5.608	6.068	6.002
Comisión del Depositario	5	863	15.880	45.424	5.554	10.638	15.180	15.617	6.012
Honorarios profesionales	7	17.155	55.189	48.720	39.759	68.640	85.356	75.800	27.131
Honorarios de los Consejeros	6	2.298	2.102	2.414	2.310	2.384	2.355	2.421	2.406
Costes de transacciones	7	8.884	56.553	529.375	59.729	117.636	230.287	144.064	50.248
Honorarios de auditoría	7	3.984	4.726	4.572	4.910	4.911	4.934	4.571	4.720
Reembolso de IVA		(153)	(3.054)	(6.768)	(984)	(1.900)	(2.751)	(2.656)	(964)
Otros gastos	7	2.807	3.246	5.442	5.186	3.120	3.811	3.878	12.724
Gastos no asumidos	5	(24.406)	—	—	—	—	—	—	—
Gastos totales		164.219	1.737.947	6.467.846	1.708.966	3.233.230	5.538.111	3.596.031	1.199.792
Costes financieros									
Gastos por intereses		60	—	—	20	754	—	—	—
Repartos de dividendos abonados	1	—	572.069	10.005.740	52.784	12.800	2.527.684	—	—
		60	572.069	10.005.740	52.804	13.554	2.527.684	—	—
Impuestos retenidos en origen		45.361	—	6.326.595	303.537	709.742	2.844.622	806.856	208.701
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		4.765.233	79.319.674	(43.704.004)	15.800.229	47.244.054	8.861.597	67.946.859	18.836.014

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Cuentas de pérdidas y ganancias (cont.)

	Nota	Total Sociedad* Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD
Ingresos		
Ingresos por intereses		492.034.830
Ingresos por dividendos		61.268.982
Ingresos varios		1.628.215
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		613.804.874
		1.168.736.901
Gastos		
Comisión de gestión	5	110.862.235
Comisión de distribución	5	4.155.184
Comisión de administración	5	9.623.762
Comisión de compromiso	16	2.043.091
Comisión de depósito	5	1.603.114
Comisión del Depositario	5	823.786
Honorarios profesionales	7	2.922.417
Honorarios de los Consejeros	6	125.151
Comisión de rentabilidad	5	211.938
Costes de transacciones	7	16.158.911
Honorarios de auditoría	7	282.577
Reembolso de IVA		(114.120)
Otros gastos	7	3.185.550
Gastos no asumidos	5	(1.627.902)
Renuncia a la comisión de asesoría	5	(42.848)
Gastos totales		150.212.846
Costes financieros		
Gastos por intereses		386.788
Repartos de dividendos abonados	1	144.436.302
Total costes financieros		144.823.090
Impuestos retenidos en origen		20.575.993
Impuesto sobre las plusvalías		1.062.073
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		852.062.899

Únicamente se generaron ingresos y gastos de las operaciones continuas, salvo en el caso de Absolute Return Multi Strategy, Global High Yield Sustainable Action y Uncorrelated Trading, que se liquidaron el 20 de diciembre de 2021, el 16 de junio de 2023 y el 24 de mayo de 2023, respectivamente. No existen ganancias y pérdidas reconocidas en el periodo financiero distintas de las que constan en la Cuenta de pérdidas y ganancias consolidada.

* Las Cuentas consolidadas se han ajustado para tener en cuenta las inversiones cruzadas entre Carteras. La información sobre inversiones cruzadas entre Carteras se recoge en la nota 8 de las Notas a las cuentas abreviadas no auditadas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Estados de variaciones del Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables

	5G Connectivity Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Absolute Return Multi Strategy Semestre finalizado el 30 de junio de 2024* USD	China A-Share Equity Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 CNY	China Bond Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 CNY	China Equity Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Climate Innovation Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	CLO Income Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Commodities Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	1.043.526.943	—	14.213.832	458.846.108	178.226.287	2.922.555	185.646.305	153.646.559
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	274.986.378	—	233.245	14.143.694	8.155.835	261.038	17.613.863	8.705.603
Suscripciones	198.299.422	—	—	1.382.999	435.983	—	268.229.125	40.753.463
Reembolsos	(342.080.251)	—	—	(284.471.196)	(46.380.825)	—	(29.624.382)	(37.679.035)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	1.174.732.492	—	14.447.077	189.901.605	140.437.280	3.183.593	441.864.911	165.426.590

	Corporate Hybrid Bond Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 EUR	Developed Market FMP – 2027 Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Emerging Market Debt - Hard Currency Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Emerging Market Debt - Local Currency Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Emerging Market Debt Blend Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Emerging Markets Equity Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Euro Bond Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 EUR
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	1.869.816.463	137.457.819	2.649.818.655	1.285.867.647	526.787.807	65.067.549	90.687.501	10.573.094
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	73.121.934	1.282.825	73.129.668	(64.860.770)	(12.909.074)	(2.527.831)	14.457.150	(41.593)
Suscripciones	437.846.514	—	506.009.446	83.280.628	32.630.803	3.234.291	32.563.968	3.582.148
Reembolsos	(326.186.662)	(2.004.889)	(589.798.337)	(175.193.553)	(47.795.627)	(2.317.413)	(23.786.066)	(43.053)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	2.054.598.249	136.735.755	2.639.159.432	1.129.093.952	498.713.909	63.456.596	113.922.553	14.070.596

* Absolute Return Multi Strategy se liquidó el 20 de diciembre de 2021.

Estados de variaciones del Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables (cont.)

	Euro Bond Absolute Return Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 EUR	European High Yield Bond Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 EUR	European Sustainable Equity Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 EUR	Event Driven Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Global Bond Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Global Diversified Income FMP – 2024 Semestre finalizado el 30 de junio de 2024* USD	Global Equity Megatrends Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Global Flexible Credit Income Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	34.026.827	408.416.317	172.097.551	126.412.148	108.742.800	156.199.653	144.482.856	390.612.981
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	2.440.029	17.720.122	8.229.276	3.706.366	(3.024.357)	1.838.691	23.680.265	12.045.130
Suscripciones	16.800.900	115.804.496	1.605.657	61.583.267	9.683.466	14.729	95.110.288	29.489.704
Reembolsos	–	(27.172.976)	(30.495.056)	(53.010.383)	(3.928.923)	(158.053.073)	(24.868.826)	(19.259.760)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	53.267.756	514.767.959	151.437.428	138.691.398	111.472.986	–	238.404.583	412.888.055

	Global High Yield SDG Engagement Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Global Investment Grade Credit Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Global Opportunistic Bond Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Global Real Estate Securities Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Global Sustainable Equity Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Global Sustainable Value Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	High Yield Bond Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	InnovAsia 5G Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	558.163.905	86.777.825	65.409.763	20.460.013	154.573.295	55.465.894	2.251.810.719	23.770.120
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	8.043.920	974.012	(188.368)	(1.350.035)	10.033.997	4.163.760	(3.699.244)	1.796.826
Suscripciones	124.729.356	–	2.316.077	3.249.507	9.586.847	25.766.780	187.531.751	614.925
Reembolsos	(57.058.565)	–	(832.995)	(2.403.043)	(15.184.012)	(7.459.553)	(263.914.226)	(4.538.450)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	633.878.616	87.751.837	66.704.477	19.956.442	159.010.127	77.936.881	2.171.729.000	21.643.421

* Global Diversified Income FMP – 2024 se liquidó el 28 de junio de 2024.

Estados de variaciones del Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables (cont.)

	Japan Equity Engagement Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 JPY	Macro Opportunities FX Semestre finalizado el 30 de junio de 2024* EUR	Next Generation Mobility Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Next Generation Space Economy Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Responsible Asian Debt - Hard Currency Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Short Duration Emerging Market Debt Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Short Duration High Yield SDG Engagement Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Strategic Income Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	16.177.528.715	2.881.806	164.356.065	19.743.930	63.941.864	3.954.769.567	744.434.447	2.019.603.581
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	1.866.825.387	10.036	12.197.485	1.999.869	1.636.132	(25.835.038)	(13.607.769)	(53.057.099)
Suscripciones	1.287.669.706	40.978	10.963.460	11.209.035	3.093	536.011.003	104.089.866	1.524.790.998
Reembolsos	(1.190.819.894)	(2.932.820)	(38.684.306)	(946.154)	(548.870)	(693.821.955)	(138.076.548)	(496.321.560)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	18.141.203.914	—	148.832.704	32.006.680	65.032.219	3.771.123.577	696.839.996	2.995.015.920

	Sustainable Asia High Yield Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Sustainable Emerging Market Corporate Debt Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Tactical Macro Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	Ultra Short Term Euro Bond Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 EUR	Uncorrelated Strategies Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	US Equity Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD	US Equity Index PutWrite Semestre finalizado el 30 de junio de 2024 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	28.564.951	97.789.137	445.892.270	27.162.308	992.872.298	1.626.701.421	49.202.149	729.098.000
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	2.115.180	422.129	1.715.385	598.445	34.524.675	(52.109.612)	4.176.806	50.083.199
Suscripciones	6.626	25.859.645	134.082.284	5.886.049	373.340.980	137.058.418	48.003.923	176.125.821
Reembolsos	(481.535)	(6.321.872)	(5.070.757)	(238.523)	(201.239.954)	(818.939.841)	(27.598.655)	(244.233.444)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	30.205.222	117.749.039	576.619.182	33.408.279	1.199.497.999	892.710.386	73.784.223	711.073.576

* Macro Opportunities FX se liquidó el 8 de febrero de 2024.

Estados de variaciones del Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables (cont.)

	US Large Cap Value	US Long Short	US Multi Cap	US Real Estate	US Small Cap	US Small Cap	Total Sociedad*
	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado	Semestre finalizado
	el	el	el	el	el	el	el
Nota	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de	30 de junio de
	2024	2024	2024	2024	2024	2024	2024
	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	1.939.190.378	195.470.291	400.492.035	533.109.985	633.851.769	321.568.617	28.324.332.756
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	58.338.350	1.895.394	35.218.576	(27.643.048)	18.038.547	5.752.902	556.684.349
Variación de los tipos de cambio	12	-	-	-	-	-	(136.473.532)
Suscripciones	159.921.481	29.843.321	53.828.614	34.147.012	156.674.133	36.382.381	5.921.077.223
Reembolsos	(1.169.361.960)	(30.271.106)	(146.863.733)	(115.055.845)	(203.967.955)	(29.740.793)	(6.663.895.640)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	988.088.249	196.937.900	342.675.492	424.558.104	604.596.494	333.963.107	28.001.725.156

* Las Cuentas consolidadas se han ajustado para tener en cuenta las inversiones cruzadas entre Carteras. La información sobre inversiones cruzadas entre Carteras se recoge en la nota 8 de las Notas a las cuentas abreviadas no auditadas.

Estados de variaciones del Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables (cont.)

	5G Connectivity Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Absolute Return Multi Strategy Semestre finalizado el 30 de junio de 2023* USD	China A-Share Equity Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 CNY	China Bond Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 CNY	China Equity Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	CLO Income Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Commodities Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Corporate Hybrid Bond Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 EUR
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	993.010.193	–	16.241.758	453.043.579	317.413.676	138.037.464	85.997.429	1.782.154.808
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	203.219.780	–	(643.000)	38.099.223	(30.064.794)	6.902.229	(5.925.142)	26.109.754
Suscripciones	51.386.945	–	–	598.358	26.675	15.732.390	33.061.808	256.495.170
Reembolsos	(196.387.817)	–	–	(23.829.851)	(12.379.775)	(15.930.050)	(5.238.465)	(344.369.994)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	1.051.229.101	–	15.598.758	467.911.309	274.995.782	144.742.033	107.895.630	1.720.389.738

	Emerging Market Debt - Hard Currency Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Emerging Market Debt - Local Currency Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Emerging Market Debt Blend Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Emerging Markets Equity Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Emerging Markets Select Equity Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Euro Bond Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 EUR	Euro Bond Absolute Return Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 EUR
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	2.491.704.928	1.386.264.443	470.181.480	54.274.381	191.807.755	93.762.122	9.294.742	48.527.876
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	105.165.860	94.576.040	28.000.655	464.594	7.863.509	2.550.142	205.138	477.243
Suscripciones	454.361.872	108.440.639	48.821.292	8.312.942	63.717.088	859.976	99.409	691.146
Reembolsos	(559.230.440)	(324.700.553)	(54.892.425)	(712.984)	(144.187.946)	(403.822)	–	(1.522.019)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	2.492.002.220	1.264.580.569	492.111.002	62.338.933	119.200.406	96.768.418	9.599.289	48.174.246

* Absolute Return Multi Strategy se liquidó el 20 de diciembre de 2021.

Estados de variaciones del Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables (cont.)

	European High Yield Bond Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 EUR	European Sustainable Equity Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 EUR	Event Driven Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Global Bond Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Global Diversified Income FMP – 2024 Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Global Equity Megatrends Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Global Flexible Credit Income Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Global High Yield SDG Engagement Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	32.454.528	175.854.230	41.446.672	134.811.296	160.396.086	79.344.365	394.526.329	336.953.378
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	1.644.272	21.781.161	3.396.729	2.288.152	2.080.531	12.353.225	26.340.365	14.785.794
Suscripciones	48.375.701	17.658.480	53.340.583	7.790.898	18.845	24.472.539	16.246.439	236.711.240
Reembolsos	(3.069.129)	(44.364.569)	(12.051.000)	(8.673.706)	(2.082.977)	(13.405.081)	(92.719.743)	(27.750.058)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	79.405.372	170.929.302	86.132.984	136.216.640	160.412.485	102.765.048	344.393.390	560.700.354

	Global High Yield Sustainable Action Semestre finalizado el 30 de junio de 2023* USD	Global Investment Grade Credit Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Global Opportunistic Bond Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Global Real Estate Securities Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Global Sustainable Equity Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Global Sustainable Value Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	High Yield Bond Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	InnovAsia 5G Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	15.047.068	85.908.642	76.105.443	39.022.420	131.578.199	48.024.441	2.298.751.712	14.748.993
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	343.290	2.685.819	1.698.392	206.023	20.290.440	3.836.098	40.926.766	3.342.743
Suscripciones	—	450.000	4.021.220	1.224.931	12.589.751	3.480.645	318.060.660	3.877.592
Reembolsos	(15.390.358)	(7.534.000)	(14.068.067)	(7.069.882)	(14.209.163)	(9.244.626)	(437.508.730)	(962.573)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	—	81.510.461	67.756.988	33.383.492	150.249.227	46.096.558	2.220.230.408	21.006.755

* Global High Yield Sustainable Action se liquidó el 16 de junio de 2023.

Estados de variaciones del Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables (cont.)

	Japan Equity Engagement Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 JPY	Macro Opportunities FX Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 EUR	Multi-Asset Income Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Next Generation Mobility Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Next Generation Space Economy Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Responsible Asian Debt - Hard Currency Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Short Duration Emerging Market Debt Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Short Duration High Yield SDG Engagement Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	20.542.667.585	31.510.156	11.366.115	148.004.677	8.490.862	21.626.209	5.124.661.750	556.373.679
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	4.259.570.090	(1.154.940)	233.326	32.983.064	1.732.070	648.517	74.943.690	7.099.027
Suscripciones	805.743.700	6.050.887	24.302	11.355.250	3.616.134	50.123.098	518.710.028	354.687.947
Reembolsos	(1.510.255.291)	(6.496.610)	(4.241.159)	(21.456.971)	(115.996)	(10.405.463)	(951.758.863)	(199.975.733)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	24.097.726.084	29.909.493	7.382.584	170.886.020	13.723.070	61.992.361	4.766.556.605	718.184.920

	Strategic Income Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Sustainable Asia High Yield Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Sustainable Emerging Market Corporate Debt Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Tactical Macro Semestre finalizado el 30 de junio de 2023* USD	Ultra Short Term Euro Bond Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 EUR	Uncorrelated Strategies Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	Uncorrelated Trading Semestre finalizado el 30 de junio de 2023** USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	1.322.805.855	31.922.271	98.244.308	158.420.594	-	821.390.067	3.130.486.982	711.942.710
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	12.129.694	266.204	3.254.222	10.693.149	1.333	14.405.584	(123.310.742)	(14.165.514)
Suscripciones	455.304.514	5.943	2.682.037	209.126.718	17.020.000	244.744.474	617.909.134	11.358.695
Reembolsos	(314.733.377)	(3.833.672)	(7.460.731)	(37.942.614)	-	(174.286.130)	(1.343.367.475)	(709.135.891)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	1.475.506.686	28.360.746	96.719.836	340.297.847	17.021.333	906.253.995	2.281.717.899	—

* Tactical Macro se lanzó el 30 de junio de 2023.

** Uncorrelated Trading se liquidó el 24 de mayo de 2023.

Estados de variaciones del Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables (cont.)

	US Equity Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	US Equity Index PutWrite Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	US Large Cap Value Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	US Long Short Equity Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	US Multi Cap Opportunities Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	US Real Estate Securities Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	US Small Cap Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD	US Small Cap Intrinsic Value Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	31.464.829	680.456.738	1.767.954.359	221.529.901	441.315.950	648.025.795	592.378.667	194.041.040
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	4.765.233	79.319.674	(43.704.004)	15.800.229	47.244.054	8.861.597	67.946.859	18.836.014
Suscripciones	2.596.705	112.089.031	518.940.915	34.107.630	49.576.232	46.464.562	75.425.983	82.913.505
Reembolsos	(591.459)	(191.870.566)	(376.752.357)	(49.012.904)	(124.605.667)	(144.200.203)	(106.966.673)	(15.243.759)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	38.235.308	679.994.877	1.866.438.913	222.424.856	413.530.569	559.151.751	628.784.836	280.546.800

	Total Sociedad* Semestre finalizado el 30 de junio de 2023 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	29.114.382.221
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	852.062.899
Variación de los tipos de cambio	12 51.504.327
Suscripciones	5.267.098.167
Reembolsos	(7.222.654.626)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	28.062.392.988

* Las Cuentas consolidadas se han ajustado para tener en cuenta las inversiones cruzadas entre Carteras. La información sobre inversiones cruzadas entre Carteras se recoge en la nota 8 de las Notas a las cuentas abreviadas no auditadas.

Informes de compras y ventas significativas (no auditados)

De conformidad con lo previsto por el Reglamento denominado European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations de 2011 (Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios), en su versión vigente, se incluye una relación de los cambios en la composición de la Cartera de inversiones durante el periodo del informe, a fin de que los Accionistas puedan identificar los cambios producidos en las inversiones mantenidas por la Cartera. Las relaciones siguientes presentan las compras y ventas agregadas de valores mobiliarios que superen el 1% del valor total de las compras o ventas, respectivamente, del periodo. Como mínimo, se presentan las 20 compras y las 20 ventas más importantes, siempre que se disponga de dicha información.

5G Connectivity – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
1.067.000	MediaTek Inc	39.520.749
973.400	Advantest Corp	35.397.867
469.960	Vertiv Holdings Co Class A	28.639.260
252.078	ARM Holdings Plc ADR	26.807.918
565.164	DraftKings Inc Class A	24.169.818
1.473.600	SUMCO Corp	23.501.768
197.857	Amphenol Corp Class A	23.276.805
5.602.000	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	22.893.820
999.400	Murata Manufacturing Co Ltd	20.756.750
328.998	Western Digital Corp	20.624.487
94.763	Snowflake Inc Class A	19.118.062
168.281	DoorDash Inc Class A	18.199.160
318.000	Global Unichip Corp	17.693.041
109.536	Take-Two Interactive Software Inc	17.367.920
523.937	Flex Ltd	17.244.910
295.067	Nutanix Inc Class A	16.713.990
6.594.400	Xiaomi Corp Class B	16.473.967
121.687	Dell Technologies Inc Class C	15.615.217
79.683	International Business Machines Corp	15.209.311
147.047	Micron Technology Inc	14.457.663
825.500	Renesas Electronics Corp	14.002.229
109.528	Datadog Inc Class A	13.839.917
21.645	Netflix Inc	13.422.786
663.000	Asia Vital Components Co Ltd	12.759.208
49.500	Tokyo Electron Ltd	12.553.062
156.967	CVS Health Corp	11.971.084
74.296	QUALCOMM Inc	11.694.751
255.140	Celestica Inc	11.478.914
27.915	Intuitive Surgical Inc	11.088.793
191.410	Rambus Inc	10.896.149
184.187	Astera Labs Inc	10.489.317
171.000	Wiwynn Corp	10.414.243

5G Connectivity – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras (cont.):

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
206.064	Ciena Corp	10.399.024
425.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	8.842.925
26.889	Arista Networks Inc	8.161.996
56.708	PDD Holdings Inc ADR	7.853.481
28.548	Salesforce Inc	7.477.304

5G Connectivity – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
399.000	Alchip Technologies Ltd	48.488.444
99.153	Super Micro Computer Inc	48.100.064
81.366	NVIDIA Corp	39.755.312
270.185	Oracle Corp	32.109.222
1.473.600	SUMCO Corp	23.296.912
441.600	TDK Corp	23.221.171
137.655	Advanced Micro Devices Inc	23.096.733
615.300	Juniper Networks Inc	22.960.150
105.999	Atlassian Corp Class A	22.195.594
80.258	Arista Networks Inc	21.831.247
46.700	Keyence Corp	20.601.854
24.581	ServiceNow Inc	18.820.459
28.305	HubSpot Inc	17.759.049
131.462	Dexcom Inc	17.156.936
94.763	Snowflake Inc Class A	16.350.898
174.559	Vertiv Holdings Co Class A	15.961.241
252.837	Nutanix Inc Class A	15.796.433
387.433	Pure Storage Inc Class A	15.451.632
960.000	Novatek Microelectronics Corp	15.394.595
318.000	Global Unichip Corp	13.872.412
100.137	ARM Holdings Plc ADR	13.697.659
15.521	Lam Research Corp	13.447.957
159.500	Sony Group Corp	13.327.389
171.000	Wiwynn Corp	13.319.121
37.600	Disco Corp	12.148.419
153.535	ON Semiconductor Corp	11.913.824
68.605	T-Mobile US Inc	11.339.879
65.064	BE Semiconductor Industries NV	10.929.252
7.752	Broadcom Inc	10.830.285
191.410	Rambus Inc	10.798.790
25.298	Meta Platforms Inc Class A	10.521.042
50.257	Applied Materials Inc	10.515.145
36.538	CrowdStrike Holdings Inc Class A	10.501.861
24.306	Microsoft Corp	9.956.256
15.887	ASM International NV	9.894.902
206.064	Ciena Corp	9.836.417
30.943	Palo Alto Networks Inc	9.600.592
50.840	Apple Inc	8.800.662
156.967	CVS Health Corp	8.732.111
97.346	Astera Labs Inc	8.323.688

China A-Share Equity – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste CNY
17.600	Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A	400.581
8.900	China Merchants Bank Co Ltd Class A	298.179
13.700	HUAYU Automotive Systems Co Ltd Class A	236.910
24.000	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd	229.630
30.000	CMOC Group Ltd Class A	228.280
2.300	Will Semiconductor Co Ltd Shanghai Class A	227.161
9.100	China Yangtze Power Co Ltd Class A	224.389
11.900	Shanghai Huafon Aluminium Corp Class A	206.584
5.800	Ningbo Sanxing Medical Electric Co Ltd Class A	194.925
3.000	Yankershop Food Co Ltd Class A	194.798
5.000	Keymed Biosciences Inc	193.533
12.139	Zhuhai CosMX Battery Co Ltd Class A	190.913
12.422	GemPharmatech Co Ltd Class A	188.425
1.059	Piotech Inc Class A	178.950
14.300	Inner Mongolia ERDOS Resources Co Ltd Class A	178.038
7.900	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd Class A	176.343
10.100	Sinotruk Jinan Truck Co Ltd Class A	176.206
11.200	Guangdong Xinbao Electrical Appliances Holdings Co Ltd Class A	174.778
12.900	COSCO Shipping Energy Transportation Co Ltd Class A	173.345
4.800	Beijing New Building Materials Plc Class A	160.485
2.900	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A	158.509
4.000	Shandong Himile Mechanical Science & Technology Co Ltd Class A	153.478
1.000	Wuliangye Yibin Co Ltd Class A	148.870
6.700	Tongwei Co Ltd Class A	148.335
3.500	Innovent Biologics Inc	148.182
6.000	Shenzhen Sunlord Electronics Co Ltd Class A	147.125
5.300	Shanghai Huace Navigation Technology Ltd Class A	143.939
1.900	Shenzhen Longsys Electronics Co Ltd Class A	142.004
5.000	Victory Giant Technology Huizhou Co Ltd Class A	141.789
3.100	Beijing Tongrentang Co Ltd Class A	139.458
3.200	Hainan Jinpan Smart Technology Co Ltd Class A	138.697
6.000	HUTCHMED China Ltd	137.404
14.200	Tianma Microelectronics Co Ltd Class A	127.342
4.700	Hangcha Group Co Ltd Class A	126.413
833	Anji Microelectronics Technology Shanghai Co Ltd Class A	124.966
2.400	Sieyuan Electric Co Ltd Class A	124.710
2.822	Dizal Jiangsu Pharmaceutical Co Ltd Class A	124.692
4.600	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	123.897
4.800	Hangzhou First Applied Material Co Ltd Class A	123.517
10.200	Zhejiang Xianju Pharmaceutical Co Ltd Class A	121.731

China A-Share Equity – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras (cont.):

Unidades	Descripción de los valores	Coste CNY
2.800	Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co Ltd Class A	116.645
1.100	Huizhou Desay SV Automotive Co Ltd Class A	110.963
1.000	Zhongji Innolight Co Ltd Class A	104.993
3.805	Suzhou Veichi Electric Co Ltd Class A	104.743
4.900	LONGi Green Energy Technology Co Ltd Class A	104.014
2.200	Ping An Insurance Group Co of China Ltd Class A	94.930
6.200	First Tractor Co Ltd Class A	94.914
26.000	Nexteer Automotive Group Ltd	87.815
1.400	Shenzhou International Group Holdings Ltd	86.898

China A-Share Equity – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto CNY
5.100	Shenzhou International Group Holdings Ltd	344.385
10.800	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	337.271
16.400	Yizumi Holdings Co Ltd Class A	333.562
200	Kweichow Moutai Co Ltd Class A	333.274
78.000	China Citic Bank Corp Ltd - H Shares	307.912
4.700	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A	279.149
76.000	Nexteer Automotive Group Ltd	267.597
11.900	Shanghai Huafon Aluminium Corp Class A	231.407
13.700	HUAYU Automotive Systems Co Ltd Class A	225.905
10.500	TongFu Microelectronics Co Ltd Class A	210.153
24.000	China Life Insurance Co Ltd - H Shares	192.501
11.200	Guangdong Xinbao Electrical Appliances Holdings Co Ltd Class A	184.337
3.200	Hainan Jinpan Smart Technology Co Ltd Class A	184.268
12.139	Zhuhai CosMX Battery Co Ltd Class A	176.113
7.200	Chongqing Department Store Co Ltd Class A	175.532
1.800	Sungrow Power Supply Co Ltd Class A	174.813
2.400	Sieyuan Electric Co Ltd Class A	174.115
1.800	Proya Cosmetics Co Ltd Class A	173.940
7.400	NARI Technology Co Ltd Class A	173.813
1.000	Zhongji Innolight Co Ltd Class A	159.825
1.700	Anjoy Foods Group Co Ltd Class A	149.658
800	Luzhou Laojiao Co Ltd Class A	146.427
3.232	Giantec Semiconductor Corp Class A	145.747
4.800	Hangzhou First Applied Material Co Ltd Class A	141.339
12.000	SciClone Pharmaceuticals Holdings Ltd	138.806
1.600	Shenzhen Longsys Electronics Co Ltd Class A	138.182
1.100	Huizhou Desay SV Automotive Co Ltd Class A	136.584
12.000	China Medical System Holdings Ltd	136.437
2.100	Midea Group Co Ltd Class A	134.060
6.800	CITIC Securities Co Ltd Class A	132.260
14.200	Tianma Microelectronics Co Ltd Class A	129.060
18.100	China Construction Bank Corp Class A	126.087
5.200	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd Class A	125.408
28.000	AK Medical Holdings Ltd	120.969
23.500	Shenzhen MTC Co Ltd Class A	119.613
900	Wuliangye Yibin Co Ltd Class A	117.260
400	Tencent Holdings Ltd	103.559
4.900	LONGi Green Energy Technology Co Ltd Class A	98.637
2.200	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd Class A	97.067
7.000	Jinzai Food Group Co Ltd Class A	95.936
1.200	Wuxi Dk Electronic Materials Co Ltd Class A	95.864
3.501	Piesat Information Technology Co Ltd Class A	93.487

China Bond – Informe de compras y ventas significativas

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste CNY
35.500.000	China Government Bond, 2.39%, 15/11/2026	35.677.897
35.000.000	China Government Bond, 2.04%, 25/02/2027	34.951.315
20.000.000	China Government Bond, 2.33%, 15/12/2025	20.091.020
20.000.000	China Development Bank, 2.34%, 05/01/2027	20.074.100
20.000.000	Industrial and Commercial Bank of China Ltd, 0.00%, 09/01/2025	19.523.580
10.000.000	China Development Bank, 2.69%, 16/06/2027	10.098.040
10.000.000	Agricultural Bank of China Ltd, 3.10%, 06/05/2030	10.089.570
1.000.000	Lenovo Group Ltd, 5.83%, 27/01/2028	7.277.770
5.000.000	China Government Bond, 2.37%, 20/01/2027	5.036.335
4.000.000	China Government Bond, 3.19%, 15/04/2053	4.619.620
4.000.000	Agricultural Development Bank of China, 2.74%, 23/02/2027	4.066.268
4.000.000	Agricultural Development Bank of China, 1.76%, 26/02/2025	3.999.676
500.000	Meituan, 0.00%, 27/04/2028	3.249.877
3.000.000	China Government Bond, 1.99%, 15/03/2026	3.002.559
300.000	Melco Resorts Finance Ltd, 5.25%, 26/04/2026	2.111.295
250.000	Fortune Star BVI Ltd, 5.95%, 19/10/2025	1.710.554
200.000	China Overseas Grand Oceans Finance IV Cayman Ltd, 2.45%, 09/02/2026	1.275.569
1.000.000	China Government Bond, 3.00%, 15/10/2053	1.092.934
1.000.000	China Government Bond, 2.00%, 15/06/2025	1.001.988
450.000	China CITIC Bank Corp Ltd, 4.00%, 04/03/2025	543.803

China Bond – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto CNY
39.000.000	China Government Bond, 2.67%, 25/05/2033	39.836.571
35.000.000	China Government Bond, 2.39%, 15/11/2026	35.287.700
30.000.000	China Government Bond, 2.18%, 15/08/2026	30.065.790
20.000.000	China Southern Power Grid Co Ltd, 2.84%, 24/11/2025	20.162.150
20.000.000	China Resources Inc, 2.90%, 22/04/2025	20.127.780
20.000.000	Guangzhou Yuexiu Financial Holdings Group Co Ltd, 3.00%, 21/04/2025	20.127.250
20.000.000	China Government Bond, 2.33%, 15/12/2025	20.125.480
20.000.000	Bright Food Group Co Ltd, 3.25%, 12/07/2024	20.057.200
20.000.000	Bank of Communications Co Ltd, 2.40%, 05/06/2023	19.763.480
20.000.000	Industrial and Commercial Bank of China Ltd, 0.00%, 09/01/2025	19.549.600
20.000.000	Bank of Communications Co Ltd, 2.33%, 13/06/2024	19.536.520
20.000.000	China Citic Bank Corp, 2.49%, 22/05/2024	19.515.460
20.000.000	Agricultural Bank of China Ltd, 2.63%, 23/04/2024	19.497.640
2.000.000	BOC Aviation USA Corp, 1.63%, 29/04/2024	14.378.988
1.500.000	Guangzhou Metro Investment Finance BVI Ltd, 1.51%, 17/09/2025	10.249.502
10.000.000	China Government Bond, 2.69%, 12/08/2026	10.141.960
10.000.000	China Development Bank, 2.69%, 16/06/2027	10.138.520
10.000.000	China Three Gorges Renewables Group Co Ltd, 2.65%, 21/02/2025	10.031.150
10.000.000	China Post Group Co Ltd, 2.84%, 20/01/2025	10.030.000
10.000.000	Central Huijin Investment Ltd, 2.44%, 11/11/2025	10.023.230
10.000.000	Agricultural Bank of China Ltd, 4.30%, 11/04/2029	10.014.650
1.300.000	Sinochem Offshore Capital Co Ltd, 1.00%, 23/09/2024	9.207.696
1.000.000	China Hongqiao Group Ltd, 6.25%, 08/06/2024	7.235.778
1.000.000	China Mengniu Dairy Co Ltd, 3.00%, 18/07/2024	7.190.115
1.000.000	Blossom Joy Ltd, 3.10%, 29/12/2049	7.005.289
5.000.000	Guotai Junan Securities Co Ltd, 3.16%, 15/02/2026	5.060.500
700.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd, 3.38%, 12/05/2026	4.799.479

China Equity – Informe de compras y ventas significativas

Total compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
1.552.400	Beijing New Building Materials Plc Class A	5.611.983
77.500	Tencent Holdings Ltd	3.538.105
393.500	Shenzhou International Group Holdings Ltd	3.503.506
282.400	Meituan Class B	3.297.562
945.922	Zhejiang Shuanghuan Driveline Co Ltd Class A	3.153.921
725.000	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	2.799.176
245.200	Alibaba Group Holding Ltd	2.431.922
58.000	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd Class A	2.381.678
85.000	Contemporary Amperex Technology Co Ltd Class A	2.310.038
624.700	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd - H Shares	2.291.003
98.100	Changzhou Xingyu Automotive Lighting Systems Co Ltd Class A	1.677.912
2.014.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	1.553.296
284.989	Shenzhen Sunlord Electronics Co Ltd Class A	970.097
166.000	Akeso Inc	817.305
79.000	Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd Class A	533.755
171.000	Cowell e Holdings Inc	401.584
61.500	Beijing New Building Materials Plc - Participatory Note, 25/10/2024	248.251
60.000	China Resources Beer Holdings Co Ltd	226.862
10.000	ZTO Express Cayman Inc ADR	225.043

China Equity – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
189.508	Trip.com Group Ltd ADR	8.557.753
1.800.000	Haier Smart Home Co Ltd - H Shares	5.632.023
265.454	ZTO Express Cayman Inc ADR	5.222.081
575.000	Midea Group Co Ltd Class A	5.200.283
1.300.072	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A	5.062.288
394.900	Meituan Class B	4.319.683
1.370.000	China Resources Land Ltd	4.100.443
1.645.900	Satellite Chemical Co Ltd Class A	3.891.734
420.000	Alibaba Group Holding Ltd	3.782.404
1.949.600	China Pacific Insurance Group Co Ltd - H Shares	3.554.594
370.127	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A	3.124.551
724.900	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	2.948.432
65.000	Tencent Holdings Ltd	2.473.421
3.014.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	2.426.466
2.206.000	Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co Ltd Class A	2.271.916
200.000	Wanhua Chemical Group Co Ltd Class A	2.179.238
436.000	China Resources Beer Holdings Co Ltd	1.959.548
295.000	Akeso Inc	1.755.898
290.000	Yunnan Energy New Material Co Ltd Class A	1.745.852
95.400	Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd Class A	1.683.281
388.900	Beijing New Building Materials Plc Class A	1.672.392
400.000	China Merchants Bank Co Ltd - H Shares	1.580.008
310.200	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A	1.461.843
329.000	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd Class A	1.304.252
154.414	Milkyway Intelligent Supply Chain Service Group Co Ltd Class A	1.037.395
269.700	Shenzhen Sunlord Electronics Co Ltd Class A	995.370

Climate Innovation – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
947	Heidelberg Materials AG	100.235
367	NXP Semiconductors NV	95.095
698	L&F Co Ltd	90.028
355	First Solar Inc	64.145
704	Kia Corp	52.353
53	ASML Holding NV	45.998
2.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	43.103
847	NEXTracker Inc Class A	41.672
105	Cadence Design Systems Inc	34.269
52	Synopsys Inc	32.212
220	Albemarle Corp	31.300
3.500	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A	30.357
862	Infineon Technologies AG	30.067
274	DSM-Firmenich AG	28.883
80	Rockwell Automation Inc	21.135
231	ON Semiconductor Corp	16.197
200	Hitachi Ltd	15.413
722	Fluence Energy Inc Class A	15.104
131	Arkema SA	14.475

Climate Innovation – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
1.996	Howmet Aerospace Inc	132.097
1.541	Procore Technologies Inc	99.240
3.130	Green Plains Inc	68.066
322	Clean Harbors Inc	60.683
843	Danone SA	53.924
221	Union Pacific Corp	51.299
523	Ingersoll Rand Inc	45.866
790	Copart Inc	43.112
409	L&F Co Ltd	43.023
65	Adobe Inc	36.272
116	LG Chem Ltd	34.965
80	Rockwell Automation Inc	21.726
269	CRH Plc	20.995
271	Veralto Corp	20.837
1.300	Li Auto Inc Class A	19.647
332	ABB Ltd	14.546
504	Wolfspeed Inc	13.702
48	Trane Technologies Plc	12.769
44	LG Energy Solution Ltd	12.293
722	Fluence Energy Inc Class A	12.173

CLO Income – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
20.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2024	19.970.953
20.000.000	United States Treasury Note/Bond, 0.25%, 15/06/2024	19.962.567
4.465.000	OCF Euro CLO 2022-5 DAC Series 2022-5X Class E, 10.37%, 20/04/2035	4.837.576
4.350.000	Ballyrock CLO 14 Ltd Series 2020-14X Class DR, 11.15%, 20/07/2037	4.350.000
4.000.000	RRE 5 Loan Management DAC Series 5X Class DR, 10.26%, 15/01/2037	4.280.013
4.000.000	Palmer Square European CLO 2024-2 DAC Series 2024-2X Class E, 0.00%, 15/10/2037	4.278.078
4.000.000	RRE 11 Loan Management DAC Series 11X Class D, 10.29%, 31/03/2035	4.267.959
4.000.000	Invesco US CLO 2024-3 Ltd Series 2024-3X Class E, 11.82%, 20/07/2037	4.000.000
4.000.000	APIDOS CLO XLVIII Ltd Series 2024-48X Class E, 11.07%, 25/07/2037	4.000.000
4.000.000	Ballyrock CLO 26 Ltd Series 2024-26X Class D, 11.43%, 25/07/2037	4.000.000
4.000.000	Oaktree CLO 2024-26 Ltd Series 2024-26X Class E, 11.83%, 20/04/2037	4.000.000
4.000.000	Trestles CLO II LTD Series 2018-2X Class ER, 11.92%, 25/07/2037	4.000.000
4.000.000	Symphony CLO 38 Ltd Series 2023-38X Class E, 11.32%, 24/04/2036	3.975.000
3.500.000	Harvest CLO XXVIII DAC Series 28X Class ER, 10.83%, 25/10/2034	3.768.625
3.600.000	Voya Euro CLO V DAC Series 5X Class E, 9.72%, 15/04/2035	3.763.220
3.750.000	GoldenTree Loan Management US CLO 20 Ltd Series 2024-20X Class E, 11.23%, 20/07/2037	3.750.000
3.250.000	Harvest CLO XXXII DAC Series 32X Class E, 10.32%, 25/07/2037	3.510.559
3.500.000	Symphony CLO 43 Ltd Series 2024-43X Class E, 12.08%, 15/04/2037	3.500.000
3.500.000	1988 CLO 5 Ltd Series 2024-5X Class E, 11.63%, 15/07/2037	3.500.000
3.500.000	Juniper Valley Park CLO Ltd Series 2023-1X Class ER, 0.00%, 20/07/2036	3.500.000
3.500.000	Captree Park CLO Ltd Series 2024-1X Class E, 11.33%, 20/07/2037	3.500.000
3.250.000	Palmer Square European CLO 2024-2 DAC Series 2024-2X Class E, 7.51%, 15/05/2037	3.457.687
3.232.000	Avoca CLO XVII DAC Series 17X Class ER Class ER, 10.29%, 15/10/2032	3.454.883
3.100.000	OCF Euro CLO 2019-3 DAC Series 2019-3X Class FR, 12.49%, 20/04/2033	3.325.894
3.090.000	Harvest CLO XXIX DAC Series 29X Class ER, 0.00%, 15/07/2037	3.284.081
3.250.000	Invesco US CLO 2024-1 Ltd Series 2024-1RX Class ER, 12.72%, 15/04/2037	3.250.000
3.095.000	OAK Hill Credit Partners VIII DAC Series 2021-8X Class F, 12.03%, 18/04/2035	3.249.907
3.000.000	Armada Euro CLO VI DAC Series 6X Class D, 7.47%, 15/07/2037	3.224.850
3.000.000	GoldenTree Loan Management EUR CLO 7 DAC Series 7X Class E, 0.00%, 20/07/2037	3.221.262
3.000.000	Palmer Square European CLO 2024-2 DAC Series 2024-2X Class D, 10.44%, 15/10/2037	3.216.600
3.000.000	Avoca CLO XXX DAC Series 30X Class E, 10.43%, 15/07/2037	3.212.352
3.100.000	GoldenTree Loan Management EUR CLO 5 DAC Series 5X Class E, 9.15%, 20/04/2034	3.209.070
3.000.000	Providus CLO VII DAC Series 7X Class ER, 0.00%, 15/07/2038	3.199.174
3.000.000	Trinitas Euro CLO VII DAC Series 7X Class E, 10.20%, 25/07/2037	3.197.947
3.000.000	Armada Euro CLO VI DAC Series 6X Class E, 10.36%, 15/07/2037	3.192.601
3.000.000	Contego CLO VIII DAC Series 8X Class ER Class ER, 9.94%, 25/01/2034	3.186.509
3.000.000	Aqueduct European CLO 8 DAC Series 2024-8X Class E, 10.33%, 15/07/2037	3.181.761
3.000.000	CVC Cordatus Loan Fund XXXI DAC Series 31X Class E, 10.38%, 15/06/2037	3.181.761
3.000.000	Avoca CLO XXIII DAC Series 23X Class E, 9.45%, 15/04/2034	3.178.706
3.000.000	Avoca CLO XXV DAC Series 25X Class F, 12.39%, 15/10/2034	3.144.255
3.000.000	Deer Park CLO DAC Series 1X Class ER, 9.95%, 15/10/2034	3.140.159

CLO Income – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Total ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
131.071	iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF	12.319.363
4.000.000	Trestles Clo II Ltd Series 2018-2X Class D, 11.39%, 25/07/2031	4.000.000
3.300.000	Magnetite CLO Ltd Series 2015-14RX Class E, 11.16%, 18/10/2031	3.300.000
2.650.000	Magnetite VIII Ltd Series 2014-8X Class FR2, 13.02%, 15/04/2031	2.650.000
2.250.000	CVC Cordatus Loan Fund XXVI DAC Series 26X Class E, 12.36%, 15/01/2037	2.512.048
2.490.000	Magnetite XVIII Ltd Series 2016-18X Class FR, 13.24%, 15/11/2028	2.490.000
2.000.000	Palmer Square European Loan Funding 2023-1 DAC Series 2023-1X Class E, 10.53%, 15/11/2032	2.164.500
2.000.000	Signal Peak CLO 5 Ltd Series 2018-5X Class E, 11.29%, 25/04/2031	2.000.000
1.650.000	Magnetite VII Ltd Series 2012-7X Class ER2, 12.08%, 15/01/2028	1.650.000
1.675.000	Trinitas CLO X Ltd Series 2019-10X Class ER, 12.68%, 15/01/2035	1.547.281
1.000.000	Invesco US CLO 2023-1 Ltd Series 2023-1X Class E, 13.77%, 22/04/2035	1.000.000

Commodities – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
30.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 05/09/2024	29.591.139
21.945.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/05/2024	21.724.557
20.915.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/07/2024	20.658.767
20.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/04/2024	19.735.117
3.890.000	JPMorgan Chase & Co, 6.29%, 24/02/2026	3.906.035
3.870.000	Wells Fargo Bank NA, 6.44%, 11/12/2026	3.897.054
3.675.000	Morgan Stanley, 6.30%, 18/02/2026	3.680.615
3.310.000	JPMorgan Chase & Co, 6.24%, 22/04/2027	3.325.678
3.280.000	Bank of New York Mellon Corp, 2.10%, 24/10/2024	3.207.381
3.055.000	Thermo Fisher Scientific Inc, 1.22%, 18/10/2024	2.975.326
2.815.000	Caterpillar Financial Services Corp, 5.89%, 14/05/2027	2.815.000
2.790.000	Florida Power & Light Co, 3.25%, 01/06/2024	2.771.447
2.645.000	Home Depot Inc, 5.70%, 24/12/2025	2.646.147
2.430.000	UBS AG, 4.75%, 09/08/2024	2.418.763
2.380.000	John Deere Capital Corp, 5.55%, 11/10/2024	2.380.840
2.166.000	Amgen Inc, 5.25%, 02/03/2025	2.159.706
2.165.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4.65%, 19/05/2025	2.150.083
2.139.000	Volkswagen Group of America Finance LLC, 6.20%, 20/03/2026	2.144.480
2.065.000	Lowe's Cos Inc, 4.00%, 15/04/2025	2.034.520
2.005.000	Spectra Energy Partners LP, 3.50%, 15/03/2025	1.966.559
1.996.000	Capital One Financial Corp, 3.20%, 05/02/2025	1.962.554
1.950.000	AT&T Inc, 6.76%, 12/06/2024	1.954.153
1.900.000	Pepsico Singapore Financing I Pte Ltd, 5.93%, 16/02/2027	1.900.000
1.890.000	Capital One Financial Corp, 3.30%, 30/10/2024	1.864.379
1.860.000	Truist Financial Corp, 5.75%, 09/06/2025	1.855.369
1.872.000	Bank of America Corp, 4.00%, 22/01/2025	1.851.530
1.835.000	State Street Corp, 2.35%, 01/11/2025	1.813.219
1.779.000	PNC Bank NA, 2.95%, 23/02/2025	1.737.188
1.735.000	Intel Corp, 3.40%, 25/03/2025	1.704.096

Commodities – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Total ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
3.938.000	JPMorgan Chase & Co, 5.93%, 23/06/2025	3.940.075
3.335.000	JPMorgan Chase & Co, 6.27%, 24/02/2026	3.346.554
2.792.000	Caterpillar Financial Services Corp, 5.69%, 13/09/2024	2.792.991
2.000.000	Volkswagen Group of America Finance LLC, 6.30%, 07/06/2024	2.001.796
1.340.000	Volkswagen Group of America Finance LLC, 6.28%, 12/09/2025	1.347.678
1.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/01/2024	998.242
145.000	Citigroup Inc, 6.81%, 24/05/2025	145.155

Corporate Hybrid Bond – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste EUR
55.700.000	Centrica Plc, 6.50%, 21/05/2055	64.776.653
53.500.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 5.25%, 23/01/2084	53.590.000
42.300.000	Iberdrola Finanzas SA, 4.87%, 29/12/2049	42.468.900
39.000.000	TotalEnergies SE, 2.63%, 29/12/2049	38.227.767
37.000.000	TenneT Holding BV, 4.63%, 29/12/2049	36.880.860
35.000.000	Enel SpA, 4.75%, 29/12/2049	34.570.000
31.900.000	Arkema SA, 4.80%, 29/12/2049	31.955.000
32.000.000	Orsted AS, 5.13%, 14/03/2024	31.889.390
25.000.000	British Telecommunications Plc, 5.13%, 03/10/2054	24.864.600
24.000.000	TenneT Holding BV, 4.88%, 29/12/2049	23.961.120
21.500.000	Engie SA, 5.13%, 29/12/2049	21.500.000
20.000.000	Repsol International Finance BV, 3.75%, 29/12/2049	19.625.000
19.300.000	Fastighets AB Balder, 2.87%, 02/06/2081	16.856.750
16.500.000	A2A SpA, 5.00%, 29/12/2049	16.410.900
15.000.000	Elia Group SA, 5.85%, 29/12/2049	15.297.500
15.000.000	Naturgy Finance BV, 2.37%, 29/12/2049	14.008.750
15.000.000	Sempra, 6.88%, 01/10/2054	13.726.012
15.000.000	Transcanada Trust, 5.88%, 15/08/2076	13.472.412
13.300.000	Koninklijke KPN NV, 4.88%, 29/12/2049	13.257.706
12.100.000	Orange SA, 4.50%, 29/12/2049	12.012.880
10.000.000	Telefonica Europe BV, 5.75%, 29/12/2049	10.000.000
9.000.000	Orange SA, 5.38%, 29/12/2049	9.389.500
10.000.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc, 6.75%, 15/06/2054	9.202.595
10.000.000	Enbridge Inc, 7.38%, 15/01/2083	9.176.633
8.000.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 7.25%, 29/12/2049	8.359.000
8.300.000	Alliander NV, 4.50%, 29/12/2049	8.231.940

Corporate Hybrid Bond – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto EUR
81.487.000	Vodafone Group Plc, 6.25%, 03/10/2078	75.375.927
42.000.000	NGG Finance Plc, 5.63%, 18/06/2073	48.601.205
40.400.000	Bayer AG, 6.63%, 25/09/2083	39.888.160
37.300.000	Bayer AG, 7.00%, 25/09/2083	37.642.400
30.000.000	British Telecommunications Plc, 4.25%, 23/11/2081	25.992.963
26.500.000	Veolia Environnement SA, 2.00%, 29/12/2049	23.611.500
20.000.000	Iberdrola International BV, 1.45%, 29/12/2049	18.325.000
20.600.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 1.38%, 31/08/2081	17.499.700
20.000.000	Enbridge Inc, 5.50%, 15/07/2077	17.381.657
17.700.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 1.88%, 29/06/2080	16.536.225
15.000.000	Sempre, 6.88%, 01/10/2054	13.806.523
10.000.000	Volkswagen International Finance NV, 7.50%, 29/12/2049	10.762.500
10.000.000	Telefonica Europe BV, 6.75%, 29/12/2049	10.712.500
10.000.000	Telefonica Europe BV, 5.75%, 29/12/2049	10.027.500
10.000.000	ELM BV for Firmenich International SA, 3.75%, 29/12/2049	9.880.000
10.000.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc, 6.75%, 15/06/2054	9.448.797
10.200.000	Enel SpA, 1.38%, 29/12/2049	9.168.050
9.854.000	Orsted AS, 1.75%, 09/12/3019	8.903.089
8.900.000	Iberdrola International BV, 1.87%, 29/12/2049	8.438.500
8.300.000	Alliander NV, 4.50%, 29/12/2049	8.320.750
8.000.000	Rogers Communications Inc, 5.25%, 15/03/2082	6.960.343
6.000.000	Telia Co AB, 1.38%, 11/05/2081	5.632.500
5.194.000	British Telecommunications Plc, 1.87%, 18/08/2080	4.994.031

Developed Market FMP – 2027 – Informe de compras y ventas significativas

En el período no se produjeron compras.

Total ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
951.000	New Fortress Energy Inc, 6.75%, 15/09/2025	927.225
425.000	Carrier Global Corp, 2.49%, 15/02/2027	397.630
100.000	Ford Motor Credit Co LLC, 6.95%, 10/06/2026	102.309

Emerging Market Debt - Hard Currency – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
18.770.000	Mexico Government International Bond, 6.00%, 07/05/2036	18.385.983
37.010.000	Argentine Republic Government International Bond, 4.13%, 09/07/2046	12.817.760
12.238.000	Republic of Poland Government International Bond, 5.13%, 18/09/2034	12.175.533
11.251.000	Türkiye Government International Bond, 5.88%, 21/05/2030	12.092.675
12.203.000	Türkiye Government International Bond, 7.63%, 15/05/2034	11.993.352
11.846.000	Israel Government International Bond, 5.75%, 12/03/2054	11.367.895
10.691.000	Israel Government International Bond, 5.50%, 12/03/2034	10.607.610
8.463.000	Romanian Government International Bond, 5.63%, 22/02/2036	9.023.450
8.538.000	YPF SA, 9.50%, 17/01/2031	8.459.707
8.620.000	Dominican Republic International Bond, 4.88%, 23/09/2032	7.680.028
7.562.000	Republic of Poland Government International Bond, 5.50%, 18/03/2054	7.474.356
7.116.698	Samarco Mineracao SA, 9.05%, 30/06/2031	6.555.260
6.340.000	Costa Rica Government International Bond, 6.55%, 03/04/2034	6.552.154
6.400.000	Indonesia Government International Bond, 4.85%, 11/01/2033	6.400.000
7.510.000	Nigeria Government International Bond, 8.25%, 28/09/2051	6.205.138
7.236.000	Republic of South Africa Government International Bond, 7.30%, 20/04/2052	6.132.510
5.669.000	Dominican Republic International Bond, 7.05%, 03/02/2031	5.843.260
5.515.000	Panama Government International Bond, 8.00%, 01/03/2038	5.626.474
7.110.000	Senegal Government International Bond, 5.38%, 08/06/2037	5.573.387
5.494.000	Bancolombia SA, 8.63%, 24/12/2034	5.494.000
5.365.000	Corp Nacional del Cobre de Chile, 6.44%, 26/01/2036	5.361.888
12.890.000	Argentine Republic Government International Bond, 0.75%, 09/07/2030	5.169.009
6.808.000	Republic of South Africa Government International Bond, 5.75%, 30/09/2049	5.157.060
5.000.000	Development Bank of Mongolia LLC, 11.00%, 07/03/2026	5.017.500
4.890.000	Dominican Republic International Bond, 6.85%, 27/01/2045	4.810.538
4.617.000	El Salvador Government International Bond, 9.25%, 17/04/2030	4.151.745
4.730.000	Egypt Government International Bond, 6.38%, 11/04/2031	4.067.745
4.050.000	Guatemala Government Bond, 5.25%, 10/08/2029	3.928.500
3.770.000	Braskem Netherlands Finance BV, 8.50%, 12/01/2031	3.822.215
3.496.000	Republic of Poland Government International Bond, 3.63%, 11/01/2034	3.801.356
4.669.000	Romanian Government International Bond, 2.00%, 14/04/2033	3.776.846
5.220.000	Ethiopia International Bond, 6.63%, 11/12/2024	3.732.300
3.802.500	Iraq International Bond, 5.80%, 15/01/2028	3.545.592
3.769.000	Bahamas Government International Bond, 6.00%, 21/11/2028	3.444.918
3.389.000	Panama Government International Bond, 7.50%, 01/03/2031	3.388.966
3.048.000	Republic of Poland Government International Bond, 4.13%, 11/01/2044	3.316.897
3.324.000	Türkiye ihracat Kredi Bankasi AS, 7.50%, 06/02/2028	3.295.879

Emerging Market Debt - Hard Currency – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
3.273.000	MVM Energetika Zrt, 6.50%, 13/03/2031	3.243.903
3.189.000	Dominican Republic International Bond, 6.60%, 01/06/2036	3.163.329
3.114.000	Greenko Power II Ltd, 4.30%, 13/12/2028	2.802.600
70.330.000	Argentine Republic Government International Bond, 3.63%, 09/07/2035	25.337.891
26.020.000	Serbia International Bond, 1.50%, 26/06/2029	23.760.537
150.000	Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	17.785.500
25.646.000	Ecuador Government International Bond, 3.50%, 31/07/2035	12.839.642
13.889.000	Indonesia Government International Bond, 1.10%, 12/03/2033	11.853.049
11.830.000	Dominican Republic International Bond, 6.85%, 27/01/2045	11.589.800
13.590.000	Romanian Government International Bond, 3.38%, 28/01/2050	9.834.517
15.260.000	Panama Government International Bond, 4.50%, 01/04/2056	9.802.773
9.510.000	Angolan Government International Bond, 9.38%, 08/05/2048	8.030.337
7.800.000	Republic of Poland Government International Bond, 5.50%, 04/04/2053	7.887.830
8.230.000	Panama Government International Bond, 6.40%, 14/02/2035	7.840.360
8.042.000	Mongolia Government International Bond, 5.13%, 07/04/2026	7.764.907
8.916.000	Mexico Government International Bond, 5.75%, 12/10/2110	7.349.808
9.370.000	Serbia International Bond, 2.05%, 23/09/2036	7.047.557
8.650.000	El Salvador Government International Bond, 9.50%, 15/07/2052	7.037.270
6.360.000	Indonesia Government International Bond, 5.65%, 11/01/2053	6.630.300
7.390.000	Paraguay Government International Bond, 5.60%, 13/03/2048	6.437.358
6.400.000	Indonesia Government International Bond, 4.85%, 11/01/2033	6.385.907
10.610.000	Argentine Republic Government International Bond, 0.75%, 09/07/2030	5.643.105
6.565.000	Adani Electricity Mumbai Ltd, 3.95%, 12/02/2030	5.424.331
5.000.000	Mongolia Government International Bond, 8.65%, 19/01/2028	5.262.500
5.600.000	Tunisian Republic, 6.38%, 15/07/2026	4.935.235
4.889.421	Ivory Coast Government International Bond, 5.75%, 31/12/2032	4.738.246
3.637.000	Indonesia Government International Bond, 8.50%, 12/10/2035	4.730.477
11.800.000	Provincia de Buenos Aires, 6.38%, 01/09/2037	4.645.297
4.319.000	Brazilian Government International Bond, 6.25%, 18/03/2031	4.390.086
5.470.000	Republic of South Africa Government International Bond, 5.75%, 30/09/2049	4.090.701
3.800.000	Peruvian Government International Bond, 3.75%, 01/03/2030	4.084.170
4.090.800	Vedanta Resources Finance II Plc, 13.88%, 09/12/2028	3.931.135
12.840.000	Ukraine Government International Bond, 7.75%, 01/09/2027	3.900.150
4.262.000	Bahamas Government International Bond, 6.00%, 21/11/2028	3.780.489

Emerging Market Debt - Local Currency – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
1.340.600.000	India Government Bond, 7.18%, 14/08/2033	16.208.725
235.648.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.88%, 15/04/2029	15.313.170
517.922.000	Thailand Government Bond, 2.40%, 17/03/2029	14.569.478
52.895.000	Peru Government Bond, 5.94%, 12/02/2029	14.288.350
1.124.800.000	International Bank for Reconstruction & Development, 6.75%, 13/07/2029	13.487.922
51.888.000	Republic of Poland Government Bond, 4.75%, 25/07/2029	12.319.919
368.967.000	Thailand Government Bond, 3.45%, 17/06/2043	10.887.046
45.970.000	Romania Government Bond, 8.25%, 29/09/2032	10.732.539
263.666.992	Turkiye Government Bond, 26.20%, 05/10/2033	8.112.985
2.903.530.000	Hungary Government Bond, 4.50%, 23/03/2028	7.940.088
282.834.484	Uruguay Government International Bond, 9.75%, 20/07/2033	7.622.295
49.630.000	China Government Bond, 3.00%, 15/10/2053	7.575.897
2.447.000.000	Hungary Government Bond, 6.75%, 22/10/2028	7.394.556
135.763.500	Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029	7.144.428
26.445.000	Republic of Poland Government Bond, 6.00%, 25/10/2033	6.917.428
962.000.000	Kenya Infrastructure Bond, 18.46%, 09/08/2032	6.467.838
201.350.928	Republic of South Africa Government Bond, 6.50%, 28/02/2041	6.428.091
126.850.000	Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031	6.192.526
348.700.000	Egypt Treasury Bills, 0.00%, 10/09/2024	6.081.201
341.490.000	Philippine Government Bond, 6.25%, 25/01/2034	5.915.581
321.950.000	Egypt Treasury Bills, 0.00%, 31/12/2024	5.766.271
91.732.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.63%, 15/02/2034	5.555.332
2.059.960.000	Hungary Government Bond, 4.75%, 24/11/2032	5.411.610
440.000.000	International Bank for Reconstruction & Development, 6.50%, 17/04/2030	5.180.296
18.175.000	Peruvian Government International Bond, 6.95%, 12/08/2031	4.958.234
19.242.000	Malaysia Government Bond, 4.70%, 15/10/2042	4.444.508
82.700.000	Mexican Bonos, 5.50%, 04/03/2027	4.282.850
77.830.000	Mexican Bonos, 7.50%, 26/05/2033	4.088.947
28.600.000	China Government Bond, 2.60%, 15/09/2030	4.022.403
91.411.325	Republic of South Africa Government Bond, 8.88%, 28/02/2035	3.915.740
86.362.224	Republic of South Africa Government Bond, 8.50%, 31/01/2037	3.607.462
15.535.700.000	Colombian TES, 6.00%, 28/04/2028	3.524.347
108.740.000	Turkiye Government Bond, 31.08%, 08/11/2028	3.507.006
12.784.000	Peruvian Government International Bond, 6.90%, 12/08/2037	3.405.731
210.000.000	Egypt Treasury Bills, 0.00%, 18/03/2025	3.394.619
3.115.000.000	Bonos de la Tesorería de la República, 4.70%, 01/09/2030	3.359.495
265.500.000	India Government Bond, 7.30%, 19/06/2053	3.281.211
13.850.000	Romania Government Bond, 8.00%, 29/04/2030	3.189.759

Emerging Market Debt - Local Currency – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
17.716.200	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/01/2024	17.651.407
86.013.000	Republic of Poland Government Bond, 1.75%, 25/04/2032	16.775.237
68.148.200.000	Colombian TES, 5.75%, 03/11/2027	15.286.977
302.880.000	Mexican Bonos, 7.50%, 26/05/2033	15.121.010
339.476.537	Republic of South Africa Government Bond, 7.00%, 28/02/2031	14.401.308
232.689.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.88%, 15/04/2029	14.284.551
58.229.500.000	Colombian TES, 6.00%, 28/04/2028	13.107.094
435.238.000	Uruguay Government International Bond, 8.50%, 15/03/2028	10.991.687
198.727.464	Republic of South Africa Government Bond, 10.50%, 21/12/2026	10.859.487
1.036.000	Neuberger Berman China Bond Fund	10.576.080
42.065.000	Malaysia Government Bond, 3.90%, 16/11/2027	9.016.667
3.310.110.000	Hungary Government Bond, 4.50%, 23/03/2028	8.446.453
8.308.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2024	8.233.032
28.227.000	Republic of Poland Government Bond, 7.50%, 25/07/2028	7.734.939
180.529.026	Republic of South Africa Government Bond, 8.75%, 28/02/2048	7.448.828
137.440.000	Mexican Bonos, 5.50%, 04/03/2027	7.414.381
259.670.000	Bank of Thailand Bill, 0.00%, 09/05/2024	7.355.810
34.735.000	Romania Government Bond, 4.85%, 25/07/2029	7.154.720
173.070.000	Czech Republic Government Bond, 1.00%, 26/06/2026	7.122.697
31.882.000	Malaysia Government Bond, 3.73%, 15/06/2028	6.787.977
29.585.000	Malaysia Government Bond, 4.70%, 15/10/2042	6.621.730
28.895.000	Republic of Poland Government Bond, 2.75%, 25/10/2029	6.409.286
226.154.000	Thailand Government Bond, 3.45%, 17/06/2043	6.340.757
24.322.000	Peru Government Bond, 6.15%, 12/08/2032	6.314.679
229.063.000	Thailand Government Bond, 2.40%, 17/03/2029	6.201.133
109.210.000	Mexican Bonos, 7.50%, 03/06/2027	6.065.562
5.865.000.000	Bonos de la Tesorería de la República, 4.50%, 01/03/2026	6.029.035
25.705.000	Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2026	6.028.530
21.840.000	Romania Government Bond, 8.25%, 29/09/2032	5.309.698
19.689.000	Peruvian Government International Bond, 6.90%, 12/08/2037	5.159.901
614.600.000	Kenya Infrastructure Bond, 18.46%, 09/08/2032	4.905.920
170.504.000	Thailand Government Bond, 3.35%, 17/06/2033	4.886.499
79.543.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.63%, 15/02/2034	4.817.558
71.000.000.000	Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033	4.529.209
153.400.000	Thailand Government Bond, 2.65%, 17/06/2028	4.405.297
28.560.000	China Government Bond, 3.00%, 15/10/2053	4.365.182
30.840.000	China Government Bond, 2.60%, 15/09/2030	4.342.802
15.467.000	Peru Government Bond, 7.30%, 12/08/2033	4.304.028
14.915.000	Republic of Poland Government Bond, 6.00%, 25/10/2033	4.017.534
28.000.000	China Government Bond, 2.62%, 25/06/2030	3.957.256

Emerging Market Debt Blend – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
7.929.800	United States Treasury Bill, 0.00%, 10/10/2024	7.744.433
117.877.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.88%, 15/04/2029	7.638.300
413.160.000	India Government Bond, 7.18%, 14/08/2033	4.992.447
139.877.000	Thailand Government Bond, 2.40%, 17/03/2029	3.940.464
215.000.000	Egypt Treasury Bills, 0.00%, 18/03/2025	3.475.444
14.420.000	Romania Government Bond, 8.25%, 29/09/2032	3.366.612
21.320.000	China Government Bond, 3.00%, 15/10/2053	3.259.506
58.700.000	Mexican Bonos, 5.50%, 04/03/2027	3.100.380
12.606.000	Republic of Poland Government Bond, 4.75%, 25/07/2029	2.993.079
242.600.000	International Bank for Reconstruction & Development, 6.75%, 13/07/2029	2.908.825
11.711.000	Malaysia Government Bond, 4.70%, 15/10/2042	2.689.824
9.725.000	Peru Government Bond, 5.94%, 12/02/2029	2.630.301
81.968.000	Thailand Government Bond, 3.45%, 17/06/2043	2.401.636
202.500.000	International Bank for Reconstruction & Development, 6.50%, 17/04/2030	2.371.938
69.326.539	Republic of South Africa Government Bond, 6.50%, 28/02/2041	2.218.354
39.220.000	Mexican Bonos, 7.50%, 26/05/2033	2.038.993
681.800.000	Hungary Government Bond, 4.50%, 23/03/2028	1.864.472
58.869.157	Türkiye Government Bond, 26.20%, 05/10/2033	1.809.526
66.542.373	Uruguay Government International Bond, 9.75%, 20/07/2033	1.793.108
28.952.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.63%, 15/02/2034	1.775.198
554.200.000	Hungary Government Bond, 6.75%, 22/10/2028	1.674.729
31.090.000	Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031	1.517.743

Emerging Market Debt Blend – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
854.517	Neuberger Berman China Bond Fund	8.737.249
7.929.800	United States Treasury Bill, 0.00%, 10/10/2024	7.782.877
77.586.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.88%, 15/04/2029	4.766.727
156.877.000	Thailand Government Bond, 2.40%, 17/03/2029	4.329.096
98.972.961	Republic of South Africa Government Bond, 7.00%, 28/02/2031	4.281.856
150.162.000	Thailand Government Bond, 1.45%, 17/12/2024	4.189.870
69.430.000	Mexican Bonos, 5.50%, 04/03/2027	3.612.488
17.286.000	Republic of Poland Government Bond, 1.75%, 25/04/2032	3.368.177
13.558.000	Malaysia Government Bond, 4.70%, 15/10/2042	3.052.423
13.290.900.000	Colombian TES, 6.00%, 28/04/2028	2.994.262
49.303.416	Republic of South Africa Government Bond, 10.50%, 21/12/2026	2.706.321
42.193.800	Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029	2.435.124
92.865.000	Uruguay Government International Bond, 8.50%, 15/03/2028	2.346.482
130.000.000	Egypt Treasury Bills, 0.00%, 18/03/2025	2.260.418
16.000.000	China Government Bond, 1.99%, 09/04/2025	2.215.278
74.498.000	Thailand Government Bond, 3.35%, 17/06/2033	2.137.822
42.450.000	Mexican Bonos, 7.50%, 26/05/2033	2.124.147
826.930.000	Hungary Government Bond, 4.50%, 23/03/2028	2.110.089
10.655.000	Romania Government Bond, 2.50%, 25/10/2027	2.062.555
9.181.500.000	Colombian TES, 5.75%, 03/11/2027	2.059.590
8.277.000	Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2026	1.941.184
9.000.000	Malaysia Government Bond, 3.90%, 16/11/2027	1.929.157
12.470.000	China Government Bond, 3.00%, 15/10/2053	1.905.539
45.742.589	Republic of South Africa Government Bond, 8.75%, 28/02/2048	1.887.390
67.253.000	Thailand Government Bond, 3.45%, 17/06/2043	1.883.712
12.800.000	China Government Bond, 3.02%, 22/10/2025	1.800.454
7.600.000	Malaysia Government Bond, 3.73%, 15/06/2028	1.618.111

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
660.000	Peruvian Government International Bond, 8.75%, 21/11/2033	813.596
10.580.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.88%, 15/04/2029	685.068
650.000	Hungary Government International Bond, 5.50%, 16/06/2034	631.800
600.000	Metropolitan Bank & Trust Co, 5.50%, 06/03/2034	598.680
500.000	Bank Gospodarstwa Krajowego, 4.00%, 13/03/2032	545.255
600.000	Indian Railway Finance Corp Ltd, 3.57%, 21/01/2032	533.200
510.000	Corp Nacional del Cobre de Chile, 5.95%, 08/01/2034	504.645
480.000	Mexico Government International Bond, 6.00%, 07/05/2036	472.221
15.972.000	Thailand Government Bond, 2.40%, 17/03/2029	453.198
8.360.000	Mexican Bonos, 8.00%, 24/05/2035	450.909
500.000	Romanian Government International Bond, 2.12%, 16/07/2031	442.472
36.800.000	Asian Infrastructure Investment Bank, 6.65%, 30/06/2033	428.193
421.000	Republic of Poland Government International Bond, 5.13%, 18/09/2034	416.914
6.374.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.63%, 15/02/2034	398.224
290.000	Indonesia Government International Bond, 8.50%, 12/10/2035	368.065
360.000	Israel Government International Bond, 5.75%, 12/03/2054	345.470
340.000	Abu Dhabi Government International Bond, 5.50%, 30/04/2054	334.312
7.790.000	Czech Republic Government Bond, 2.75%, 23/07/2029	327.244
325.000	First Abu Dhabi Bank PJSC, 5.00%, 28/02/2029	322.592
1.398.000	Republic of Poland Government Bond, 2.75%, 25/10/2029	315.189
10.551.000	Thailand Government Bond, 3.45%, 17/06/2043	310.565
300.000	Qatar Government International Bond, 4.82%, 14/03/2049	278.220
1.150.000	Romania Government Bond, 8.75%, 30/10/2028	276.919
1.288.000	Malaysia Government Bond, 3.52%, 20/04/2028	276.664
1.003.000	Peru Government Bond, 5.94%, 12/02/2029	271.000
300.000	Hungary Government International Bond, 1.63%, 28/04/2032	259.470
4.687.400	Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029	253.443
1.024.000	Republic of Poland Government Bond, 4.75%, 25/07/2029	243.131
19.800.000	International Bank for Reconstruction & Development, 6.75%, 13/07/2029	237.405
1.030.000	Malaysia Government Bond, 4.70%, 15/10/2042	236.068
220.000	Israel Government International Bond, 5.50%, 12/03/2034	218.284
200.000	DP World Ltd, 6.85%, 02/07/2037	217.312
200.000	Panama Government International Bond, 8.00%, 01/03/2038	211.800
206.000	Antofagasta Plc, 6.25%, 02/05/2034	204.793
200.000	Latvia Government International Bond, 5.13%, 30/07/2034	197.990
179.000	Republic of Poland Government International Bond, 3.63%, 11/01/2034	194.635
881.300.000	Colombian TES, 7.00%, 26/03/2031	192.794
785.000	Romania Government Bond, 8.25%, 29/09/2032	183.274
200.000	Chile Government International Bond, 0.83%, 02/07/2031	181.098
65.350.000	Hungary Government Bond, 4.50%, 23/03/2028	178.708
3.290.000	Mexican Bonos, 5.50%, 04/03/2027	175.516

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
1.171.000	Panama Government International Bond, 6.70%, 26/01/2036	1.109.246
1.000.000	Philippine Government International Bond, 0.70%, 03/02/2029	942.598
785.200	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/01/2024	784.283
753.000	Hungary Government International Bond, 1.63%, 28/04/2032	671.889
22.000.000	Thailand Government Bond, 0.75%, 17/09/2024	622.411
6.391.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.88%, 15/04/2029	392.659
400.000	Panama Government International Bond, 6.40%, 14/02/2035	367.240
400.000	Indonesia Government International Bond, 1.10%, 12/03/2033	344.104
12.316.000	Thailand Government Bond, 2.40%, 17/03/2029	336.637
250.000	Indonesia Government International Bond, 8.50%, 12/10/2035	320.803
260.000	Philippine Government International Bond, 9.50%, 02/02/2030	315.016
400.000	Tencent Holdings Ltd, 3.24%, 03/06/2050	267.160
298.000	Peruvian Government International Bond, 1.25%, 11/03/2033	253.903
1.292.000	Republic of Poland Government Bond, 1.75%, 25/04/2032	252.617
1.100.000	Malaysia Government Bond, 3.90%, 16/11/2027	234.557
3.980.000	Mexican Bonos, 7.50%, 03/06/2027	225.783
200.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT, 4.75%, 13/05/2025	198.400
179.000	Republic of Poland Government International Bond, 3.63%, 11/01/2034	191.797
7.513.000	Uruguay Government International Bond, 8.50%, 15/03/2028	189.860
200.000	Bank Leumi Le-Israel BM, 3.28%, 29/01/2031	179.750
200.000	Chile Government International Bond, 0.83%, 02/07/2031	176.561
200.000	Peruvian Government International Bond, 1.95%, 17/11/2036	166.279
170.000	Panama Bonos del Tesoro, 6.38%, 25/07/2033	159.418
695.000	Republic of Poland Government Bond, 2.75%, 25/10/2029	154.049
710.000	Malaysia Government Bond, 3.50%, 31/05/2027	150.334
700.000	Malaysia Government Bond, 3.52%, 20/04/2028	147.968
690.000	Malaysia Government Bond, 3.73%, 15/06/2028	146.907
124.000	Romanian Government International Bond, 7.63%, 17/01/2053	135.160
595.000	Malaysia Government Bond, 4.70%, 15/10/2042	133.170
2.550.000	Mexican Bonos, 7.50%, 26/05/2033	127.599
567.700.000	Colombian TES, 6.00%, 28/04/2028	126.963
200.000	Panama Government International Bond, 4.50%, 01/04/2056	124.500
200.000	Chile Government International Bond, 3.25%, 21/09/2071	124.480

Emerging Markets Equity – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
408.704	Tbo Tek Ltd	4.502.075
23.145	Kia Corp	1.641.452
141.600	Meituan Class B	1.584.767
9.558	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	1.328.710
121.125	Standard Bank Group Ltd	1.294.951
160.700	Sieyuan Electric Co Ltd Class A	1.243.308
93.921	XPRO India Ltd	1.242.761
3.322.000	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	1.227.431
152.800	AIA Group Ltd	1.223.726
28.900	Tencent Holdings Ltd	1.180.167
413.300	Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A	1.116.415
703	MercadoLibre Inc	1.101.720
230.500	China Resources Beer Holdings Co Ltd	1.061.424
220.142	CMS Info Systems Ltd	993.903
170.700	Hisense Home Appliances Group Co Ltd Class A	930.399
192.600	Ningbo Sanxing Medical Electric Co Ltd Class A	916.356
67.000	Asia Vital Components Co Ltd	907.608
19.000	Lotes Co Ltd	847.993
33.920	AurionPro Solutions Ltd	827.309
239.781	NCC Ltd	819.831
1.186.004	Fibra MTY SAPI de CV	810.499
27.500	BYD Co Ltd - H Shares	800.720
79.000	Delta Electronics Inc	798.915
13.747	Samsung Electronics Co Ltd	792.956
11.000	Wiwynn Corp	790.582
1.322.900	Agricultural Bank of China Ltd Class A	785.829
413.000	Vietnam Technological & Commercial Joint Stock Bank	785.073
77.500	Alibaba Group Holding Ltd	783.237
82.952	Max Healthcare Institute Ltd	756.871
2.409.400	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	741.837
10.023	DB Insurance Co Ltd	732.045
753.708	SBFC Finance Ltd	727.951
72.500	Shenzhen New Industries Biomedical Engineering Co Ltd Class A	725.087
15.218	OTP Bank Nyrt	713.981
5.924	SK Hynix Inc	691.943
107.000	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	682.144
91.726	Petroleo Brasileiro SA - Preferred Shares	650.458
100.162	Banco BTG Pactual SA	606.074
41.955	Tencent Music Entertainment Group ADR	588.289
121.212	Embraer SA	585.687
1.756	Shree Cement Ltd	579.732

Emerging Markets Equity – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras (cont.):

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
89.100	Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co Ltd Class A	578.451
2.580	Onto Innovation Inc	570.786
42.000	Elite Material Co Ltd	562.392
80.756	Hainan Jinpan Smart Technology Co Ltd Class A	561.745
3.930	PDD Holdings Inc ADR	556.277
15.000	MediaTek Inc	549.049

Emerging Markets Equity – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
130.973	Tbo Tek Ltd	2.507.814
436.700	Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A	1.511.584
23.753	Samsung Electronics Co Ltd	1.346.661
4.566	NVIDIA Corp	1.324.547
8.672	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	1.306.647
132.300	Alibaba Group Holding Ltd	1.232.433
8.198	SK Hynix Inc	1.122.538
448.000	Uni-President Enterprises Corp	1.061.678
3.322.000	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	1.005.230
5.708	Globant SA	971.931
279.604	NARI Technology Co Ltd Class A	942.314
61.970	SM Investments Corp	912.487
120.425	Hiwin Technologies Corp	896.877
42.000	Asia Vital Components Co Ltd	896.857
346.161	Bharat Electronics Ltd	851.647
46.801	HDFC Bank Ltd	849.326
7.766	Baidu Inc ADR	814.013
51.200	Accton Technology Corp	787.780
186.900	Bangkok Bank PCL	742.932
17.000	Tencent Holdings Ltd	722.611
112.000	Chroma ATE Inc	713.058
72.500	Shenzhen New Industries Biomedical Engineering Co Ltd Class A	679.034
22.700	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	671.509
72.810	Grupo Financiero Banorte SAB de CV Class O	668.457
92.301	Syrma SGS Technology Ltd	663.300
23.088	Al-Dawaa Medical Services Co	630.098
13.774	Las Vegas Sands Corp	621.554
31.604	Samsung E&A Co Ltd	603.484
23.000	Jentech Precision Industrial Co Ltd	593.480
41.742	KE Holdings Inc ADR	581.630
959.900	Bank Central Asia Tbk PT	578.858
7.115	Bajaj Finance Ltd	576.158
34.775	Rainbow Children's Medicare Ltd	556.027
266.750	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	553.360
103.029	Ades Holding Co	534.009
19.199	Antofagasta Plc	526.382
9.714	Hero MotoCorp Ltd	521.874
741.000	China Construction Bank Corp - H Shares	516.470
7.004	Apollo Hospitals Enterprise Ltd	504.818

Emerging Markets Equity – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
30.567	Parex Resources Inc	479.227
49.700	Sieyuan Electric Co Ltd Class A	478.202
63.093	Banco do Brasil SA	477.650
6.793	Orion Corp	464.886
41.500	Proya Cosmetics Co Ltd Class A	463.376
4.334	Dino Polska SA	454.629
71.000	Tsingtao Brewery Co Ltd - H Shares	452.418

Euro Bond – Informe de compras y ventas significativas

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste EUR
1.540.000	European Union, 3.25%, 04/07/2034	1.578.808
825.000	European Union, 3.13%, 04/12/2030	836.936
450.000	European Financial Stability Facility, 3.50%, 11/04/2029	461.576
450.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 1.25%, 30/06/2027	427.137
200.000	ASR Nederland NV, 6.63%, 29/12/2049	200.000
200.000	Warnermedia Holdings Inc, 4.69%, 17/05/2033	200.000
200.000	CECONOMY AG, 6.25%, 15/07/2029	200.000
200.000	Engie SA, 4.25%, 06/03/2044	199.814
160.000	Republic of Poland Government International Bond, 3.63%, 11/01/2034	159.223
143.000	Slovakia Government Bond, 3.75%, 06/03/2034	142.484
135.000	Molson Coors Beverage Co, 3.80%, 15/06/2032	134.820
119.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.88%, 20/10/2034	117.689
100.000	AT&T Inc, 4.30%, 18/11/2034	104.799
100.000	Crelan SA, 6.00%, 28/02/2030	104.450
100.000	Fnac Darty SA, 6.00%, 01/04/2029	102.625
103.000	Lithuania Government International Bond, 3.50%, 03/07/2031	101.862
100.000	Landsbankinn HF, 5.00%, 13/05/2028	101.277
101.000	Slovakia Government Bond, 3.75%, 23/02/2035	101.084
100.000	Virgin Money UK Plc, 4.00%, 18/03/2028	100.220
100.000	BNP Paribas SA, 4.10%, 13/02/2034	100.000

Euro Bond – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

20 ventas de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Producto EUR
970.000	European Union, 3.25%, 04/07/2034	991.876
200.000	Engie SA, 4.25%, 06/03/2044	201.168
169.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.75%, 30/05/2024	167.640
161.000	Spain Government Bond, 3.55%, 31/10/2033	164.740
180.381	French Republic Government Bond OAT, 1.25%, 25/05/2038	142.863
136.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.60%, 01/06/2026	131.629
134.071	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.70%, 15/08/2032	128.248
119.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.88%, 20/10/2034	116.888
100.000	Commerzbank AG, 6.75%, 05/10/2033	107.190
100.000	Bayerische Landesbank, 7.00%, 05/01/2034	106.650
100.000	Crelan SA, 6.00%, 28/02/2030	106.399
100.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 7.25%, 29/12/2049	106.010
100.000	Carmila SA, 5.50%, 09/10/2028	104.180
100.000	Global Payments Inc, 4.88%, 17/03/2031	104.142
100.000	Loxam SAS, 6.38%, 15/05/2028	103.450
100.000	Caisse Francaise de Financement Local, 3.50%, 20/03/2029	103.410
100.000	AT&T Inc, 4.30%, 18/11/2034	103.357
100.000	Fnac Darty SA, 6.00%, 01/04/2029	102.950
100.000	Imerys SA, 4.75%, 29/11/2029	102.294
103.000	Lithuania Government International Bond, 3.50%, 03/07/2031	102.258

Euro Bond Absolute Return – Informe de compras y ventas significativas

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste EUR
1.860.000	European Union, 3.00%, 04/12/2034	1.867.100
1.836.000	European Union, 3.13%, 04/12/2030	1.865.129
1.884.518	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0.13%, 15/04/2026	1.686.466
1.500.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.30%, 15/02/2033	1.487.685
1.425.000	Bundesobligation, 2.10%, 12/04/2029	1.402.884
5.450.000	Republic of Poland Government Bond, 5.75%, 25/04/2029	1.283.816
8.400.000	Nykredit Realkredit AS, 5.00%, 01/10/2053	1.138.867
800.000	Centrica Plc, 6.50%, 21/05/2055	930.365
883.000	Croatia Government International Bond, 3.38%, 12/03/2034	876.061
3.500.000	Republic of Poland Government Bond, 4.75%, 25/07/2029	786.042
700.000	European Financial Stability Facility, 3.50%, 11/04/2029	714.882
700.000	Warnermedia Holdings Inc, 4.69%, 17/05/2033	700.000
700.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2.63%, 26/04/2029	695.181
687.000	Slovakia Government Bond, 3.75%, 23/02/2035	688.414
581.000	AA Bond Co Ltd, 6.85%, 31/07/2031	675.387
630.000	Republic of Poland Government International Bond, 3.63%, 11/01/2034	627.134
500.000	Investec Plc, 10.50%, 29/12/2049	583.807
581.000	Spain Government Bond, 3.45%, 31/10/2034	579.931
500.000	Traton Finance Luxembourg SA, 5.63%, 16/01/2029	579.685
488.000	Schroders Plc, 6.35%, 18/07/2034	570.689

Euro Bond Absolute Return – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

20 ventas de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Producto EUR
5.450.000	Republic of Poland Government Bond, 5.75%, 25/04/2029	1.277.636
4.900.000	Republic of Poland Government Bond, 6.00%, 25/10/2033	1.174.274
1.080.000	European Union, 3.00%, 04/12/2034	1.073.482
1.000.000	Bundesobligation, 2.10%, 12/04/2029	981.270
800.000	Spain Government Bond, 3.55%, 31/10/2033	818.004
700.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2.63%, 26/04/2029	692.192
707.808	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0.13%, 15/04/2026	636.359
500.000	Investec Plc, 10.50%, 29/12/2049	594.184
500.000	Centrica Plc, 6.50%, 21/05/2055	592.046
500.000	Traton Finance Luxembourg SA, 5.63%, 16/01/2029	582.417
488.000	Schroders Plc, 6.35%, 18/07/2034	571.819
4.000.000	Nykredit Realkredit AS, 4.00%, 01/10/2053	526.964
613.000	Slovenia Government Bond, 1.50%, 25/03/2035	512.285
500.000	Orsted AS, 5.13%, 14/03/2024	506.500
500.000	Engie SA, 4.25%, 06/03/2044	502.920
551.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.75%, 15/01/2029	502.369
506.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.20%, 15/08/2025	490.863
400.000	AA Bond Co Ltd, 6.85%, 31/07/2031	471.872
507.000	Romanian Government International Bond, 3.62%, 26/05/2030	465.527
460.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.85%, 01/07/2025	451.913

European High Yield Bond – Informe de compras y ventas significativas

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste EUR
5.348.000	Bellis Acquisition Co Plc, 8.13%, 14/05/2030	6.230.644
5.126.000	Orsted AS, 5.13%, 14/03/2024	5.124.105
4.800.000	Synthomer Plc, 7.38%, 02/05/2029	4.800.000
4.850.000	Castellum AB, 3.13%, 29/12/2049	4.027.824
3.954.000	Neopharmed Gentili SpA, 7.13%, 08/04/2030	3.961.425
3.800.000	Telefonica Europe BV, 5.75%, 29/12/2049	3.800.000
3.825.000	TK Elevator Midco GmbH, 4.38%, 15/07/2027	3.699.232
3.562.000	PLT VII Finance Sarl, 6.00%, 15/06/2031	3.562.000
3.395.000	Fnac Darty SA, 6.00%, 01/04/2029	3.460.944
3.401.000	Forvia SE, 5.50%, 15/06/2031	3.407.243
3.342.000	CT Investment GmbH, 6.38%, 15/04/2030	3.348.319
3.315.000	Sappi Papier Holding GmbH, 3.13%, 15/04/2026	3.248.110
3.080.000	CECONOMY AG, 6.25%, 15/07/2029	3.077.100
3.100.000	Air France-KLM, 4.63%, 23/05/2029	3.071.918
2.820.000	Telecom Italia SpA, 6.88%, 15/02/2028	2.998.818
2.845.000	INEOS Quattro Finance 2 Plc, 8.50%, 15/03/2029	2.980.493
2.995.000	Ontex Group NV, 3.50%, 15/07/2026	2.928.598
3.200.000	Electricite de France SA, 2.63%, 29/12/2049	2.910.400
2.865.000	Boels Topholding BV, 5.75%, 15/05/2030	2.864.553
2.780.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl, 4.88%, 01/06/2028	2.793.186

European High Yield Bond – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto EUR
5.700.000	Cellnex Telecom SA, 1.75%, 23/10/2030	5.040.648
3.545.000	Dana Financing Luxembourg Sarl, 8.50%, 15/07/2031	3.884.331
3.770.000	Telecom Italia SpA, 4.00%, 11/04/2024	3.761.876
3.420.000	Nidda Healthcare Holding GmbH, 7.50%, 21/08/2026	3.546.540
3.392.000	Avis Budget Finance Plc, 7.25%, 31/07/2030	3.410.260
3.000.000	Valeo SE, 5.38%, 28/05/2027	3.097.755
4.240.000	Heimstaden Bostad Treasury BV, 1.63%, 13/10/2031	3.019.310
2.900.000	Bayer AG, 7.00%, 25/09/2083	2.939.850
2.781.000	Helios Software Holdings Inc./ION Corporate Solutions Finance Sarl, 7.88%, 01/05/2029	2.781.000
2.820.000	Primo Water Holdings Inc, 3.88%, 31/10/2028	2.689.128
2.500.000	Deutsche Lufthansa AG, 3.75%, 11/02/2028	2.477.568
2.485.000	Verisure Holding AB, 3.88%, 15/07/2026	2.453.938
2.445.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc, 4.50%, 15/07/2028	2.432.507
2.500.000	Bayer AG, 5.38%, 25/03/2082	2.354.375
1.996.000	Assemblin Caverion Group AB, 8.96%, 05/07/2029	2.043.623
1.875.000	IHO Verwaltungs GmbH, 8.75%, 15/05/2028	2.037.371
2.100.000	Deutsche Lufthansa AG, 3.50%, 14/07/2029	2.031.039
1.860.000	Banijay Entertainment SASU, 7.00%, 01/05/2029	1.956.643
1.850.000	Loxam SAS, 6.38%, 31/05/2029	1.913.300
1.856.000	Kapla Holding SAS, 3.38%, 15/12/2026	1.791.012
1.662.000	Monitchem HoldCo 3 SA, 8.75%, 01/05/2028	1.740.466
1.700.000	Abertis Infraestructuras Finance BV, 3.25%, 29/12/2049	1.655.715
1.645.000	Iliad Holding SASU, 5.13%, 15/10/2026	1.649.113
1.600.000	PrestigeBidCo GmbH, 9.97%, 15/07/2027	1.618.150
1.745.000	Ashland Services BV, 2.00%, 30/01/2028	1.617.615
1.595.000	Altice Financing SA, 2.25%, 15/01/2025	1.539.973
1.525.000	Lion/Polaris Lux 4 SA, 7.84%, 01/07/2026	1.534.600
1.230.000	British Telecommunications Plc, 8.38%, 20/12/2083	1.518.215
1.400.000	Telefonica Europe BV, 6.75%, 29/12/2049	1.500.450
1.550.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 4.38%, 15/01/2028	1.496.525
1.525.000	Forvia SE, 3.75%, 15/06/2028	1.494.500
1.575.000	WEPA Hygieneprodukte GmbH, 2.88%, 15/12/2027	1.482.852
1.470.000	Kapla Holding SAS, 7.22%, 31/07/2030	1.480.680
1.470.000	Q-Park Holding I BV, 5.13%, 01/03/2029	1.473.675

European Sustainable Equity – Informe de compras y ventas significativas

Total compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste EUR
203.720	Compass Group Plc	5.360.940
400.198	Sage Group Plc	5.264.552
401.137	Nibe Industrier AB	2.200.873
5.723	EssilorLuxottica SA	1.178.100
864	Adyen NV	1.031.092
12.685	Scout24 SE	910.595
23.142	Netcompany Group A/S	896.194
8.532	Nestle SA	815.226
13.811	Bakkafrost P/F	708.887
13.356	Alfen NV	452.391
4.024	London Stock Exchange Group Plc	442.511
2.257	Straumann Holding AG	332.281
8.632	Assa Abloy AB Class B	229.642
204	ASML Holding NV	171.175
4.417	RELX Plc	171.159
308	L'Oreal SA	133.229

European Sustainable Equity – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto EUR
136.111	3i Group Plc	4.728.308
5.117	ASML Holding NV	4.680.619
17.016	Schneider Electric SE	3.751.048
26.421	Novo Nordisk A/S Class B	3.361.261
23.614	Euronext NV	2.114.085
50.508	Netcompany Group A/S	2.070.073
73.351	Alfen NV	2.055.433
16.565	London Stock Exchange Group Plc	1.849.797
3.640	VAT Group AG	1.781.693
13.458	Reply SpA	1.738.741
62.959	Assa Abloy AB Class B	1.707.789
401.137	Nibe Industrier AB	1.640.439
1.162	Adyen NV	1.549.712
114.400	TeamViewer SE	1.524.292
25.350	Bakkafrost P/F	1.295.162
12.790	Nestle SA	1.277.691
2.798	L'Oreal SA	1.234.225
28.591	RELX Plc	1.200.721
928	Partners Group Holding AG	1.142.370
137.963	HelloFresh SE	973.853
25.840	SolarEdge Technologies Inc	926.343
4.420	EssilorLuxottica SA	914.056
2.482	Kering SA	801.491
54.001	CVS Group Plc	786.490
6.275	Straumann Holding AG	754.825
10.449	Scout24 SE	728.818
27.761	Compass Group Plc	727.303
4.957	Beiersdorf AG	697.878
54.540	Sage Group Plc	690.915
1.893	Tecan Group AG	634.951
35.078	Atlas Copco AB Class A	630.308

Event Driven – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
13.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 05/09/2024	12.860.531
9.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 06/08/2024	8.925.202
8.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/07/2024	7.869.284
7.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 02/05/2024	6.908.913
7.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 29/08/2024	6.908.116
7.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 20/06/2024	6.888.285
7.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 07/05/2024	6.879.678
7.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2024	6.873.083
7.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 06/06/2024	6.869.036
7.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/05/2024	6.868.959
7.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/05/2024	6.868.446
7.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2024	6.862.496
6.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 26/09/2024	5.921.625
6.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2024	5.909.919
6.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2024	5.903.596
6.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/07/2024	5.898.454
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/05/2024	4.939.819
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 12/09/2024	4.938.785
3.055.000	Wells Fargo Bank NA, 6.44%, 11/12/2026	3.095.831
3.000.000	Citigroup Inc, 6.90%, 17/03/2026	3.026.394
3.000.000	Morgan Stanley, 6.32%, 18/02/2026	3.011.721
3.000.000	Goldman Sachs Bank USA, 6.14%, 18/03/2027	3.002.340
3.000.000	JPMorgan Chase & Co, 5.93%, 23/06/2025	3.001.803
2.960.000	JPMorgan Chase & Co, 6.29%, 24/02/2026	2.972.201
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/04/2024	2.960.268
2.535.000	Caterpillar Financial Services Corp, 5.89%, 14/05/2027	2.535.000
2.568.000	Georgia Power Co, 2.20%, 15/09/2024	2.529.352
2.500.000	American Express Co, 6.71%, 30/10/2026	2.529.103
2.500.000	Bristol-Myers Squibb Co, 5.86%, 20/02/2026	2.509.793
2.500.000	John Deere Capital Corp, 5.93%, 07/03/2025	2.507.675
2.500.000	Oracle Corp, 2.95%, 15/11/2024	2.462.000
2.500.000	US Bank NA, 2.05%, 21/01/2025	2.446.375
2.415.000	JPMorgan Chase & Co, 6.24%, 22/04/2027	2.426.452
2.430.000	Capital One Financial Corp, 3.30%, 30/10/2024	2.401.227
2.100.000	Home Depot Inc, 5.70%, 24/12/2025	2.100.912

Event Driven – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Total ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
7.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/04/2024	6.998.986
7.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2024	6.983.808
7.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 02/05/2024	6.977.512
7.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 07/05/2024	6.972.343
6.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/04/2024	5.982.462
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/04/2024	4.995.620
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/04/2024	4.990.529
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/05/2024	4.984.939
3.000.000	JPMorgan Chase & Co, 5.93%, 23/06/2025	3.001.581
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/04/2024	2.996.502
2.435.000	JPMorgan Chase & Co, 6.29%, 24/02/2026	2.443.441
41.994	Viking Holdings Ltd	1.098.143
9.816	Astera Labs Inc	515.929
10.536	Rubrik Inc Class A	406.690
3.174	Ibotta Inc Class A	371.358
8.008	Loar Holdings Inc	360.360
7.826	Bowhead Specialty Holdings Inc Class I	179.998
747	CG Oncology Inc	21.663
293	UL Solutions Inc Class A	10.029

Global Bond – Informe de compras y ventas significativas

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
3.416.000	State of Lower Saxony, 2.63%, 09/01/2034	3.714.673
3.165.000	United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 15/02/2034	3.083.382
2.832.336	Bundesobligation, 2.10%, 12/04/2029	2.993.297
2.659.595	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.20%, 15/02/2034	2.824.514
2.000.000	Estonia Government International Bond, 3.25%, 17/01/2034	2.175.491
1.600.000	United Kingdom Gilt, 1.50%, 22/07/2026	1.922.312
1.720.000	Land Berlin, 3.00%, 13/03/2054	1.846.973
1.500.000	State of Mecklenburg – Western Pomerania, 2.55%, 12/01/2032	1.636.867
1.500.000	Romanian Government International Bond, 5.63%, 22/02/2036	1.599.335
1.400.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.85%, 01/07/2034	1.507.723
1.500.000	Province of Manitoba Canada, 4.90%, 31/05/2034	1.495.890
1.331.000	Spain Government Bond, 3.25%, 30/04/2034	1.454.451
1.266.000	Spain Government Bond, 3.45%, 31/10/2034	1.366.533
192.900.000	Japan Government Ten Year Bond, 0.50%, 20/03/2033	1.229.232
1.075.000	United States Treasury Note/Bond, 4.50%, 15/11/2033	1.111.889
7.150.000	Nykredit Realkredit AS, 5.00%, 01/10/2053	1.044.442
1.200.000	PSP Capital Inc, 3.75%, 15/06/2029	871.865
835.000	Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/02/2055	845.666
835.000	Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/03/2055	842.632
835.000	Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/04/2054	842.469

Global Bond – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
3.416.000	State of Lower Saxony, 2.63%, 09/01/2034	3.664.977
3.165.000	United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 15/02/2034	3.065.339
2.050.000	State of Hesse, 2.88%, 04/07/2033	2.288.600
2.065.000	United States Treasury Note/Bond, 4.50%, 15/11/2033	2.147.322
1.720.000	Land Berlin, 3.00%, 13/03/2054	1.819.365
1.755.000	United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 15/08/2053	1.703.980
1.500.000	Gemeinsame Deutsche Bundeslaender, 3.00%, 26/04/2030	1.644.881
1.500.000	Romanian Government International Bond, 5.63%, 22/02/2036	1.622.709
1.500.000	State of Mecklenburg – Western Pomerania, 2.55%, 12/01/2032	1.598.020
1.300.000	State of Brandenburg, 3.00%, 20/07/2033	1.465.164
1.236.000	Autonomous Community of Madrid Spain, 3.60%, 30/04/2033	1.354.862
980.000	Schleswig-Holstein, Land, 3.00%, 05/06/2030	1.072.419
1.000.000	Estonia Government International Bond, 3.25%, 17/01/2034	1.063.526
6.993.777	Nykredit Realkredit AS, 4.00%, 01/10/2053	989.972
905.000	Land Berlin, 3.00%, 11/07/2031	989.668
785.000	Land Berlin, 3.00%, 04/05/2028	877.129
1.261.000	Canadian Government Bond, 2.25%, 01/06/2029	873.285
835.000	Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/01/2055	845.568
835.000	Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/02/2055	842.959
835.000	Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/03/2055	842.437
835.000	Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/06/2054	840.088
835.000	Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/04/2054	838.131
835.000	Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/05/2054	835.783
742.000	Land Baden-Wuerttemberg, 3.00%, 27/06/2033	833.135
742.000	Autonomous Community of Madrid Spain, 3.36%, 31/10/2028	808.149

Global Diversified Income FMP - 2024 – Informe de compras y ventas significativas

Total compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
35.290.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/06/2024	35.005.866
33.130.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/04/2024	32.718.412
30.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 12/06/2025	28.583.276
28.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2024	27.848.557
18.390.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 14/05/2024	18.239.186

Total ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
30.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 12/06/2025	28.577.280
7.060.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/04/2024	7.003.389
4.000.000	Barclays Plc, 4.38%, 11/09/2024	3.986.000
3.850.000	Synchrony Financial, 4.25%, 15/08/2024	3.839.875
3.685.000	EQM Midstream Partners LP, 4.00%, 01/08/2024	3.666.944
3.005.000	Buckeye Partners LP, 4.35%, 15/10/2024	2.989.975
2.600.000	Societe Generale SA, 2.63%, 16/10/2024	2.573.142
2.500.000	SNB Funding Ltd, 2.75%, 02/10/2024	2.476.500
1.930.000	Live Nation Entertainment Inc, 4.88%, 01/11/2024	1.921.315
1.600.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd, 3.25%, 13/11/2024	1.570.982
1.250.000	REC Ltd, 3.38%, 25/07/2024	1.236.375
1.100.000	Anglo American Capital Plc, 3.63%, 11/09/2024	1.093.213
1.000.000	Weibo Corp, 3.50%, 05/07/2024	998.500
889.000	Wynn Macau Ltd, 4.88%, 01/10/2024	884.111
889.000	Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd, 3.38%, 29/12/2049	883.666
450.000	REC Ltd, 3.50%, 12/12/2024	441.576
400.000	ABJA Investment Co Pte Ltd, 5.95%, 31/07/2024	399.404
249.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd, 3.38%, 24/07/2024	247.929

Global Equity Megatrends – Informe de compras y ventas significativas

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
71.868	Chart Industries Inc	10.737.527
275.230	Perrigo Co Plc	7.923.952
42.551	Nice Ltd ADR	7.727.997
82.609	Amdocs Ltd	6.875.013
78.927	Alibaba Group Holding Ltd ADR	5.779.031
197.654	ModivCare Inc	5.291.802
43.402	Expedia Group Inc	5.233.446
1.420.239	Pets at Home Group Plc	5.098.823
116.716	Scholastic Corp	4.254.515
77.386	Stericycle Inc	3.573.958
15.569	Tetra Tech Inc	2.695.774
48.884	Delta Air Lines Inc	1.900.537
50.925	Corning Inc	1.617.184
75.520	Gen Digital Inc	1.593.139
47.073	Criteo SA ADR	1.426.013
123.564	Despegar.com Corp	1.273.364
69.877	Element Fleet Management Corp	1.181.685
8.477	Alphabet Inc Class A	1.170.838
29.161	ATI Inc	1.156.775
69.321	Zeta Global Holdings Corp Class A	644.393

Global Equity Megatrends – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

20 ventas de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
57.856	Vistra Corp	4.563.699
66.420	Stericycle Inc	3.919.238
24.555	TE Connectivity Ltd	3.498.760
58.008	Zeta Global Holdings Corp Class A	934.423
43.041	Despegar.com Corp	599.471
7.605	Uber Technologies Inc	569.642
9.844	Gen Digital Inc	220.764
697	Expedia Group Inc	101.961
2.868	Perrigo Co Plc	96.921
3.852	Criteo SA ADR	93.599
22.661	Pets at Home Group Plc	88.534
1.200	Alibaba Group Holding Ltd ADR	87.734
2.036	Delta Air Lines Inc	82.293
1.994	ModivCare Inc	81.026
918	Amdocs Ltd	80.151
2.550	Corning Inc	77.784
535	Alphabet Inc Class A	72.557
4.209	Element Fleet Management Corp	69.346
1.816	Scholastic Corp	67.566
2.982	Element Solutions Inc	66.757

Global Flexible Credit Income – Informe de compras y ventas significativas

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
2.605.000	UKG Inc, 6.88%, 01/02/2031	2.627.231
2.500.000	Aimco CLO 16 Ltd Series 2021-16X Class D1R, 0.00%, 17/07/2037	2.500.000
2.610.000	HealthEquity Inc, 4.50%, 01/10/2029	2.404.463
2.265.000	XPO Inc, 7.13%, 01/02/2032	2.342.749
2.125.000	AmWINS Group Inc, 6.38%, 15/02/2029	2.133.912
2.000.000	AGL CLO 9 Ltd Series 2020-9X Class DR, 8.87%, 20/04/2037	2.000.000
2.000.000	Ballyrock CLO 26 Ltd Series 2024-26X Class C1, 8.63%, 25/07/2037	2.000.000
2.000.000	Canyon CLO 2023-2 Ltd Series 2023-2X Class D, 8.92%, 15/05/2037	2.000.000
2.000.000	GoldenTree Loan Management US CLO 9 Ltd Series 2021-9X Class DR, 8.67%, 20/04/2037	2.000.000
2.000.000	Invesco US CLO 2024-2 Ltd Series 2024-2X Class D, 8.92%, 15/07/2037,	2.000.000
2.000.000	Invesco US CLO 2024-1 Ltd Series 2024-1RX Class ER, 12.72%, 15/04/2037	2.000.000
2.000.000	Oaktree CLO 2024-26 Ltd Series 2024-26X Class D1, 8.78%, 20/04/2037	2.000.000
2.000.000	Symphony CLO 43 Ltd Series 2024-43X Class E, 12.08% 15/04/2037	2.000.000
1.960.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp, 6.63%, 01/02/2032	1.960.000
2.120.000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc, 5.25%, 15/08/2029	1.955.700
1.905.000	Wand NewCo 3 Inc, 7.63%, 30/01/2032	1.947.863
2.090.000	Medline Borrower LP, 5.25%, 01/10/2029	1.943.578
1.930.000	Six Flags Entertainment Corp, 7.25%, 15/05/2031	1.939.034
1.800.000	Regal Rexnord Corp, 6.40%, 15/04/2033	1.867.266
1.900.000	T-Mobile USA Inc, 5.15%, 15/04/2034	1.835.970

Global Flexible Credit Income – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

20 ventas de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
5.080.000	United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/05/2043	4.631.595
3.540.000	APX Group Inc, 5.75%, 15/07/2029	3.350.396
2.595.000	Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp, 8.50%, 15/10/2026	2.600.066
2.400.000	KB Home, 7.25%, 15/07/2030	2.475.000
2.435.000	New Fortress Energy Inc, 6.50%, 30/09/2026	2.333.243
2.085.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp, 8.25%, 31/12/2028	2.118.844
2.035.000	Camelot Return Merger Sub Inc, 8.75%, 01/08/2028	2.010.513
2.400.000	EPR Properties, 3.60%, 15/11/2031	1.999.272
1.905.000	Ford Motor Credit Co LLC, 7.20%, 10/06/2030	1.996.500
2.010.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc, 6.25%, 15/01/2028	1.968.652
2.400.000	Broadcom Inc, 3.19%, 15/11/2036	1.839.672
1.960.000	HealthEquity Inc, 4.50%, 01/10/2029	1.827.700
2.000.000	CDW LLC/CDW Finance Corp, 3.28%, 01/12/2028	1.803.540
1.780.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC, 6.50%, 15/02/2028	1.790.057
1.955.000	Energizer Holdings Inc, 4.75%, 15/06/2028	1.786.381
1.740.000	White Cap Buyer LLC, 6.88%, 15/10/2028	1.684.588
1.635.000	Tenet Healthcare Corp, 6.13%, 01/10/2028	1.619.581
1.470.000	Service Properties Trust, 8.63%, 15/11/2031	1.543.500
1.370.000	Carnival Holdings Bermuda Ltd, 10.38%, 01/05/2028	1.495.013
1.685.000	Goodyear Tire & Rubber Co, 5.25%, 15/07/2031	1.494.794

Global High Yield SDG Engagement – Informe de compras y ventas significativas

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
4.125.000	Medline Borrower LP, 5.25%, 01/10/2029	3.883.018
1.900.000	Telecom Italia SpA, 7.88%, 31/07/2028	2.283.991
2.270.000	Block Inc, 6.50%, 15/05/2032	2.274.713
2.100.000	XPO Inc, 7.13%, 01/02/2032	2.155.174
2.140.000	UKG Inc, 6.88%, 01/02/2031	2.144.996
1.682.000	Bellis Acquisition Co Plc, 8.13%, 14/05/2030	2.101.065
1.700.000	Telefonica Europe BV, 6.75%, 29/12/2049	1.975.954
1.855.000	Surgery Center Holdings Inc, 7.25%, 15/04/2032	1.865.214
1.780.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 7.00%, 15/01/2031	1.814.694
1.800.000	Veolia Environnement SA, 2.50%, 29/12/2049	1.751.654
1.690.000	CSC Holdings LLC, 11.75%, 31/01/2029	1.693.559
1.870.000	Kaiser Aluminum Corp, 4.50%, 01/06/2031	1.668.500
1.580.000	Adient Global Holdings Ltd, 8.25%, 15/04/2031	1.660.473
1.400.000	Electricite de France SA, 7.50%, 29/12/2049	1.641.283
1.615.000	Six Flags Entertainment Corp, 7.25%, 15/05/2031	1.633.799
1.810.000	Sunrise FinCo I BV, 4.88%, 15/07/2031	1.624.060
1.495.000	Orsted AS, 5.13%, 14/03/3024	1.614.936
1.805.000	Braskem Netherlands Finance BV, 7.25%, 13/02/2033	1.610.450
1.600.000	United Rentals North America Inc, 6.13%, 15/03/2034	1.592.040
1.181.000	British Telecommunications Plc, 8.38%, 20/12/2083	1.579.427

Global High Yield SDG Engagement – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

20 ventas de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
3.050.000	GTCR AP Finance Inc, 8.00%, 15/05/2027	3.052.394
3.055.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp, 5.88%, 30/06/2029	2.877.261
2.645.000	Energizer Holdings Inc, 6.50%, 31/12/2027	2.622.506
2.370.000	Solaris Midstream Holdings LLC, 7.63%, 01/04/2026	2.385.225
2.125.000	Civitas Resources Inc, 8.63%, 01/11/2030	2.275.579
2.080.000	NCL Corp Ltd, 8.13%, 15/01/2029	2.177.774
2.100.000	Windsor Holdings III LLC, 8.50%, 15/06/2030	2.163.000
2.705.000	Nemak SAB de CV, 3.63%, 28/06/2031	2.117.825
2.105.000	SRS Distribution Inc, 6.13%, 01/07/2029	2.108.488
2.060.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc, 5.75%, 15/04/2026	2.060.740
2.030.000	Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp, 8.50%, 15/10/2026	2.050.300
2.075.000	PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp, 7.75%, 15/02/2029	2.043.544
1.953.000	Alsea SAB de CV, 7.75%, 14/12/2026	1.980.138
1.811.000	Telecom Italia SpA, 2.88%, 28/01/2026	1.917.730
1.855.000	Masonite International Corp, 5.38%, 01/02/2028	1.837.415
1.905.000	Legacy LifePoint Health LLC, 4.38%, 15/02/2027	1.767.943
2.040.000	Ford Motor Credit Co LLC, 2.90%, 10/02/2029	1.759.500
3.000.000	CSC Holdings LLC, 5.75%, 15/01/2030	1.623.840
1.515.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7.88%, 15/09/2029	1.621.002
1.625.000	Presidio Holdings Inc, 8.25%, 01/02/2028	1.617.306

Global Investment Grade Credit – Informe de compras y ventas significativas

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
1.315.000	United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 31/03/2029	1.304.834
784.000	AA Bond Co Ltd, 6.85%, 31/07/2031	992.557
700.000	BPCE SA, 5.38%, 22/10/2031	888.191
800.000	Crelan SA, 5.25%, 23/01/2032	868.274
628.000	Schroders Plc, 6.35%, 18/07/2034	786.225
600.000	Centrica Plc, 6.50%, 21/05/2055	755.340
600.000	Anglo American Capital Plc, 4.13%, 15/03/2032	654.379
600.000	Schaeffler AG, 4.50%, 28/03/2030	646.169
700.000	European Union, 0.00%, 04/07/2031	612.809
600.000	Banco Santander SA, 5.55%, 14/03/2028	600.000
585.000	Fiserv Inc, 5.15%, 15/03/2027	584.421
560.000	Lloyds Banking Group Plc, 5.68%, 05/01/2035	558.627
550.000	Citibank NA, 5.57%, 30/04/2034	548.537
431.000	Barclays Plc, 5.85%, 21/03/2035	545.402
500.000	Morgan Stanley, 3.96%, 21/03/2035	544.275
500.000	Warnermedia Holdings Inc, 4.69%, 17/05/2033	541.250
500.000	Brenntag Finance BV, 3.88%, 24/04/2032	527.528
610.000	JPMorgan Chase & Co, 2.58%, 22/04/2032	513.471
400.000	KBC Group NV, 6.15%, 19/03/2034	512.260
400.000	Traton Finance Luxembourg SA, 5.63%, 16/01/2029	506.320

Global Investment Grade Credit – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

20 ventas de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
1.315.000	United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 31/03/2029	1.291.831
1.090.000	WEC Energy Group Inc, 4.75%, 09/01/2026	1.079.601
900.000	JPMorgan Chase & Co, 4.01%, 23/04/2029	860.940
700.000	Dell International LLC/EMC Corp, 5.30%, 01/10/2029	703.640
600.000	Anglo American Capital Plc, 4.13%, 15/03/2032	654.260
600.000	UBS Group AG, 3.25%, 02/04/2026	640.603
635.000	United States Treasury Note/Bond, 4.38%, 15/12/2026	638.743
640.000	HSBC Holdings Plc, 2.01%, 22/09/2028	572.620
500.000	Bayerische Landesbank, 7.00%, 05/01/2034	571.905
685.000	Bank of America Corp, 1.90%, 23/07/2031	559.692
530.000	European Union, 0.80%, 04/07/2025	554.554
595.000	Athene Global Funding, 1.61%, 29/06/2026	541.093
540.000	Cox Communications Inc, 5.70%, 15/06/2033	540.653
500.000	Brenntag Finance BV, 3.88%, 24/04/2032	533.960
400.000	Ford Motor Credit Co LLC, 5.63%, 09/10/2028	505.443
500.000	T-Mobile USA Inc, 3.75%, 15/04/2027	481.305
480.000	Comcast Corp, 4.80%, 15/05/2033	467.347
500.000	Thames Water Utilities Finance Plc, 4.38%, 18/01/2031	464.023
440.000	Oracle Corp, 6.15%, 09/11/2029	461.520
410.000	HSBC Holdings Plc, 4.79%, 10/03/2032	460.736

Global Opportunistic Bond – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
1.170.279	Bundesobligation, 2.10%, 12/04/2029	1.255.079
116.250.000	Japan Government Ten Year Bond, 0.80%, 20/03/2034	733.065
529.000	United States Treasury Note/Bond, 4.25%, 31/05/2025	524.662
495.000	Ginnie Mae, 5.50%, 01/02/2055	499.294
495.000	Ginnie Mae, 5.50%, 01/04/2054	495.029
495.000	Ginnie Mae, 5.50%, 01/03/2054	494.954
495.000	Ginnie Mae, 5.50%, 01/05/2054	489.747
9.000.000	Mexican Bonos, 7.75%, 23/11/2034	468.194
395.000	Ginnie Mae, 6.00%, 01/07/2054	398.132
395.000	Ginnie Mae, 6.00%, 01/05/2054	395.895
395.000	Ginnie Mae, 6.00%, 01/06/2054	395.185
8.340.000	Czech Republic Government Bond, 4.50%, 11/11/2032	388.814
300.000	Centrica Plc, 6.50%, 21/05/2055	377.670
356.000	United States Treasury Note/Bond, 4.88%, 31/05/2026	356.279
350.000	Ginnie Mae, 5.00%, 01/02/2055	348.400
350.000	Ginnie Mae, 5.00%, 01/04/2054	344.217
350.000	Ginnie Mae, 5.00%, 01/03/2054	343.492
350.000	Ginnie Mae, 5.00%, 01/05/2054	339.322
315.000	Ginnie Mae, 5.50%, 01/07/2038	313.058
315.000	Ginnie Mae, 5.50%, 01/06/2054	311.630
300.000	United States Treasury aNote/Bond, 4.50%, 31/05/2029	300.927

Global Opportunistic Bond – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
3.297.000	New Zealand Government Bond, 3.50%, 14/04/2033	1.833.085
3.099.000	Republic of Poland Government Bond, 6.00%, 25/10/2033	820.634
11.640.000	Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031	597.035
495.000	Ginnie Mae, 5.50%, 01/01/2055	499.216
8.108.000.000	Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033	496.648
495.000	Ginnie Mae, 5.50%, 01/02/2055	495.070
495.000	Ginnie Mae, 5.50%, 01/03/2054	495.068
495.000	Ginnie Mae, 5.50%, 01/04/2054	490.308
495.000	Ginnie Mae, 5.50%, 01/05/2054	488.663
488.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.65%, 16/07/2032	480.898
395.000	Ginnie Mae, 6.00%, 01/06/2054	398.425
395.000	Ginnie Mae, 6.00%, 01/05/2054	397.191
300.000	Volkswagen Financial Services NV, 4.25%, 09/10/2025	373.551
370.000	Verizon Communications Inc, 1.88%, 26/10/2029	362.630
350.000	Ginnie Mae, 5.00%, 01/01/2055	348.250
350.000	Ginnie Mae, 5.00%, 01/03/2054	344.135
350.000	Ginnie Mae, 5.00%, 01/02/2055	343.451
350.000	Ginnie Mae, 5.00%, 01/04/2054	339.336
350.000	Ginnie Mae, 5.00%, 01/05/2054	335.398
1.164.000	Republic of Poland Government Bond, 7.50%, 25/07/2028	320.363
315.000	Ginnie Mae, 5.50%, 01/06/2054	313.226
338.309	Freddie Mac Pool, 4.00%, 01/09/2052	312.672
300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.25%, 03/06/2030	281.941

Global Real Estate Securities – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
3.027	AvalonBay Communities Inc	543.536
218	Comforia Residential REIT Inc	453.263
4.477	Camden Property Trust	421.928
15.225	Warehouses de Pauw CVA	419.664
9.270	Brookfield Corp	379.129
467	Equinix Inc	367.975
6.780	Gaming & Leisure Properties Inc	312.200
10.192	Vonovia SE	308.736
32.500	Sun Hung Kai Properties Ltd	307.528
7.855	UDR Inc	291.216
12.064	Goodman Group	259.903
1.857	Digital Realty Trust Inc	259.771
6.607	Cellnex Telecom SA	233.373
4.716	Ventas Inc	230.987
52	Nippon Accommodations Fund Inc Class A	218.903
7.000	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	216.120
72.328	Stockland	214.256
2.782	Iron Mountain Inc	213.438
32.573	Inmobiliaria Colonial Socimi SA	208.064
1.634	Sun Communities Inc	204.369
1.886	Federal Realty Investment Trust	190.602
1.485	Prologis Inc	190.190
962	American Tower Corp	189.652
7.500	Nomura Real Estate Holdings Inc	189.620
11.603	Macerich Co	181.703
6.573	Essential Properties Realty Trust Inc	179.564
1.357	PSP Swiss Property AG	176.114
14.125	American Healthcare REIT Inc	169.878
4.865	Invitation Homes Inc	167.310
511	Public Storage	144.392
661	SBA Communications Corp Class A	140.235
815	Simon Property Group Inc	116.716
1.515	Unibail-Rodamco-Westfield	114.471

Global Real Estate Securities – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
29.400	Mitsui Fudosan Co Ltd	438.240
11.315	Apartment Income REIT Corp	429.413
38.597	Merlin Properties Socimi SA	422.787
405	LaSalle Logiport REIT	418.627
394.000	Sino Land Co Ltd	413.151
1.732	Essex Property Trust Inc	403.066
3.708	Gecina SA	375.440
3.152	Crown Castle Inc	331.655
2.456	PSP Swiss Property AG	307.399
4.970	Equity Residential	296.259
15.577	Kimco Realty Corp	293.067
1.860	Extra Space Storage Inc	281.411
9.438	VICI Properties Inc Class A	277.062
896	Public Storage	255.928
172.053	Region RE Ltd	253.020
62	Nippon Building Fund Inc	242.355
52	Nippon Accommodations Fund Inc Class A	213.504
43.000	CK Asset Holdings Ltd	193.873
1.180	Simon Property Group Inc	177.480
1.601	Swiss Prime Site AG	155.510
2.453	Boston Properties Inc	153.680
176	Equinix Inc	148.582
8.798	Urban Edge Properties	147.364
30.467	Great Portland Estates Plc	147.353
2.760	Gaming & Leisure Properties Inc	122.046
1.455	Iron Mountain Inc	113.227
600	AvalonBay Communities Inc	110.803
553	American Tower Corp	106.260
1.943	Realty Income Corp	101.886
597	EastGroup Properties Inc	97.364
780	Prologis Inc	97.265
429	SBA Communications Corp Class A	95.568
975	Welltower Inc	88.263

Global Sustainable Equity – Informe de compras y ventas significativas

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
5.937	NVIDIA Corp	6.710.294
3.586	Broadcom Inc	4.564.908
31.198	CoStar Group Inc	2.593.933
27.791	Uber Technologies Inc	2.080.253
3.055	Eli Lilly & Co	1.925.932
3.847	Kinsale Capital Group Inc	1.681.419
1.903	ASML Holding NV	1.401.130
18.809	Nasdaq Inc	1.126.279
2.568	Microsoft Corp	971.255
642	Adyen NV	817.056
4.902	Amazon.com Inc	734.579
1.088	Adobe Inc	557.142
3.077	Alphabet Inc Class A	441.837
626	Netflix Inc	298.201
1.636	Zoetis Inc Class A	269.884
488	L'Oreal SA	227.259
2.329	Starbucks Corp	214.176
1.899	Abbott Laboratories	212.179
1.461	Nestle SA	166.674
2.243	Brown & Brown Inc	163.967

Global Sustainable Equity – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
5.826	Intuit Inc	3.695.525
5.919	Synopsys Inc	2.906.223
6.937	Microsoft Corp	2.888.645
3.188	VAT Group AG	1.604.969
8.717	Amazon.com Inc	1.567.508
48.948	Alfen NV	1.548.745
2.654	UnitedHealth Group Inc	1.366.108
2.029	Netflix Inc	1.272.537
2.474	Elevance Health Inc	1.207.396
1.270	ASML Holding NV	1.199.174
4.297	Schneider Electric SE	1.011.902
1.776	Thermo Fisher Scientific Inc	1.011.615
5.455	Alphabet Inc Class A	875.474
595	Adyen NV	869.913
4.004	Applied Materials Inc	863.783
24.155	3i Group Plc	861.137
1.817	Mastercard Inc Class A	860.801
1.791	S&P Global Inc	759.592
93.223	HelloFresh SE	719.076
14.500	Recruit Holdings Co Ltd	714.339
21.006	SolarEdge Technologies Inc	703.625
1.627	Moody's Corp	624.948
7.677	Starbucks Corp	606.003
2.023	Visa Inc Class A	573.975
3.580	Estee Lauder Cos Inc Class A	464.653
4.836	Brown & Brown Inc	408.802
289	Broadcom Inc	400.771
6.317	Bakkafrost P/F	394.792
819	L'Oreal SA	393.792

Global Sustainable Value – Informe de compras y ventas significativas

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
374	Booking Holdings Inc	1.375.486
4.747	QUALCOMM Inc	785.570
9.278	Medtronic Plc	762.381
227.826	Intesa Sanpaolo SpA	760.293
18.328	Verizon Communications Inc	732.016
3.724	Apple Inc	670.977
2.280	Cummins Inc	628.081
11.995	eBay Inc	607.132
5.791	Novartis AG	571.151
3.245	Alphabet Inc Class A	529.396
2.261	American Express Co	495.192
12.386	UniCredit SpA	484.661
3.128	Johnson & Johnson	481.293
12.464	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	481.055
6.357	Masco Corp	474.886
75.443	BP Plc	464.049
1.582	NXP Semiconductors NV	423.509
3.785	NetApp Inc	418.946
2.814	TE Connectivity Ltd	417.544
4.074	Bunge Global SA	413.409

Global Sustainable Value – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
707	Broadcom Inc	918.237
190	Booking Holdings Inc	687.113
10.174	Gilead Sciences Inc	660.400
50.500	Honda Motor Co Ltd	562.935
12.067	Cisco Systems Inc	559.277
1.362	Home Depot Inc	488.792
4.853	Bayerische Motoren Werke AG	478.092
10.700	Bridgestone Corp	455.404
14.194	UniCredit SpA	443.917
1.496	McDonald's Corp	423.527
3.455	Expeditors International of Washington Inc	412.483
773	Parker-Hannifin Corp	371.441
5.403	Coca-Cola Europacific Partners Plc	366.201
23.741	Credit Agricole S.A	354.549
499.827	Lloyds Banking Group Plc	349.749
154.061	Barclays Plc	343.122
7.659	Deutsche Post AG	323.564
10.900	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	316.941
1.136	Amgen Inc	316.157
4.540	Cognizant Technology Solutions Corp Class A	300.625
5.127	Samsung Electronics Co Ltd	294.477
18.118	Eni SpA	291.981
1.239	Illinois Tool Works Inc	291.177
769	Humana Inc	289.193
54.705	Santos Ltd	278.235
513	Ulta Beauty Inc	276.827
6.730	Brookfield Asset Management Ltd Class A	263.738
9.198	Fox Corp Class B	258.771
4.395	Bank of New York Mellon Corp	258.426
5.037	Molson Coors Beverage Co Class B	256.078
2.500	Hitachi Ltd	255.767
946	Roche Holding AG	255.636
916	Kuehne + Nagel International AG	249.973

High Yield Bond – Informe de compras y ventas significativas

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
21.565.000	Medline Borrower LP, 5.25%, 01/10/2029	20.304.846
11.205.000	Block Inc, 6.50%, 15/05/2032	11.221.175
10.155.000	CSC Holdings LLC, 11.75%, 31/01/2029	10.209.450
9.765.000	UKG Inc, 6.88%, 01/02/2031	9.781.350
9.076.000	Cotiviti Inc, 15.25%, 05/01/2031	9.076.000
8.290.000	Vistra Operations Co LLC, 6.88%, 15/04/2032	8.290.000
8.065.000	Surgery Center Holdings Inc, 7.25%, 15/04/2032	8.109.063
8.050.000	Fortress Intermediate 3 Inc, 7.50%, 01/06/2031	8.103.063
8.100.000	Allied Universal Holdco LLC, 7.88%, 15/02/2031	8.094.475
8.465.000	Cloud Software Group Inc, 6.50%, 31/03/2029	7.985.784
7.725.000	Wand NewCo 3 Inc, 7.63%, 30/01/2032	7.812.588
7.735.000	Royal Caribbean Cruises Ltd, 6.25%, 15/03/2032	7.735.000
7.400.000	United Rentals North America Inc, 6.13%, 15/03/2034	7.390.381
6.895.000	Arsenal AIC Parent LLC, 11.50%, 01/10/2031	7.343.175
7.075.000	XPO Inc, 7.13%, 01/02/2032	7.327.636
7.985.000	UPC Broadband Finco BV, 4.88%, 15/07/2031	7.189.438
7.150.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc, 7.50%, 06/11/2030	7.150.000
7.145.000	LifePoint Health Inc, 10.00%, 01/06/2032	7.145.000
7.863.000	H&E Equipment Services Inc, 3.88%, 15/12/2028	7.136.492
7.065.000	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC, 7.00%, 01/05/2031	7.065.000

High Yield Bond – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

20 ventas de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
35.890.000	United States Treasury Note/Bond, 5.00%, 31/08/2025	36.179.840
17.485.000	New Fortress Energy Inc, 6.50%, 30/09/2026	16.743.091
14.575.000	Parexel International Inc, 8.71%, 15/11/2028	14.575.000
11.615.000	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.75%, 20/04/2029	11.328.113
9.980.000	Energizer Holdings Inc, 6.50%, 31/12/2027	9.897.700
9.155.000	Civitas Resources Inc, 8.63%, 01/11/2030	9.807.248
7.970.000	Camelot Return Merger Sub Inc, 8.75%, 01/08/2028	7.925.223
7.645.000	EquipmentShare.com Inc, 9.00%, 15/05/2028	7.830.142
14.630.000	CSC Holdings LLC, 5.75%, 15/01/2030	7.764.629
7.735.000	Royal Caribbean Cruises Ltd, 6.25%, 15/03/2032	7.764.006
8.150.000	NRG Energy Inc, 5.25%, 15/06/2029	7.743.588
8.440.000	Pilgrim's Pride Corp, 4.25%, 15/04/2031	7.437.855
7.430.000	JPMorgan Chase & Co, 4.60%, 29/12/2049	7.324.625
7.765.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 5.00%, 01/02/2028	7.279.252
7.630.000	VICI Properties Inc Class A, 5.13%, 15/05/2032	7.240.334
6.945.000	Pilgrim's Pride Corp, 6.25%, 01/07/2033	7.028.848
6.770.000	Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp, 8.50%, 15/10/2026	6.837.700
6.645.000	Carnival Corp, 7.63%, 01/03/2026	6.690.198
6.935.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC, 4.88%, 15/02/2030	6.583.281
6.371.000	Level 3 Financing Inc, 4.63%, 15/09/2027	6.550.789

InnovAsia 5G – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
16.200	Towa Corp	916.280
21.000	MediaTek Inc	792.522
11.000	ASMedia Technology Inc	679.343
34.000	Phison Electronics Corp	672.159
41.100	SUMCO Corp	660.029
76.000	Chroma ATE Inc	648.395
21.400	Kokusai Electric Corp	624.035
23.800	Taiyo Yuden Co Ltd	601.671
11.300	SoftBank Group Corp	599.592
51.700	Appier Group Inc	585.179
25.000	Auras Technology Co Ltd	576.540
2.300	Maruwa Co Ltd	563.678
22.113	Techwing Inc	528.203
65.000	Fitipower Integrated Technology Inc	519.929
41.700	ASM Pacific Technology Ltd	517.177
984.000	Innolux Corp	509.016
28.200	MISUMI Group Inc	492.717
16.200	Micronics Japan Co Ltd	489.097
12.000	Lotes Co Ltd	484.531
15.100	Socionext Inc	464.791
38.000	Silergy Corp	461.918
9.000	Global Unichip Corp	456.460
115.800	Shenzhen Envicool Technology Co Ltd Class A	451.570
15.400	Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd	430.921
2.420	HD Hyundai Electric Co Ltd	423.904
9.100	Shibaura Mechatronics Corp	422.237
2.885	EO Technics Co Ltd	414.387
11.400	Nitto Boseki Co Ltd	406.582
25.000	Accton Technology Corp	401.388
10.000	M31 Technology Corp	398.824
6.938	PSK Holdings Inc	379.813
60.000	Chung-Hsin Electric & Machinery Manufacturing Corp	373.970
2.347	LS Electric Co Ltd	372.687
149.200	Xiaomi Corp Class B	370.619
62.300	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	366.004
99.000	Lite-On Technology Corp ADR	360.530
23.000	Elite Material Co Ltd	359.756
57.000	Shin Zu Shing Co Ltd	348.630
4.258	LG Electronics Inc	346.332

InnovAsia 5G – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras (cont.):

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
63.000	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	331.552
1.718	LG Innotek Co Ltd	330.265
15.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	303.971
4.551	WiseTech Global Ltd	297.847
46.000	Micro-Star International Co Ltd	291.722
16.600	M3 Inc	274.550
205.000	Gamuda Bhd	270.877
3.000	eMemory Technology Inc	251.392

InnovAsia 5G – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
30.000	Jentech Precision Industrial Co Ltd	873.882
10.047	Hanmi Semiconductor Co Ltd	781.506
1.400	SMC Corp	721.042
42.000	Novatek Microelectronics Corp	678.394
3.610	Fabrinet	670.528
34.000	Phison Electronics Corp	629.856
41.100	SUMCO Corp	622.966
76.000	Chroma ATE Inc	619.623
25.000	Auras Technology Co Ltd	613.000
34.400	Rohm Co Ltd	605.859
4.461	SK Hynix Inc	574.998
146.000	Wistron Corp	548.169
34.793	Tech Mahindra Ltd	540.400
21.400	Kokusai Electric Corp	537.939
38.300	Mercari Inc	533.385
126.073	Shenzhen Sinexcel Electric Co Ltd Class A	528.209
2.598	LEENO Industrial Inc	514.041
65.000	Fitipower Integrated Technology Inc	504.858
10.000	M31 Technology Corp	500.529
10.200	Enplas Corp	489.214
13.236	HPSP Co Ltd	488.809
11.900	Nitto Boseki Co Ltd	487.188
12.816	Haesung DS Co Ltd	473.446
31.000	Accton Technology Corp	471.445
984.000	Innolux Corp	466.065
224.187	Zomato Ltd	465.116
6.100	Towa Corp	458.469
10.000	Global Unichip Corp	454.969
16.500	Harmonic Drive Systems Inc	438.469
15.100	Socionext Inc	433.063
27.277	Bharti Airtel Ltd	415.953
8.341	Polycab India Ltd	407.003
2.885	EO Technics Co Ltd	400.534
214.700	AEM Holdings Ltd	396.921
105.000	Taiwan Union Technology Corp	394.087
15.800	JMDC Inc	393.469
8.000	Lotes Co Ltd	382.150
27.700	M3 Inc	381.218
6.188	JYP Entertainment Corp	372.966

InnovAsia 5G – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas (cont.):

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
14.000	WinWay Technology Co Ltd	340.720
4.000	eMemory Technology Inc	335.547
8.100	Shibaura Mechatronics Corp	329.351
29.000	Faraday Technology Corp	324.893
23.000	Elite Material Co Ltd	317.313
9.000	MediaTek Inc	312.485
60.000	Chung-Hsin Electric & Machinery Manufacturing Corp	310.167
98.300	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd	299.295
6.887	Altium Ltd	297.006
41.000	Shin Zu Shing Co Ltd	290.058

Japan Equity Engagement – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste JPY
120.000	Shofu Inc	465.554.910
93.000	Mitsubishi Logistics Corp	448.346.596
250.000	Trial Holdings Inc	425.000.000
182.000	Itoki Corp	317.196.651
53.000	Lifedrink Co Inc	301.281.280
111.000	Mitsubishi Pencil Co Ltd	266.522.128
55.000	Juroku Financial Group Inc	249.297.370
50.000	Niterra Co Ltd	219.206.072
78.000	Kinden Corp	218.132.412
71.000	Dai-Dan Co Ltd	216.699.711
40.000	Micronics Japan Co Ltd	210.246.452
83.000	SBI Sumishin Net Bank Ltd	194.264.258
105.000	Transaction Co Ltd	192.515.338
44.000	Life Corp	172.448.514
127.300	Mamezo Digital Holdings Co Ltd	169.309.000
49.000	Genda Inc	147.403.917
37.000	Yamazaki Baking Co Ltd	146.585.886
30.000	Takasago Thermal Engineering Co Ltd	137.193.871
30.000	Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd	131.595.156
34.000	Tsumura & Co	122.481.526
66.000	USS Co Ltd	106.872.009
28.000	baudroie Inc	105.402.226
100.000	Tokyu Fudosan Holdings Corp	101.224.162
13.000	Macnica Holdings Inc	99.056.795
59.000	Tokyo Century Corp	96.138.447
7.000	Tokyo Seimitsu Co Ltd	81.028.811
19.000	Pilot Corp	78.711.745
90.000	Astroscale Holdings Inc	76.500.000
40.000	Amada Co Ltd	75.081.020

Japan Equity Engagement – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto JPY
177.000	FP Partner Inc	1.049.579.152
220.000	Trial Holdings Inc	510.553.346
262.200	Ricoh Co Ltd	338.366.133
145.000	Kansai Paint Co Ltd	323.850.600
34.000	Micronics Japan Co Ltd	243.139.082
21.000	Lawson Inc	215.880.000
53.000	MEC Co Ltd	214.052.971
53.000	Nifco Inc	192.123.159
31.000	M&A Research Institute Holdings Inc	180.062.408
93.000	Menicon Co Ltd	179.591.965
56.000	Pasona Group Inc	159.079.076
120.000	Tokyu Fudosan Holdings Corp	138.962.871
29.000	San-A Co Ltd	132.344.923
20.000	Asics Corp	131.686.016
25.000	Hokkoku Financial Holdings Inc	123.955.040
15.000	Macnica Holdings Inc	114.729.757
40.000	JSB Co Ltd	114.279.076
11.000	Tokyo Seimitsu Co Ltd	111.615.135
11.000	Osaka Soda Co Ltd	107.604.760
68.800	Daiwa Industries Ltd	106.930.016
44.000	Shoei Co Ltd	93.405.777
15.000	SHO-BOND Holdings Co Ltd	91.595.170
37.000	Japan Elevator Service Holdings Co Ltd	89.765.188
23.000	Pilot Corp	87.518.396
28.000	Fujimi Inc	87.139.724
50.000	Amada Co Ltd	86.570.666
55.000	Tokyo Century Corp	84.536.990
90.000	Astroscale Holdings Inc	82.941.754
13.000	Lifedrink Co Inc	69.584.730
20.000	Yokogawa Electric Corp	69.245.472
13.000	Mitsubishi Logistics Corp	67.137.660
34.000	Open Up Group Inc	66.758.293
25.000	Justsystems Corp	66.161.376

Macro Opportunities FX – Informe de compras y ventas significativas

En el período no se produjeron compras.

Total ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto EUR
650.000	Finland T-Bill, 0.00%, 14/05/2024	642.176
550.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 12/06/2024	541.869
490.000	German Treasury Bill, 0.00%, 19/06/2024	482.552
450.000	German Treasury Bill, 0.00%, 17/04/2024	445.992
350.000	French Republic Government Bond OAT, 0.00%, 25/03/2024	347.735
300.000	Finland T-Bill, 0.00%, 13/03/2024	298.429

Next Generation Mobility – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
88.389	Kia Corp	7.768.035
40.770	L&F Co Ltd	5.234.671
10.773	Ferrari NV	4.544.854
49.200	Hitachi Ltd	4.331.659
36.577	Hanmi Semiconductor Co Ltd	4.238.218
30.778	Albemarle Corp	3.864.608
114.020	Stellantis NV	3.261.609
10.381	Eaton Corp Plc	3.186.643
43.219	nVent Electric Plc	3.179.854
25.569	Autoliv Inc	3.090.363
87.545	Infineon Technologies AG	3.067.483
35.282	ON Semiconductor Corp	2.475.515
51.455	ABB Ltd	2.399.525
72.500	BYD Co Ltd - H Shares	1.844.089
10.517	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	1.584.547
4.698	Samsung SDI Co Ltd	1.543.547
59.500	Contemporary Amperex Technology Co Ltd Class A	1.542.772
2.503	Linde Plc	1.088.123
14.886	Lattice Semiconductor Corp	1.022.426
2.945	LG Energy Solution Ltd	935.604
773	ASML Holding NV	690.709

Next Generation Mobility – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
87.838	Trimble Inc	4.958.791
12.401	Caterpillar Inc	4.378.965
12.473	ANSYS Inc	4.189.553
23.384	T-Mobile US Inc	3.768.330
9.101	Deere & Co	3.624.952
4.848	NVIDIA Corp	3.203.735
19.825	BE Semiconductor Industries NV	3.003.817
26.482	Amphenol Corp Class A	2.929.852
17.834	Advanced Micro Devices Inc	2.711.284
179.594	MP Materials Corp	2.638.819
10.918	Schneider Electric SE	2.542.178
5.601	Linde Plc	2.531.858
14.159	Tesla Inc	2.488.328
28.878	Altair Engineering Inc Class A	2.421.007
13.679	Amazon.com Inc	2.349.960
32.901	Aptiv Plc	2.288.559
20.291	L&F Co Ltd	2.138.510
51.000	MediaTek Inc	2.011.279
102.297	Epiroc AB Class A	1.975.444
108.542	Murata Manufacturing Co Ltd	1.966.065
7.640	Air Products & Chemicals Inc	1.868.057
12.151	Prologis Inc	1.621.064
42.075	Sensata Technologies Holding Plc	1.479.008
5.013	LG Energy Solution Ltd	1.399.183
5.662	Verisk Analytics Inc Class A	1.311.895
1.332	ASML Holding NV	1.293.043
3.850	Cadence Design Systems Inc	1.185.662
16.648	Uber Technologies Inc	1.160.786
24.780	Ambarella Inc	1.145.150
9.415	Qorvo Inc	1.089.919
2.509	S&P Global Inc	1.066.399
37.541	Taiyo Yuden Co Ltd	891.322

Next Generation Space Economy – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
7.432	Amphenol Corp Class A	850.487
96.000	Astroscale Holdings Inc	809.359
1.549	Linde Plc	693.920
159.481	Rocket Lab USA Inc	689.063
4.054	Keysight Technologies Inc	597.418
3.366	Airbus SE	556.343
27.938	BAE Systems Plc	486.026
1.006	Northrop Grumman Corp	465.689
37.887	MDA Ltd	418.768
1.182	Motorola Solutions Inc	397.130
1.300	Palo Alto Networks Inc	364.635
75.100	Toray Industries Inc	356.348
1.848	Analog Devices Inc	354.777
1.595	Safran SA	345.894
1.208	Cadence Design Systems Inc	339.711
1.916	Advanced Micro Devices Inc	318.973
4.122	Hexcel Corp	300.491
2.981	NV5 Global Inc	299.043
97.800	Singapore Technologies Engineering Ltd	289.515
735	CACI International Inc Class A	278.931
1.791	QUALCOMM Inc	278.764
1.224	Boeing Co	255.311
15.500	Mitsubishi Electric Corp	248.977
39.500	SKY Perfect JSAT Holdings Inc	230.593
522	Teledyne Technologies Inc	222.376
1.360	Thales SA	212.018
207	ASML Holding NV	190.536
152	TransDigm Group Inc	188.271
449	Microsoft Corp	182.036
1.093	Hanwha Aerospace Co Ltd	176.839
1.032	Amazon.com Inc	172.877
35.672	Eutelsat Communications SACA	171.104
25.200	ispace Inc	170.822
3.666	Intellian Technologies Inc	158.979
2.445	Trimble Inc	142.593
167	NVIDIA Corp	140.423
15.633	MDA Space Ltd	137.552

Next Generation Space Economy – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Total ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
7.922	Hexcel Corp	497.018
204.682	Spirent Communications Plc	458.155
462	NVIDIA Corp	407.612
937	Lockheed Martin Corp	406.521
2.319	Boeing Co	401.362
99.460	Shanghai Huace Navigation Technology Ltd Class A	372.340
1.067	ANSYS Inc	365.629
11.104	Iridium Communications Inc	327.677
2.356	Okta Inc Class A	219.899
471	Teledyne Technologies Inc	173.301
17.220	Intuitive Machines Inc	121.739
25.200	ispace Inc	117.966
734	Jacobs Solutions Inc	96.884
439	Safran SA	93.241
43.963	Virgin Galactic Holdings Inc	84.255
7.000	Universal Microwave Technology Inc	63.428
266	Hanwha Aerospace Co Ltd	44.429
421	Uber Technologies Inc	32.657

Responsible Asian Debt – Hard Currency – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
840.000	Pakistan Government International Bond, 6.00%, 08/04/2026	771.120
650.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd, 4.25%, 07/11/2027	592.703
500.000	Shriram Finance Ltd, 6.63%, 22/04/2027	499.805
500.000	Cathaylife Singapore Pte Ltd, 5.95%, 05/07/2034	498.585
457.000	AIA Group Ltd, 5.38%, 05/04/2034	452.823
450.000	FWD Group Holdings Ltd, 7.64%, 02/07/2031	450.000
400.000	Development Bank of Mongolia LLC, 11.00%, 07/03/2026	401.400
400.000	HDFC Bank Ltd, 5.18%, 15/02/2029	400.000
400.000	Hyundai Capital Services Inc, 5.13%, 05/02/2027	398.912
400.000	Korea Gas Corp, 5.00%, 08/07/2029	398.776
400.000	Metropolitan Bank & Trust Co, 5.50%, 06/03/2034	398.080
400.000	State Bank of India, 5.00%, 17/01/2029	398.044
400.000	Hyundai Card Co Ltd, 5.75%, 24/04/2029	395.228
400.000	Fortune Star BVI Ltd, 5.95%, 19/10/2025	382.000
375.000	Bank of East Asia Ltd, 6.75%, 27/06/2034	373.560
400.000	China Overseas Grand Oceans Finance IV Cayman Ltd, 2.45%, 09/02/2026	346.398
313.000	IRB Infrastructure Developers Ltd, 7.11%, 11/03/2032	312.740
300.000	FWD Group Holdings Ltd, 8.40%, 05/04/2029	306.225
300.000	LG Electronics Inc, 5.63%, 24/04/2027	298.800
300.000	SK Hynix Inc, 5.50%, 16/01/2029	298.644
400.000	Longfor Group Holdings Ltd, 3.95%, 16/09/2029	280.400
250.000	Korea National Oil Corp, 4.88%, 03/04/2029	248.185
250.000	FWD Group Holdings Ltd, 6.38%, 29/12/2049	239.875
200.000	Singapore Telecommunications Ltd, 7.38%, 01/12/2031	232.834
300.000	NWD Finance BVI Ltd, 5.25%, 29/12/2049	204.000
200.000	SATS Treasury Pte Ltd, 4.83%, 23/01/2029	200.000
200.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 5.52%, 21/05/2034	200.000
200.000	Continuum Green Energy India Pvt/Co-Issuers, 7.50%, 26/06/2033	200.000
200.000	Muthoot Finance Ltd, 7.13%, 14/02/2028	199.900
200.000	China Cinda 2020 I Management Ltd, 5.75%, 28/05/2029	199.888
200.000	Far East Horizon Ltd, 6.63%, 16/04/2027	199.598
200.000	CK Hutchison International 24 Ltd, 5.50%, 26/04/2034	198.696
200.000	Fortune Star BVI Ltd, 5.00%, 18/05/2026	186.700
200.000	Power Finance Corp Ltd, 3.95%, 23/04/2030	181.730
200.000	Meituan, 0.00%, 27/04/2028	179.900
200.000	Central Plaza Development Ltd, 3.85%, 14/07/2025	178.900
200.000	Indian Railway Finance Corp Ltd, 3.25%, 13/02/2030	177.008
200.000	GLP Pte Ltd, 3.88%, 04/06/2025	175.200
200.000	Standard Chartered Plc, 4.75%, 29/12/2049	162.000
200.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd, 3.98%, 09/11/2027	131.400

Responsible Asian Debt – Hard Currency – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
650.000	Huarong Finance II Co Ltd, 5.50%, 16/01/2025	642.525
400.000	ENN Energy Holdings Ltd, 2.63%, 17/09/2030	343.332
300.000	Korea Gas Corp, 4.88%, 05/07/2028	299.352
500.000	Sri Lanka Government International Bond, 6.83%, 18/07/2026	287.905
250.000	Korea National Oil Corp, 4.88%, 03/04/2029	246.473
250.000	Reliance Industries Ltd, 2.88%, 12/01/2032	212.293
200.000	SK Hynix Inc, 6.50%, 17/01/2033	209.204
200.000	AIA Group Ltd, 5.63%, 25/10/2027	204.380
200.000	FWD Group Holdings Ltd, 7.64%, 02/07/2031	203.750
200.000	REC Ltd, 5.63%, 11/04/2028	201.794
200.000	Muthoot Finance Ltd, 7.13%, 14/02/2028	200.582
200.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 5.52%, 21/05/2034	200.500
200.000	HDFC Bank Ltd, 5.18%, 15/02/2029	200.348
200.000	Far East Horizon Ltd, 6.63%, 16/04/2027	200.082
200.000	AIA Group Ltd, 4.95%, 04/04/2033	199.382
200.000	State Bank of India, 4.88%, 05/05/2028	199.000
200.000	Hyundai Card Co Ltd, 5.75%, 24/04/2029	198.370
200.000	Khazanah Capital Ltd, 4.88%, 01/06/2033	197.392
200.000	CK Hutchison International 23 Ltd, 4.75%, 21/04/2028	196.860
200.000	KT Corp, 4.00%, 08/08/2025	196.488
200.000	Korea Gas Corp, 2.88%, 16/07/2029	180.060
250.000	Reliance Industries Ltd, 3.63%, 12/01/2052	179.425
300.000	Sri Lanka Government International Bond, 6.85%, 14/03/2024	169.650
200.000	Baidu Inc, 2.38%, 23/08/2031	167.142
200.000	LG Chem Ltd, 2.38%, 07/07/2031	162.414
168.000	Vedanta Resources Finance II Plc, 13.88%, 09/12/2028	156.744
200.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd, 3.98%, 09/11/2027	144.100
200.000	NWD Finance BVI Ltd, 5.25%, 29/12/2049	129.100
220.000	Sri Lanka Government International Bond, 6.85%, 03/11/2025	125.950

Short Duration Emerging Market Debt – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
48.200.000	United States Treasury Note/Bond, 4.63%, 30/04/2029	48.558.629
48.100.000	Ivory Coast Government International Bond, 5.88%, 17/10/2031	46.871.927
44.942.000	YPF SA, 9.50%, 17/01/2031	44.529.882
33.900.000	Panama Government International Bond, 9.38%, 01/04/2029	38.099.000
34.460.000	El Sukuk Co Ltd, 5.43%, 28/05/2029	34.480.000
25.600.000	Gulf International Bank, 5.75%, 05/06/2029	25.402.112
20.000.000	Romanian Government International Bond, 5.50%, 18/09/2028	22.004.717
22.042.000	Abu Dhabi Government International Bond, 4.88%, 30/04/2029	21.954.052
21.520.000	Arab Petroleum Investments Corp, 5.43%, 02/05/2029	21.520.000
21.284.000	Abu Dhabi Developmental Holding Co PJSC, 5.38%, 08/05/2029	21.181.218
17.600.000	Türkiye Government International Bond, 9.38%, 14/03/2029	18.986.000
16.856.000	First Abu Dhabi Bank PJSC, 5.00%, 28/02/2029	16.731.097
15.000.000	BBK BSC, 6.88%, 06/06/2029	15.000.000
15.000.000	Akbank TAS, 7.50%, 20/01/2030	14.981.842
13.000.000	Sisecam UK Plc, 8.25%, 02/05/2029	13.000.000
12.904.000	XP Inc, 6.75%, 02/07/2029	12.769.798
12.151.000	Movida Europe SA, 7.85%, 11/04/2029	12.015.881
11.642.000	FS Luxembourg Sarl, 8.88%, 12/02/2031	11.493.797
11.507.000	Nigeria Government International Bond, 8.38%, 24/03/2029	11.046.720
11.667.000	El Salvador Government International Bond, 9.25%, 17/04/2030	10.491.316
10.000.000	Trident Energy Finance Plc, 12.50%, 30/11/2029	10.144.383
10.801.444	Zambia Government International Bond, 5.75%, 30/06/2033	9.578.591
10.800.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank, 4.13%, 30/06/2028	9.517.500
8.060.000	Romanian Government International Bond, 6.63%, 27/09/2029	9.469.609
9.361.000	Türkiye Is Bankasi AS, 7.75%, 12/06/2029	9.361.000
9.700.000	Republic of South Africa Government International Bond, 5.88%, 22/06/2030	9.287.750
10.000.000	Colombia Government International Bond, 4.50%, 15/03/2029	9.130.000
10.300.000	Egypt Government International Bond, 7.60%, 01/03/2029	9.089.750
9.007.000	Republic of Poland Government International Bond, 4.63%, 18/03/2029	8.938.817
8.795.000	Banco BTG Pactual SA, 6.25%, 08/04/2029	8.720.858
8.352.000	QNB Finansbank AS, 7.25%, 21/05/2029	8.308.987
8.134.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS, 9.74%, 29/12/2049	8.134.000
7.900.000	Development Bank of Mongolia LLC, 11.00%, 07/03/2026	7.927.650
7.371.000	NBK SPC Ltd, 5.50%, 06/06/2030	7.363.998
6.942.000	Korea National Oil Corp, 4.88%, 03/04/2029	6.891.601

Short Duration Emerging Market Debt – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
58.400.000	Serbia International Bond, 3.13%, 15/05/2027	59.886.365
425.000	Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	50.628.196
30.986.000	Saudi Arabian Oil Co, 2.88%, 16/04/2024	30.752.105
21.984.000	Airport Authority, 1.75%, 12/01/2027	20.309.918
20.500.000	MDGH GMTN RSC Ltd, 2.50%, 07/11/2024	20.264.250
17.582.801	Ivory Coast Government International Bond, 5.75%, 31/12/2032	17.077.295
14.700.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/05/2024	14.461.494
13.800.000	Korea National Oil Corp, 1.75%, 18/04/2025	13.381.574
10.940.000	Egypt Government International Bond, 4.75%, 11/04/2025	10.724.958
9.108.000	China Huadian Overseas Development Management Co Ltd, 4.00%, 29/12/2049	9.053.352
9.007.000	Republic of Poland Government International Bond, 4.63%, 18/03/2029	8.906.572
8.000.000	Kazakhstan Government International Bond, 0.60%, 30/09/2026	8.096.967
6.800.000	MDGH GMTN RSC Ltd, 3.00%, 19/04/2024	6.748.320
9.190.000	Egypt Government International Bond, 5.80%, 30/09/2027	6.746.200
6.769.000	Development Bank of Kazakhstan JSC, 5.50%, 15/04/2027	6.726.694
7.770.000	Egypt Government International Bond, 4.75%, 16/04/2026	6.674.315
5.817.000	YPF SA, 9.50%, 17/01/2031	5.834.255
5.920.000	Philippine National Bank, 3.28%, 27/09/2024	5.821.254
5.571.000	Powerchina Roadbridge Group British Virgin Islands Ltd, 3.08%, 29/12/2049	5.338.188
5.000.000	Sasol Financing USA LLC, 5.88%, 27/03/2024	4.985.000
5.000.000	China Huadian Overseas Development 2018 Ltd, 3.38%, 29/12/2049	4.891.050
5.000.000	Colombia Government International Bond, 3.88%, 25/04/2027	4.740.000
5.000.000	African Export-Import Bank, 2.63%, 17/05/2026	4.682.500
4.758.000	DIB Sukuk Ltd, 2.95%, 20/02/2025	4.668.788
5.000.000	Arabian Centres Sukuk II Ltd, 5.63%, 07/10/2026	4.615.781
4.400.000	Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd, 4.38%, 10/04/2024	4.391.200
4.000.000	BBK BSC, 5.50%, 09/07/2024	3.988.000

Short Duration High Yield SDG Engagement – Informe de compras y ventas significativas

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
5.575.000	TransDigm Inc, 6.38%, 01/03/2029	5.573.563
5.890.000	Service Properties Trust, 5.50%, 15/12/2027	5.544.056
5.755.000	Comstock Resources Inc, 6.75%, 01/03/2029	5.380.025
4.930.000	Medline Borrower LP, 5.25%, 01/10/2029	4.659.556
4.375.000	athenahealth Group Inc, 8.59%, 15/02/2029	4.341.031
4.285.000	AmWINS Group Inc, 6.38%, 15/02/2029	4.289.706
4.085.000	Champions Financing Inc, 8.75%, 15/02/2029	4.156.038
4.345.000	VM Consolidated Inc, 5.50%, 15/04/2029	4.133.003
4.045.000	Cloud Software Group Inc, 6.50%, 31/03/2029	3.829.341
3.785.000	Match Group Holdings II LLC, 4.63%, 01/06/2028	3.577.597
3.285.000	Hillenbrand Inc, 6.25%, 15/02/2029	3.284.316
3.250.000	Constellium SE, 5.63%, 15/06/2028	3.179.394
3.145.000	Harvest Midstream I LP, 7.50%, 01/09/2028	3.176.389
2.990.000	NCL Corp Ltd, 8.13%, 15/01/2029	3.131.931
3.140.000	ATI Inc, 5.88%, 01/12/2027	3.101.354
3.465.000	Blackstone Mortgage Trust Inc, 3.75%, 15/01/2027	3.090.710
3.140.000	Acadia Healthcare Co Inc, 5.50%, 01/07/2028	3.068.331
3.040.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 5.13%, 15/08/2027	2.868.163
3.020.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc, 4.50%, 01/10/2027	2.864.911
2.860.000	Cotiviti Inc, 15.25%, 01/05/2031	2.860.000

Short Duration High Yield SDG Engagement – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

20 ventas de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
5.700.000	Advanced Drainage Systems Inc, 5.00%, 30/09/2027	5.521.871
4.805.000	American Airlines Inc, 7.25%, 15/02/2028	4.862.725
4.885.000	CSC Holdings LLC, 5.25%, 01/06/2024	4.775.088
4.635.000	Camelot Return Merger Sub Inc, 8.75%, 01/08/2028	4.654.329
5.145.000	Hertz Corp, 4.63%, 01/12/2026	4.551.050
4.330.000	Masonite International Corp, 5.38%, 01/02/2028	4.327.561
4.340.000	Mattamy Group Corp, 5.25%, 15/12/2027	4.194.126
4.120.000	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer, 7.50%, 01/06/2025	4.142.270
4.130.000	Energizer Holdings Inc, 6.50%, 31/12/2027	4.104.896
4.010.000	DISH Network Corp, 11.75%, 15/11/2027	4.030.050
4.835.000	CSC Holdings LLC, 5.50%, 15/04/2027	3.710.863
3.690.000	Qwest Corp, 7.25%, 15/09/2025	3.639.728
3.605.000	Ally Financial Inc, 5.75%, 20/11/2025	3.593.914
3.480.000	Energy Transfer LP, 5.63%, 01/05/2027	3.453.629
3.455.000	Tenet Healthcare Corp, 6.25%, 01/02/2027	3.451.658
3.430.000	XHR LP, 6.38%, 15/08/2025	3.434.288
3.660.000	Buckeye Partners LP, 4.13%, 01/12/2027	3.419.034
3.600.000	Sirius XM Radio Inc, 4.00%, 15/07/2028	3.284.543
3.200.000	KB Home, 6.88%, 15/06/2027	3.272.733
3.940.000	Altice Financing SA, 5.00%, 15/01/2028	3.175.780

Strategic Income – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
116.930.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/05/2054	115.239.215
115.415.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/04/2054	114.919.798
112.310.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/06/2054	110.479.250
110.055.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/03/2055	109.584.390
109.880.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/07/2054	108.767.637
105.215.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/02/2055	105.378.449
102.600.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 10/10/2024	100.014.503
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/04/2024	98.683.979
103.815.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/07/2043	85.049.578
97.395.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/05/2054	78.685.028
92.520.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/06/2054	74.399.844
71.840.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 08/08/2024	70.011.145
66.730.000	Ginnie Mae, 6.00%, 01/07/2054	67.095.508
66.130.000	Ginnie Mae, 6.00%, 01/06/2054	66.252.076
72.515.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/04/2054	60.215.470
55.680.000	Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/07/2054	56.058.266
55.200.000	Ginnie Mae, 6.00%, 01/05/2054	55.420.458
60.885.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/03/2039	50.605.871
52.615.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/04/2054	49.921.143
50.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 04/04/2024	49.369.008
50.820.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/05/2054	47.780.224
49.865.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/07/2042	47.206.412
55.955.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/02/2055	47.154.368
49.865.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/06/2054	46.718.471

Strategic Income – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
116.930.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/05/2054	115.001.201
115.415.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/04/2054	113.960.480
112.310.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/06/2054	111.166.339
110.055.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/03/2055	109.553.649
105.215.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/02/2055	104.829.393
87.775.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/01/2055	87.919.608
97.395.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/05/2054	78.218.095
92.520.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/06/2054	75.554.781
66.130.000	Ginnie Mae, 6.00%, 01/06/2054	66.544.614
72.515.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/04/2054	58.901.978
55.200.000	Ginnie Mae, 6.00%, 01/05/2054	55.537.553
60.885.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/03/2039	50.510.662
52.615.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/04/2054	49.550.470
50.820.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/05/2054	47.554.625
49.865.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/06/2054	47.197.767
55.955.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/02/2055	46.627.991
44.235.000	Ginnie Mae, 6.00%, 01/04/2054	44.505.547
43.235.000	Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/03/2055	43.552.600
45.880.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/02/2055	42.776.498
43.780.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/03/2042	41.474.522
42.265.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/02/2055	40.496.562
47.790.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/01/2055	40.274.198
43.905.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/04/2054	40.238.192
40.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 14/03/2024	39.877.080
39.180.000	Ginnie Mae, 6.00%, 01/03/2051	39.511.923
37.680.000	Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/02/2055	38.068.774
39.250.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/03/2042	36.226.068
35.720.000	Ginnie Mae, 6.00%, 01/02/2055	36.009.005
39.255.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/05/2054	35.561.767
37.410.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/01/2055	35.076.179
35.220.000	Ginnie Mae, 5.00%, 01/05/2054	34.085.530
36.640.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/07/2054	33.934.564
36.640.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/06/2054	33.536.735
33.885.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/01/2055	32.546.474
31.895.000	Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/01/2055	32.311.352
32.755.000	Ginnie Mae, 5.00%, 01/04/2054	31.735.287
31.160.000	Ginnie Mae, 6.00%, 01/01/2055	31.707.671
32.735.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/04/2054	31.694.909

Sustainable Asia High Yield – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
500.000	Shriram Finance Ltd, 6.63%, 22/04/2027	499.805
400.000	MGM China Holdings Ltd, 7.13%, 26/06/2031	400.000
400.000	FWD Group Holdings Ltd, 7.64%, 02/07/2031	400.000
400.000	Hyundai Capital Services Inc, 5.13%, 05/02/2027	398.912
400.000	State Bank of India, 5.00%, 17/01/2029	398.044
650.000	Longfor Group Holdings Ltd, 3.95%, 16/09/2029	390.275
400.000	Fuqing Investment Management Ltd, 3.25%, 23/06/2025	366.650
400.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd, 4.25%, 07/11/2027	364.740
375.000	CA Magnum Holdings, 5.38%, 31/10/2026	353.213
400.000	China Overseas Grand Oceans Finance IV Cayman Ltd, 2.45%, 09/02/2026	346.398
400.000	GLP Pte Ltd, 3.88%, 04/06/2025	332.100
550.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd, 3.98%, 09/11/2027	329.330
400.000	GLP China Holdings Ltd, 2.95%, 29/03/2026	318.740
300.000	Medco Maple Tree Pte Ltd, 8.96%, 27/04/2029	312.300
300.000	Development Bank of Mongolia LLC, 11.00%, 07/03/2026	301.050
300.000	LG Electronics Inc, 5.63%, 24/04/2027	298.800
300.000	SK Hynix Inc, 5.50%, 16/01/2029	298.644
286.000	Singapore Airlines Ltd, 5.25%, 21/03/2034	284.988
281.000	IRB Infrastructure Developers Ltd, 7.11%, 11/03/2032	280.767
300.000	Meituan, 0.00%, 27/04/2028	269.850
250.000	Bank of East Asia Ltd, 6.75%, 27/06/2034	249.040
200.000	FWD Group Holdings Ltd, 8.40%, 05/04/2029	205.098
300.000	Franshion Brilliant Ltd, 4.25%, 23/07/2029	202.350
200.000	Melco Resorts Finance Ltd, 7.63%, 17/04/2032	200.000
200.000	Continuum Green Energy India Pvt/Co-Issuers, 7.50%, 26/06/2033	200.000
200.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 5.52%, 21/05/2034	200.000
200.000	Muthoot Finance Ltd, 7.13%, 14/02/2028	199.900
200.000	Far East Horizon Ltd, 6.63%, 16/04/2027	199.598
200.000	CathayLife Singapor, 5.95%, 05/07/2034	199.434
200.000	CK Hutchison International 24 Ltd, 5.50%, 26/04/2034	198.696
200.000	AIA Group Ltd, 5.38%, 05/04/2034	198.172
200.000	Hyundai Card Co Ltd, 5.75%, 24/04/2029	197.614
200.000	Periama Holdings LLC, 5.95%, 19/04/2026	197.400
200.000	Greenko Solar Mauritius Ltd, 5.95%, 29/07/2026	196.900
200.000	Adani Green Energy Ltd, 4.38%, 08/09/2024	196.480
200.000	Wynn Macau Ltd, 5.50%, 15/01/2026	194.860
200.000	FWD Group Holdings Ltd, 6.38%, 29/12/2049	191.900
200.000	Vedanta Resources Finance II Plc, 13.88%, 21/01/2027	190.480
200.000	Fortune Star BVI Ltd, 5.95%, 19/10/2025	189.400

Sustainable Asia High Yield – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras (cont.):

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
200.000	Fortune Star BVI Ltd, 5.00%, 18/05/2026	186.700
200.000	Central Plaza Development Ltd, 3.85%, 14/07/2025	178.900
2.310.875	Sunac China Holdings Ltd, 7.25%, 30/09/2030	167.625
200.000	Standard Chartered Plc, 4.75%, 29/12/2049	162.000
200.000	NWD Finance BVI Ltd, 5.25%, 29/12/2049	136.000
200.000	New Metro Global Ltd, 4.50%, 02/05/2026	135.000

Sustainable Asia High Yield – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
700.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd, 4.50%, 29/05/2029	632.240
400.000	State Bank of India, 5.00%, 17/01/2029	398.280
400.000	Hyundai Capital Services Inc, 5.13%, 05/02/2027	396.420
400.000	Sands China Ltd, 5.40%, 08/08/2028	387.520
400.000	Huarong Finance II Co Ltd, 4.63%, 03/06/2026	385.500
368.000	Vedanta Resources Finance II Plc, 13.88%, 09/12/2028	337.280
330.000	Shriram Finance Ltd, 4.40%, 13/03/2024	329.010
300.000	LG Electronics Inc, 5.63%, 24/04/2027	302.253
300.000	Korea Land and Housing Corp, 5.75%, 06/10/2025	302.203
300.000	SK Hynix Inc, 5.50%, 16/01/2029	301.059
286.000	Singapore Airlines Ltd, 5.25%, 21/03/2034	286.366
300.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd, 3.38%, 12/05/2026	285.900
273.000	Lenovo Group Ltd, 5.83%, 27/01/2028	273.366
300.000	Meituan, 3.05%, 28/10/2030	258.750
229.000	Industrial Bank of Korea, 5.38%, 04/10/2028	237.097
400.000	Sri Lanka Government International Bond, 6.85%, 03/11/2025	230.560
200.000	SK Hynix Inc, 6.50%, 17/01/2033	209.204
200.000	LG Energy Solution Ltd, 5.75%, 25/09/2028	204.894
200.000	Hyundai Capital America, 5.68%, 26/06/2028	204.562
200.000	FWD Group Holdings Ltd, 7.64%, 02/07/2031	203.750
200.000	MGM China Holdings Ltd, 7.13%, 26/06/2031	201.740
200.000	Muthoot Finance Ltd, 7.13%, 14/02/2028	200.582
200.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 5.52%, 21/05/2034	200.500
200.000	CK Hutchison International 24 Ltd, 5.50%, 26/04/2034	200.436
200.000	Far East Horizon Ltd, 6.63%, 16/04/2027	200.082
200.000	AIA Group Ltd, 5.38%, 05/04/2034	200.060
200.000	Hyundai Card Co Ltd, 5.75%, 24/04/2029	198.370
200.000	Network i2i Ltd, 5.65%, 29/12/2049	198.100
200.000	Huarong Finance II Co Ltd, 5.50%, 16/01/2025	197.700
200.000	Huarong Finance II Co Ltd, 5.00%, 19/11/2025	194.220
250.000	Shui On Development Holding Ltd, 5.50%, 03/03/2025	190.125
200.000	New Metro Global Ltd, 4.80%, 15/12/2024	182.600
200.000	ENN Energy Holdings Ltd, 2.63%, 17/09/2030	171.592
200.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd, 3.98%, 09/11/2027	144.100
200.000	NWD Finance BVI Ltd, 5.25%, 29/12/2049	129.100
581.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd, 5.20%, 12/01/2026	128.821

Sustainable Emerging Market Corporate Debt – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
1.351.000	YPF SA, 9.50%, 17/01/2031	1.350.160
1.028.000	Banco do Brasil SA, 6.00%, 18/03/2031	1.010.760
824.000	First Quantum Minerals Ltd, 8.63%, 01/06/2031	801.100
900.000	Prosus NV, 3.68%, 21/01/2030	781.911
800.000	Bancolombia SA, 4.63%, 18/12/2029	765.200
727.000	Republic of Poland Government International Bond, 5.13%, 18/09/2034	722.749
723.000	Turkiye Government International Bond, 7.63%, 15/05/2034	710.579
696.000	Israel Government International Bond, 5.50%, 12/03/2034	690.571
700.000	Compania de Minas Buenaventura SAA, 5.50%, 23/07/2026	671.350
719.144	Samarco Mineracao SA, 9.00%, 30/06/2031	657.184
647.000	Akbank TAS, 9.37%, 29/12/2049	647.000
597.000	Ecopetrol SA, 8.88%, 13/01/2033	620.048
576.000	Turkiye Government International Bond, 5.88%, 21/05/2030	619.090
601.000	Dominican Republic International Bond, 7.05%, 03/02/2031	613.373
602.000	Consolidated Energy Finance SA, 12.00%, 15/02/2031	612.000
600.000	Trident Energy Finance Plc, 12.50%, 30/11/2029	609.073
600.000	Braskem Netherlands Finance BV, 8.50%, 12/01/2031	604.680
600.000	Banco del Estado de Chile, 7.95%, 29/12/2049	600.000
582.000	FS Luxembourg Sarl, 8.88%, 12/02/2031	574.591
568.000	Singapore Airlines Ltd, 5.25%, 21/03/2034	565.989
600.000	IHS Netherlands Holdco BV, 8.00%, 18/09/2027	560.420
556.000	Inversiones CMPC SA, 6.13%, 26/02/2034	554.032
600.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd, 4.20%, 04/08/2027	549.800
533.000	Mexico Government International Bond, 6.00%, 07/05/2036	528.661
550.000	Israel Government International Bond, 5.75%, 12/03/2054	527.802
575.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd, 4.25%, 07/11/2027	524.314
505.000	Banco de Credito e Inversiones SA, 8.75%, 29/12/2049	510.500
500.000	Sisecam UK Plc, 8.63%, 02/05/2032	505.012

Sustainable Emerging Market Corporate Debt – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
1.028.000	Banco do Brasil SA, 6.00%, 18/03/2031	1.008.386
723.000	Turkiye Government International Bond, 7.63%, 15/05/2034	718.983
696.000	Israel Government International Bond, 5.50%, 12/03/2034	691.878
640.000	Adib Sukuk Co II Ltd, 5.70%, 15/11/2028	657.100
576.000	Turkiye Government International Bond, 5.88%, 21/05/2030	627.293
568.000	Singapore Airlines Ltd, 5.25%, 21/03/2034	568.567
575.000	Huarong Finance II Co Ltd, 5.50%, 16/01/2025	568.388
533.000	Mexico Government International Bond, 6.00%, 07/05/2036	535.399
550.000	Israel Government International Bond, 5.75%, 12/03/2054	533.830
451.000	Abu Dhabi Government International Bond, 5.50%, 30/04/2054	449.098
500.000	ENN Energy Holdings Ltd, 2.63%, 17/09/2030	427.299
450.000	Anglo American Capital Plc, 3.88%, 16/03/2029	416.009
393.000	Raizen Fuels Finance SA, 6.45%, 05/03/2034	400.369
400.000	Anglo American Capital Plc, 5.75%, 05/04/2034	399.082
400.000	Banco de Bogota, 6.25%, 12/05/2026	396.750
400.000	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS, 5.80%, 11/04/2028	382.800
400.000	BRF SA, 4.88%, 24/01/2030	366.300
400.000	Turkiye Government International Bond, 5.95%, 15/01/2031	365.820
351.000	Banco do Brasil SA, 6.25%, 18/04/2030	359.073
350.000	Corp Nacional del Cobre de Chile, 6.44%, 26/01/2036	355.250
400.000	Vedanta Resources Finance II Plc, 13.88%, 09/12/2028	352.000
327.000	Sasol Financing USA LLC, 8.75%, 03/05/2029	332.723
350.000	Kallpa Generacion SA, 4.13%, 16/08/2027	329.875
317.000	YPF SA, 9.50%, 17/01/2031	318.046
300.000	Ecopetrol SA, 8.88%, 13/01/2033	310.200
320.000	CMB International Leasing Management Ltd, 1.88%, 12/08/2025	306.445
292.000	Panama Government International Bond, 8.00%, 01/03/2038	301.519
300.000	Otel Sukuk Ltd, 5.38%, 24/01/2031	299.400
300.000	Grupo Televisa SAB, 6.63%, 15/01/2040	298.305
300.000	Transportadora de Gas del Sur SA, 6.75%, 02/05/2025	297.000
300.000	Kosmos Energy Ltd, 7.13%, 04/04/2026	289.200
300.000	Banco Internacional del Peru SAA Interbank, 3.25%, 04/10/2026	283.140
285.000	YPF SA, 8.50%, 28/07/2025	281.295
400.000	Canacol Energy Ltd, 5.75%, 24/11/2028	275.000
300.000	Orbia Advance Corp SAB de CV, 5.88%, 17/09/2044	267.750
258.000	MAF Global Securities Ltd, 7.88%, 29/12/2049	265.740
295.000	Rede D'or Finance Sarl, 4.50%, 22/01/2030	261.370
279.000	Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp, 1.75%, 15/04/2026	258.106
300.000	Banco de Chile, 2.99%, 09/12/2031	255.810
300.000	Banco de Credito e Inversiones SA, 2.88%, 14/10/2031	253.080
300.000	Inversiones CMPC SA, 3.00%, 06/04/2031	252.900

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
7.739.000	Romanian Government International Bond, 5.63%, 22/02/2036	8.265.820
7.760.000	Serbia International Bond, 1.65%, 03/03/2033	6.233.513
6.380.000	Brazilian Government International Bond, 6.00%, 20/10/2033	6.196.977
6.740.000	Dominican Republic International Bond, 4.88%, 23/09/2032	5.985.919
13.570.000	Argentine Republic Government International Bond, 3.63%, 09/07/2046	5.253.302
5.680.000	Ivory Coast Government International Bond, 6.88%, 17/10/2040	5.197.885
4.690.000	Colombia Government International Bond, 8.00%, 20/04/2033	4.881.832
3.690.000	Morocco Government International Bond, 6.50%, 08/09/2033	3.767.595
4.040.000	Telecomunicaciones Digitales SA, 4.50%, 30/01/2030	3.581.400
3.454.000	Republic of Poland Government International Bond, 5.13%, 18/09/2034	3.417.685
3.130.000	Chile Government International Bond, 4.13%, 05/07/2034	3.390.161
3.130.000	Istanbul Metropolitan Municipality, 10.50%, 06/12/2028	3.380.478
3.010.000	Costa Rica Government International Bond, 6.55%, 03/04/2034	3.088.108
3.750.000	Braskem Idesa SAPI, 6.99%, 20/02/2032	2.755.320
2.860.000	Mexico Government International Bond, 4.75%, 27/04/2032	2.608.034
2.940.000	Mexico Government International Bond, 5.75%, 12/10/2110	2.548.275
2.540.000	Romanian Government International Bond, 3.62%, 26/05/2030	2.477.295
5.250.000	Argentine Republic Government International Bond, 0.75%, 09/07/2030	2.339.579
4.120.000	Sri Lanka Government International Bond, 6.83%, 18/07/2026	2.300.235
2.720.000	Romanian Government International Bond, 2.00%, 28/01/2032	2.265.265
2.159.000	Antofagasta Plc, 6.25%, 02/05/2034	2.155.646
2.160.000	Bank Gospodarstwa Krajowego, 5.38%, 22/05/2033	2.138.141
2.460.000	Peruvian Government International Bond, 1.25%, 11/03/2033	2.092.535
2.025.000	Dominican Republic International Bond, 7.05%, 03/02/2031	2.086.560
1.940.000	Bank Gospodarstwa Krajowego, 6.25%, 31/10/2028	2.019.928
2.010.000	Colombia Government International Bond, 7.38%, 18/09/2037	1.983.629
4.210.000	Ghana Government International Bond, 7.75%, 07/04/2029	1.931.906
2.240.000	Ivory Coast Government International Bond, 6.63%, 22/03/2048	1.895.533
1.900.000	Latvia Government International Bond, 5.13%, 30/07/2034	1.880.115
1.790.000	Mexico Government International Bond, 3.38%, 23/02/2031	1.869.252
2.060.000	Latvia Government International Bond, 0.25%, 23/01/2030	1.859.486
1.865.000	Mexico Government International Bond, 6.00%, 07/05/2036	1.825.348
3.590.000	Ukraine Government International Bond, 7.75%, 01/08/2041	1.783.264
2.260.000	Peruvian Government International Bond, 3.00%, 15/01/2034	1.771.519
2.710.000	Ghana Government International Bond, 10.75%, 14/10/2030	1.771.370
1.608.000	Republic of Poland Government International Bond, 4.13%, 11/01/2044	1.740.957
2.260.000	El Salvador Government International Bond, 7.65%, 15/06/2035	1.734.776

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
6.030.000	Serbia International Bond, 1.50%, 26/06/2029	5.505.535
11.810.000	Argentine Republic Government International Bond, 3.63%, 09/07/2035	4.141.325
2.833.000	Romanian Government International Bond, 3.38%, 28/01/2050	2.033.102
2.006.000	Mexico Government International Bond, 5.75%, 12/10/2110	1.653.631
1.830.000	Philippine Government International Bond, 1.75%, 28/04/2041	1.397.189
1.380.000	Dominican Republic International Bond, 6.40%, 05/06/2049	1.292.010
1.165.000	Republic of Poland Government International Bond, 3.63%, 11/01/2034	1.237.939
1.242.491	Ivory Coast Government International Bond, 5.75%, 31/12/2032	1.206.769
1.190.000	Serbia International Bond, 6.50%, 26/09/2033	1.190.320
1.350.000	Chile Government International Bond, 3.50%, 31/01/2034	1.148.850
1.000.000	Peruvian Government International Bond, 3.75%, 01/03/2030	1.072.813
1.000.000	Republic of Poland Government International Bond, 5.75%, 16/11/2032	1.062.250
1.200.000	Republic of Uzbekistan International Bond, 3.70%, 25/11/2030	993.750
982.000	Republic of Uzbekistan International Bond, 5.38%, 20/02/2029	920.625
1.510.000	Ukraine Government International Bond, 7.75%, 01/08/2041	734.238
800.000	El Salvador Government International Bond, 7.65%, 15/06/2035	577.000
960.000	Sri Lanka Government International Bond, 6.20%, 11/05/2027	568.896
920.000	Argentine Republic Government International Bond, 0.75%, 09/07/2030	531.760
680.000	Serbia International Bond, 2.05%, 23/09/2036	511.248
490.000	Republic of Poland Government International Bond, 5.50%, 04/04/2053	496.174
400.000	Adib Sukuk Co II Ltd, 5.70%, 15/11/2028	410.376
518.000	El Salvador Government International Bond, 9.50%, 15/07/2052	409.542
489.000	Chile Government International Bond, 4.34%, 07/03/2042	409.538
400.000	Peruvian Government International Bond, 3.00%, 15/01/2034	332.400

Tactical Macro – Informe de compras y ventas significativas

Total compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
7.696.800	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/07/2024	7.608.003
6.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 28/05/2024	5.904.068
6.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 25/06/2024	5.897.222
5.266.400	United States Treasury Bill, 0.00%, 17/10/2024	5.165.411
5.249.100	United States Treasury Bill, 0.00%, 24/09/2024	5.165.361
5.222.100	United States Treasury Bill, 0.00%, 20/08/2024	5.153.007
5.175.600	United States Treasury Bill, 0.00%, 20/06/2024	5.152.935
5.200.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 04/06/2024	5.117.948
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/04/2024	4.930.059
3.892.400	United States Treasury Bill, 0.00%, 25/07/2024	3.858.515
2.500.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 14/03/2024	2.482.555
557.500	United States Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2024	547.861

Tactical Macro – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Total ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
6.805.800	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/01/2024	6.800.904
6.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 28/05/2024	5.963.150
6.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 25/06/2024	5.939.953
5.200.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 04/06/2024	5.163.468
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/04/2024	4.994.162
2.500.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/07/2024	2.466.693
557.500	United States Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2024	551.099
548.800	United States Treasury Bill, 0.00%, 25/07/2024	540.963

Ultra Short Term Euro Bond – Informe de compras y ventas significativas

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste EUR
19.000.000	Nationwide Building Society, 2.00%, 25/07/2029	18.844.500
12.500.000	Skipton Building Society, 0.01%, 22/09/2024	12.173.875
11.400.000	Traton Finance Luxembourg SA, 4.90%, 21/01/2026	11.463.950
1.117.000	Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund	11.156.100
10.000.000	UniCredit SpA, 2.00%, 23/09/2029	9.865.000
9.500.000	Morgan Stanley, 4.36%, 19/03/2027	9.500.000
8.440.000	Permanent TSB Group Holdings Plc, 3.00%, 19/08/2031	8.125.440
8.300.000	UBS Group AG, 2.13%, 13/10/2026	8.051.000
7.500.000	Bank of Montreal, 4.17%, 12/04/2027	7.500.000
7.100.000	Crelan SA, 5.75%, 26/01/2028	7.444.350
7.400.000	Ayvens SA, 3.88%, 24/01/2028	7.394.376
7.000.000	Miltonia Mortgage Finance SRL Series 1 Class B, 5.09%, 28/04/2062	6.930.000
7.438.936	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.55%, 21/05/2026	6.870.237
6.925.658	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.40%, 26/05/2025	6.849.505
6.722.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.88%, 20/10/2034	6.647.924
5.850.000	Domi BV Series 2024-1 Class A, 4.42%, 15/06/2056	5.850.000
5.700.000	Islandsbanki HF, 4.63%, 27/03/2028	5.685.522
5.600.000	Leasys SpA, 3.88%, 01/03/2028	5.578.056
5.501.000	Volkswagen Financial Services AG, 3.75%, 10/09/2026	5.489.283
5.000.000	Permanent TSB Group Holdings Plc, 6.63%, 25/04/2028	5.280.000

Ultra Short Term Euro Bond – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto EUR
11.800.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 3.44%, 04/04/2025	11.787.509
11.400.000	Traton Finance Luxembourg SA, 4.13%, 18/01/2025	11.408.892
8.500.000	Skipton Building Society, 0.01%, 22/09/2024	8.381.525
8.300.000	UBS Group AG, 1.25%, 17/07/2025	8.214.510
8.000.000	Westpac Banking Corp, 3.46%, 04/04/2025	7.994.470
8.000.000	Arval Service Lease SA, 3.38%, 04/01/2026	7.961.080
6.722.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.88%, 20/10/2034	6.606.291
6.700.000	Fastighets AB Balder, 1.88%, 23/01/2026	6.282.120
6.000.000	Morgan Stanley, 1.88%, 27/04/2027	5.726.490
6.000.000	Wizz Air Finance Co BV, 1.00%, 19/01/2026	5.683.900
5.500.000	BPCE SFH SA, 0.13%, 31/03/2025	5.319.770
5.400.000	Autostrade per l'Italia SpA, 2.00%, 04/12/2028	4.970.060
5.300.000	Heimstaden Bostad Treasury BV, 0.63%, 24/07/2025	4.921.580
4.900.000	Lloyds Bank Plc, 3.25%, 02/02/2026	4.898.008
5.000.000	Credit Mutuel Home Loan SFH SA, 0.63%, 10/02/2025	4.881.900
4.900.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0.38%, 10/03/2026	4.624.212
4.900.000	Romanian Government International Bond, 3.62%, 26/05/2030	4.499.180
4.334.000	Lithuania Government International Bond, 3.50%, 03/07/2031	4.302.795
4.300.000	Lithuania Government International Bond, 3.50%, 13/02/2034	4.245.725
4.000.000	Bulgaria Government International Bond, 4.38%, 13/05/2031	4.164.000
4.000.000	Morgan Stanley, 4.36%, 19/03/2027	4.010.040
4.000.000	Citigroup Inc, 1.50%, 24/07/2026	3.884.040
3.770.000	European Financial Stability Facility, 3.38%, 30/08/2038	3.775.906
3.754.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2.63%, 26/04/2029	3.712.147
3.500.000	Dexia SA, 2.75%, 18/01/2029	3.462.805
3.388.000	Spain Government Bond, 3.25%, 30/04/2034	3.379.523
3.216.000	Romanian Government International Bond, 5.38%, 22/03/2031	3.221.499
3.340.000	Bank Gospodarstwa Krajowego, 3.00%, 30/05/2029	3.214.433
3.078.000	European Union, 3.38%, 04/10/2038	3.152.426

Uncorrelated Strategies – Informe de compras y ventas significativas

Total compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
130.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/05/2024	128.435.300
130.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 20/08/2024	128.071.959
125.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 02/05/2024	123.373.438
125.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/04/2024	123.344.479
110.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/07/2024	108.652.372
110.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/04/2024	108.533.443
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 04/04/2024	98.691.125
75.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 01/08/2024	74.061.077
75.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 13/08/2024	73.932.208
55.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2024	54.394.829
55.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2024	54.279.500
45.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2024	44.426.075
67.000.000	United Kingdom Gilt, 0.63%, 22/10/2050	34.939.582
25.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/04/2024	24.816.979
67.500	Albemarle Corp - Preferred Shares	3.375.000
2.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 22/08/2024	1.973.499
150	BNP Paribas Issuance BV - Participatory Note, 08/08/2025	139.050

Total ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 29/02/2024	99.883.689
55.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2024	54.710.480
55.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 04/04/2024	54.701.222
45.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2024	44.710.453
40.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2024	39.729.950
67.000.000	United Kingdom Gilt, 0.63%, 22/10/2050	33.487.829
67.500	Albemarle Corp	3.685.183

US Equity – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
8.205	Microsoft Corp	3.397.947
17.786	Amazon.com Inc	3.032.307
1.803	Broadcom Inc	2.525.014
6.012	NVIDIA Corp	2.311.551
11.352	Apple Inc	2.149.584
4.487	Meta Platforms Inc Class A	2.021.184
11.780	Alphabet Inc Class A	1.788.440
5.618	Salesforce Inc	1.534.245
6.853	Advanced Micro Devices Inc	1.200.085
2.048	Synopsys Inc	1.141.511
11.721	NIKE Inc Class B	1.096.352
1.778	Netflix Inc	1.028.729
1.426	Intuit Inc	899.292
1.231	ServiceNow Inc	897.318
3.134	Visa Inc Class A	860.102
1.629	UnitedHealth Group Inc	821.388
3.074	Workday Inc Class A	815.239
1.808	Mastercard Inc Class A	814.214
1.405	Thermo Fisher Scientific Inc	794.410
4.414	AbbVie Inc	743.424
7.336	TJX Cos Inc	724.952
2.413	McDonald's Corp	683.302
1.471	S&P Global Inc	642.431
2.532	Equifax Inc	633.280
9.745	NextEra Energy Inc	614.459
660	Eli Lilly & Co	582.231
2.787	CME Group Inc Class A	580.634
2.882	Analog Devices Inc	573.186
1.001	Adobe Inc	557.618
5.612	Okta Inc Class A	530.744
7.119	Uber Technologies Inc	518.589
14.774	Match Group Inc	512.234
12.998	Brookfield Asset Management Ltd Class A	511.088
7.440	Boston Scientific Corp	504.944
15.640	Keurig Dr Pepper Inc	498.816
2.130	CDW Corp	490.957
650	Costco Wholesale Corp	482.125
5.673	Walmart Inc	460.865

US Equity – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
3.959	Microsoft Corp	1.696.415
9.467	Alphabet Inc Class A	1.568.142
5.701	Progressive Corp	1.159.190
6.314	Amazon.com Inc	1.153.163
1.015	NVIDIA Corp	1.036.074
2.035	UnitedHealth Group Inc	997.659
3.726	Salesforce Inc	969.103
2.020	Adobe Inc	962.970
1.960	Meta Platforms Inc Class A	912.088
5.399	Johnson & Johnson	785.223
19.135	Match Group Inc	646.592
3.315	Waste Management Inc	646.270
2.545	Equifax Inc	627.767
5.370	Dollar Tree Inc	620.929
1.288	Mastercard Inc Class A	603.024
2.939	Analog Devices Inc	592.529
777	ServiceNow Inc	579.339
993	Intuit Inc	575.156
2.905	CME Group Inc Class A	572.619
888	Netflix Inc	558.508
2.803	Atlassian Corp Class A	504.890
26.965	Paycor HCM Inc	485.236
2.542	Apple Inc	474.421
2.026	Workday Inc Class A	471.961
1.744	McDonald's Corp	458.059
13.182	Keurig Dr Pepper Inc	448.756
24.197	Chewy Inc Class A	424.014
4.016	TJX Cos Inc	411.169
5.465	NextEra Energy Inc	403.531
1.745	Union Pacific Corp	391.920
501	Costco Wholesale Corp	367.613
1.875	Advanced Micro Devices Inc	348.037
3.643	Okta Inc Class A	336.261
1.001	Lululemon Athletica Inc	333.206
1.361	CDW Corp	322.153

US Equity Index PutWrite – Informe de compras y ventas significativas

Total compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
114.200.000	United States Treasury Note/Bond, 5.00%, 31/08/2025	115.025.547
108.300.000	United States Treasury Note/Bond, 4.25%, 31/05/2025	107.831.484
102.200.000	United States Treasury Note/Bond, 4.63%, 15/03/2026	102.719.836
102.200.000	United States Treasury Note/Bond, 4.63%, 28/02/2025	102.119.906
96.900.000	United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 15/06/2026	96.547.926
96.300.000	United States Treasury Note/Bond, 4.25%, 31/12/2024	95.844.297
87.200.000	United States Treasury Note/Bond, 4.25%, 31/01/2026	86.988.813
18.000.000	United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 15/12/2025	17.868.516
15.000.000	United States Treasury Note/Bond, 3.50%, 15/09/2025	14.765.039
15.000.000	United States Treasury Note/Bond, 2.88%, 15/06/2025	14.660.742

Total ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
97.300.000	United States Treasury Note/Bond, 3.50%, 15/09/2025	95.749.281
96.300.000	United States Treasury Note/Bond, 4.25%, 31/12/2024	95.686.840
97.300.000	United States Treasury Note/Bond, 2.88%, 15/06/2025	95.072.742
90.000.000	United States Treasury Note/Bond, 0.25%, 15/06/2024	88.389.844
90.000.000	United States Treasury Note/Bond, 0.38%, 15/09/2024	87.479.297
86.400.000	United States Treasury Note/Bond, 0.25%, 15/03/2024	85.927.500
87.100.000	United States Treasury Note/Bond, 1.00%, 15/12/2024	84.303.273
80.700.000	United States Treasury Note/Bond, 1.75%, 15/03/2025	78.190.734
30.000.000	United States Treasury Note/Bond, 4.63%, 28/02/2025	29.859.375

US Large Cap Value – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
75.794	S&P Global Inc	33.009.132
175.011	QUALCOMM Inc	26.048.460
130.912	Abbott Laboratories	14.863.777
58.932	Advanced Micro Devices Inc	11.700.158
174.309	PayPal Holdings Inc	11.585.704
108.692	Walt Disney Co	11.573.929
37.508	Sherwin-Williams Co	11.528.012
78.472	Clorox Co	11.351.041
230.470	Freeport-McMoRan Inc	10.683.145
43.458	Danaher Corp	10.636.473
63.842	Applied Materials Inc	10.477.832
19.796	Elevance Health Inc	9.725.470
12.204	BlackRock Inc Class A	9.708.143
164.519	Agnico Eagle Mines Ltd	9.589.163
134.125	NextEra Energy Inc	9.256.039
542.463	Carnival Corp	9.244.910
65.020	Valero Energy Corp	9.026.877
120.474	American International Group Inc	8.650.161
71.058	ConocoPhillips	8.424.893
29.205	Cummins Inc	8.158.385
35.340	IQVIA Holdings Inc	7.947.431
84.533	Morgan Stanley	7.930.605
162.606	Dominion Energy Inc	7.684.782
57.654	Oracle Corp	7.657.930
579.564	Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	6.953.467
141.626	Wells Fargo & Co	6.916.688
184.973	FirstEnergy Corp	6.772.410
17.016	Goldman Sachs Group Inc	6.606.942
165.927	Baxter International Inc	6.602.498
94.093	Occidental Petroleum Corp	6.154.655
71.396	Colgate-Palmolive Co	5.998.558
29.546	Analog Devices Inc	5.895.943
148.418	Williams Cos Inc	5.798.208
44.259	Discover Financial Services	5.574.578
10.673	UnitedHealth Group Inc	5.446.678
17.617	Stryker Corp	5.439.685
122.542	US Bancorp	5.419.137
41.696	Prologis Inc	5.362.085
43.197	Micron Technology Inc	5.345.807
31.398	AbbVie Inc	5.182.838
40.806	Exxon Mobil Corp	4.870.153

US Large Cap Value – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
592.314	Gilead Sciences Inc	43.506.981
270.197	Procter & Gamble Co	43.327.101
569.883	Mondelez International Inc Class A	41.333.332
439.832	Duke Energy Corp	41.126.234
1.069.746	Exelon Corp	38.809.605
296.787	Merck & Co Inc	37.966.569
469.680	American Electric Power Co Inc	37.899.198
227.403	Johnson & Johnson	36.191.187
68.585	UnitedHealth Group Inc	34.423.759
317.532	DTE Energy Co	34.130.911
177.998	JPMorgan Chase & Co	32.812.691
78.955	Berkshire Hathaway Inc Class B	32.480.384
322.501	Walmart Inc	32.013.282
436.639	Sempra	30.948.585
140.822	Applied Materials Inc	28.295.667
79.946	Stryker Corp	27.987.695
126.520	CME Group Inc Class A	25.886.539
944.396	Pfizer Inc	25.677.605
172.597	PNC Financial Services Group Inc	25.512.102
377.258	Rio Tinto Plc ADR	24.688.751
225.061	Exxon Mobil Corp	23.754.747
400.585	Citigroup Inc	22.859.558
91.558	Becton Dickinson & Co	22.092.420
129.709	QUALCOMM Inc	21.238.868
74.343	Amgen Inc	20.583.118
278.278	CVS Health Corp	20.140.283
161.256	Zimmer Biomet Holdings Inc	20.077.123
1.164.517	AT&T Inc	19.772.664
483.146	Verizon Communications Inc	19.542.915
387.286	Las Vegas Sands Corp	19.434.569
72.115	Air Products & Chemicals Inc	18.775.436
560.208	Newmont Corp	18.448.346
420.672	Comcast Corp Class A	18.093.816
162.876	Franco-Nevada Corp	17.418.214
330.869	Kroger Co	16.532.897
38.173	S&P Global Inc	16.366.689
88.044	International Business Machines Corp	16.133.859
292.456	Wells Fargo & Co	16.128.122
130.912	Abbott Laboratories	14.584.675

US Long Short Equity – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
89.500	Waystar Holding Corp	1.924.250
7.436	Norfolk Southern Corp	1.909.721
1.341	Broadcom Inc	1.782.218
3.081	Synopsys Inc	1.674.972
37.318	Brookfield Asset Management Ltd Class A	1.456.115
15.053	NIKE Inc Class B	1.360.206
2.372	NVIDIA Corp	1.162.757
2.041	MSCI Inc Class A	973.919
5.010	Advanced Micro Devices Inc	881.385
4.639	General Electric Co	769.108
4.072	JPMorgan Chase & Co	758.922
1.008	ServiceNow Inc	688.763
5.980	Dollar Tree Inc	677.686
18.162	FirstEnergy Corp	670.697
3.480	Apple Inc	662.769
4.200	Micron Technology Inc	643.175
11.149	Citigroup Inc	642.334
3.263	Constellation Energy Corp	624.156
6.675	Canadian Pacific Kansas City Ltd	555.064
1.197	Meta Platforms Inc Class A	532.798
1.252	Lululemon Athletica Inc	489.501
1.931	Salesforce Inc	450.738
688	Netflix Inc	412.758
451	Eli Lilly & Co	397.036
11.555	Match Group Inc	372.318
13.389	Sweetgreen Inc Class A	326.437
10.931	Keurig Dr Pepper Inc	324.871
466	HubSpot Inc	313.725
13.503	Avantor Inc	299.318

US Long Short Equity – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
15.646	Progressive Corp	3.219.010
4.196	Adobe Inc	2.002.021
3.985	Meta Platforms Inc Class A	1.854.813
3.631	UnitedHealth Group Inc	1.764.013
10.742	Splunk Inc	1.672.127
16.581	WEC Energy Group Inc	1.317.207
45.598	Sweetgreen Inc Class A	1.220.809
58.864	Chewy Inc Class A	1.210.124
11.853	TJX Cos Inc	1.198.536
5.418	Boeing Co	1.099.641
3.767	Salesforce Inc	1.031.591
50.887	Kenvue Inc	1.014.019
22.338	Brookfield Corp	977.292
954.000	Meta Platforms Inc, 4.65%, 15/08/2062	866.744
4.910	Atlassian Corp Class A	838.758
8.732	Lamb Weston Holdings Inc	794.707
944	ServiceNow Inc	711.634
2.687	Equifax Inc	682.008
910	Costco Wholesale Corp	637.902
943.000	Walmart Inc, 2.65%, 22/09/2051	636.162
939.000	Microsoft Corp, 2.50%, 15/09/2050	612.355
746	NVIDIA Corp	610.008
6.675	Canadian Pacific Kansas City Ltd	602.142
2.383	Union Pacific Corp	598.563
943.000	Johnson & Johnson, 2.45%, 01/09/2060	570.266
819.000	Apple Inc, 2.85%, 05/08/2061	537.037
2.671	Waste Management Inc	529.977
2.500	L3Harris Technologies Inc	516.232
6.977	NextEra Energy Inc	505.926
814	Netflix Inc	498.235
3.394	Dollar Tree Inc	495.834
690.000	Amazon.com Inc, 3.25%, 12/05/2061	489.018
1.252	Lululemon Athletica Inc	420.819

US Multi Cap Opportunities – Informe de compras y ventas significativas

Total compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
80.000	Nasdaq Inc	4.844.779
18.000	Charles River Laboratories International Inc	4.016.112
60.000	NextEra Energy Inc	3.976.788
24.000	TransUnion	1.670.994
11.000	Oracle Corp	1.307.040
18.800	Ball Corp	1.138.365
300	Booking Holdings Inc	1.029.042
7.000	Veralto Corp	542.884
3.000	EOG Resources Inc	386.662
4.000	TJX Cos Inc	370.640
2.300	Intercontinental Exchange Inc	307.556
1.200	Verisk Analytics Inc Class A	267.996
1.000	McDonald's Corp	253.700
4.000	Aramark	123.218

US Multi Cap Opportunities – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
39.000	Alphabet Inc Class C	5.834.277
59.000	RTX Corp	5.523.119
13.000	Berkshire Hathaway Inc Class B	5.183.666
77.000	Charles Schwab Corp	5.115.636
26.000	JPMorgan Chase & Co	4.904.303
140.000	Simply Good Foods Co	4.787.343
15.000	HCA Healthcare Inc	4.558.170
170.000	Graphic Packaging Holding Co	4.487.437
40.000	Walt Disney Co	4.301.184
23.000	Amazon.com Inc	4.026.455
98.000	CSX Corp	3.513.342
14.000	Chubb Ltd	3.461.541
150.500	Brookfield Renewable Corp Class A	3.368.259
245.000	Vestis Corp	3.228.380
16.000	Apple Inc	2.920.134
71.000	Brookfield Corp	2.875.298
17.000	T-Mobile US Inc	2.801.773
8.000	Motorola Solutions Inc	2.621.495
25.000	NIKE Inc Class B	2.520.117
9.400	WD-40 Co	2.509.228
6.500	Deere & Co	2.441.028
33.000	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	2.437.028
75.000	Aramark	2.369.660
5.500	Microsoft Corp	2.246.295
8.600	Nordson Corp	2.225.916
8.900	Eagle Materials Inc	2.116.081
21.000	TJX Cos Inc	2.080.460
70.000	Pfizer Inc	1.967.639
8.700	Lowe's Cos Inc	1.930.322
38.000	US Foods Holding Corp	1.878.643
11.500	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	1.698.383
23.800	Ball Corp	1.500.792
19.200	Mondelez International Inc Class A	1.418.533
5.800	Becton Dickinson & Co	1.385.935

US Real Estate Securities – Informe de compras y ventas significativas

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
93.441	AvalonBay Communities Inc	16.888.954
157.467	Camden Property Trust	15.190.780
292.483	UDR Inc	10.860.104
69.961	Digital Realty Trust Inc	9.963.203
183.882	Gaming & Leisure Properties Inc	8.538.281
69.186	Federal Realty Investment Trust	6.945.653
420.978	Macerich Co	6.609.743
525.725	American Healthcare REIT Inc	6.317.860
123.376	Ventas Inc	6.110.449
132.216	Brookfield Corp	5.426.218
173.311	Essential Properties Realty Trust Inc	4.780.425
6.185	Equinix Inc	4.655.160
37.803	Sun Communities Inc	4.612.923
16.051	SBA Communications Corp Class A	3.256.470
87.919	Omega Healthcare Investors Inc	2.673.852
78.493	Invitation Homes Inc	2.658.145
33.393	Iron Mountain Inc	2.621.758
45.081	Rexford Industrial Realty Inc	2.180.128
9.880	American Tower Corp	1.891.304
69.117	Retail Opportunity Investments Corp	864.224

US Real Estate Securities – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
444.724	Apartment Income REIT Corp	16.865.915
62.292	Essex Property Trust Inc	14.699.095
117.239	Crown Castle Inc	12.357.093
413.943	VICI Properties Inc Class A	12.183.035
68.492	Extra Space Storage Inc	10.253.411
167.497	Equity Residential	10.031.471
35.468	Public Storage	10.017.790
10.748	Equinix Inc	8.700.527
38.304	American Tower Corp	7.314.791
55.534	Prologis Inc	6.526.313
345.979	Kimco Realty Corp	6.427.184
90.512	Boston Properties Inc	5.691.535
327.567	Urban Edge Properties	5.372.491
98.450	Realty Income Corp	5.235.133
87.677	Regency Centers Corp	5.232.640
34.375	Simon Property Group Inc	5.032.447
54.493	Welltower Inc	5.010.665
22.413	SBA Communications Corp Class A	4.900.557
121.919	American Homes 4 Rent Class A	4.314.739
21.621	AvalonBay Communities Inc	4.081.665
108.781	Invitation Homes Inc	3.762.781
80.512	Ventas Inc	3.683.578
22.481	EastGroup Properties Inc	3.651.287
235.073	American Healthcare REIT Inc	3.293.317
94.238	Weyerhaeuser Co	3.008.015
37.390	Iron Mountain Inc	2.867.288
21.578	Sun Communities Inc	2.640.700
88.228	Omega Healthcare Investors Inc	2.605.167
22.606	Camden Property Trust	2.275.734
51.056	Gaming & Leisure Properties Inc	2.250.294

US Small Cap – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
216.900	CNX Resources Corp	4.971.203
18.861	Installed Building Products Inc	4.095.571
71.930	Enerpac Tool Group Corp Class A	2.487.615
15.113	Enpro Inc	2.324.203
25.835	Federal Signal Corp	2.007.400
15.787	Armstrong World Industries Inc	1.885.491
15.020	Rogers Corp	1.762.570
8.849	Simpson Manufacturing Co Inc	1.574.644
12.173	Crane Co	1.563.559
16.367	IDACORP Inc	1.545.671
35.178	Valvoline Inc	1.493.755
20.045	Power Integrations Inc	1.491.727
38.629	Viper Energy Inc Class A	1.326.265
7.595	Tetra Tech Inc	1.259.788
15.184	Arcosa Inc	1.258.061
164.779	Computer Modelling Group Ltd	1.248.641
650	White Mountains Insurance Group Ltd	1.152.152
14.980	CBIZ Inc	1.108.626
13.719	Haemonetics Corp	1.045.016
16.293	Prosperity Bancshares Inc	1.027.629
168.832	Transocean Ltd	1.004.541
8.192	Bright Horizons Family Solutions Inc	859.919
30.361	Stevanato Group SpA	805.314
4.806	Standex International Corp	734.440
7.008	ESCO Technologies Inc	723.550

US Small Cap – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Ventas agregadas que superan el 1% del valor total de las ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
761.145	Southwestern Energy Co	5.560.077
4.075	Fair Isaac Corp	5.141.588
23.757	FTI Consulting Inc	4.713.929
148.067	Model N Inc	4.346.512
10.903	Pool Corp	4.135.737
13.479	CSW Industrials Inc	3.183.163
6.656	Atrion Corp	3.001.737
32.108	Tidewater Inc	2.821.098
8.539	Kadant Inc	2.732.870
10.667	Eagle Materials Inc	2.672.163
10.615	Manhattan Associates Inc	2.627.097
11.355	MarketAxess Holdings Inc	2.478.748
18.205	LCI Industries	2.105.025
9.436	UFP Technologies Inc	2.092.692
87.067	NetScout Systems Inc	1.882.754
9.032	Quaker Chemical Corp	1.678.535
21.122	Lattice Semiconductor Corp	1.631.670
13.822	SPX Technologies Inc	1.631.445
37.300	QuidelOrtho Corp	1.604.410
4.245	West Pharmaceutical Services Inc	1.599.175
2.459	Chemed Corp	1.556.876
7.927	SPS Commerce Inc	1.461.646
8.737	Qualys Inc	1.459.802
5.345	RBC Bearings Inc	1.432.334
5.246	Nordson Corp	1.391.200
15.239	Kirby Corp	1.358.795
1.600	Texas Pacific Land Corp	1.347.001
7.637	FirstService Corp	1.274.618
5.854	Asbury Automotive Group Inc	1.268.910
6.912	Tetra Tech Inc	1.253.053
5.065	Littelfuse Inc	1.193.066
16.152	Bio-Techne Corp	1.163.807
33.294	Simply Good Foods Co	1.163.385
6.846	Nexstar Media Group Inc Class A	1.144.412

US Small Cap Intrinsic Value – Informe de compras y ventas significativas

Compras agregadas que superan el 1% del valor total de las compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
47.190	Ormat Technologies Inc	3.140.723
111.916	Wolfspeed Inc	2.652.821
120.081	International Game Technology Plc	2.520.725
170.012	Banc of California Inc	2.472.450
55.591	New Jersey Resources Corp	2.405.819
46.933	Northwestern Energy Group Inc	2.363.220
55.079	Portland General Electric Co	2.352.407
153.008	Viasat Inc	2.267.741
19.342	Atmos Energy Corp	2.266.499
261.104	Alight Inc Class A	2.162.578
159.149	Huntington Bancshares Inc	1.978.928
19.040	IPG Photonics Corp	1.694.607
25.815	ALLETE Inc	1.569.326
24.958	Stericycle Inc	1.243.463
27.867	Helios Technologies Inc	1.221.446
296.140	TETRA Technologies Inc	1.148.710
38.437	Mercury Systems Inc	1.086.226
31.113	Integra LifeSciences Holdings Corp	898.080
128.820	indie Semiconductor Inc Class A	858.720
22.948	Veeco Instruments Inc	826.430
101.415	Under Armour Inc Class C	795.177
9.001	Whirlpool Corp	791.172
73.241	OraSure Technologies Inc	552.512
31.068	Varex Imaging Corp	492.176

US Small Cap Intrinsic Value – Informe de compras y ventas significativas (cont.)

20 ventas de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
76.859	Crown Holdings Inc	5.949.769
100.421	Stericycle Inc	5.788.313
50.973	Vistra Corp	3.924.919
74.640	Enerpac Tool Group Corp Class A	2.620.514
28.955	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	2.567.800
48.761	Comerica Inc	2.256.592
24.536	Itron Inc	2.242.110
82.926	BankUnited Inc	2.221.314
22.992	Rambus Inc	1.504.834
3.690	Molina Healthcare Inc	1.378.908
18.523	Coherent Corp	1.153.270
202.599	Oil States International Inc	1.151.558
23.287	Varonis Systems Inc Class B	1.009.740
6.829	Entegris Inc	887.869
87.552	RLJ Lodging Trust	876.085
4.493	Wix.com Ltd	773.375
86.537	Chatham Lodging Trust	735.931
16.155	TechnipFMC Plc	397.851
30.371	Children's Place Inc	349.296
14.454	EMCORE Corp	14.761

NOTAS DE LAS CUENTAS ABREVIADAS NO AUDITADAS

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

1. PRINCIPALES POLÍTICAS CONTABLES

Las principales normas de contabilidad adoptadas por Neuberger Berman Investment Funds plc (la "Sociedad") son las que se indican a continuación.

Criterios aplicados en la preparación de las Cuentas

Las cuentas presentadas son las cuentas abreviadas no auditadas correspondientes al semestre finalizado el 30 de junio de 2024. Han sido elaboradas de conformidad con la norma Financial Reporting Standard («FRS») 104: «Interim Financial Reporting» (Cuentas provisionales) emitida por el Financial Reporting Council («FRC»). Las cuentas abreviadas no auditadas se deben analizar junto con las cuentas anuales correspondientes al ejercicio finalizado el 31 de diciembre de 2023, elaboradas con arreglo a las normas contables generalmente aceptadas en Irlanda, la legislación irlandesa, que incluye la Ley de Sociedades de 2014 (en su versión modificada), el reglamento denominado European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations de 2011 y posteriores modificaciones, y el reglamento denominado Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 (el «Reglamento sobre OICVM del Banco Central»). Han sido elaboradas de conformidad con la norma FRS 102: «The financial reporting standard applicable in the UK and Republic of Ireland» (Norma de información financiera aplicable al Reino Unido y la República de Irlanda). Las normas contables generalmente aceptadas en Irlanda para la elaboración de las cuentas que den una imagen fiel son las publicadas por el Instituto de Censores Jurados de Cuentas (Institute of Chartered Accountants) de Irlanda y promulgadas por el FRC.

Las cuentas se han elaborado con arreglo al principio del coste histórico, modificado por la revalorización de los activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados. La hora de valoración es el cierre del mercado del día de negociación correspondiente. Será un día de negociación cada día hábil o cualquier otro día que el Consejo de administración determine y notifique con antelación al Agente administrativo y a los accionistas. Los Consejeros han valorado la capacidad de la Sociedad para seguir suponiendo la continuidad de su actividad y están convencidos de que cuenta con los recursos necesarios para continuar su actividad en un futuro previsible y al menos en los 12 meses siguientes a la aprobación de estas cuentas. Además, el Consejo de administración no tiene constancia de ninguna incertidumbre sustancial que pueda generar dudas importantes sobre la capacidad de la Sociedad para seguir suponiendo la continuidad de su actividad. Por consiguiente, las cuentas se elaboran suponiendo dicha continuidad.

El formato y parte de la redacción de las cuentas se han adaptado utilizando como base las incluidas en la Ley de Sociedades (Companies Act) de 2014 (en su versión modificada) y la FRS 102, con el fin de reflejar de una forma más apropiada, a juicio del Consejo de administración, la naturaleza de las actividades de la Sociedad como fondo de inversión. La Sociedad cumple los criterios para acogerse a la exención prevista por la FRS 102, con arreglo a la cual ciertos fondos de inversión colectiva no están obligados a elaborar un estado de flujos de caja.

Política de distribución

El Consejo de administración ha decidido acumular todos los ingresos netos de la inversión y las plusvalías materializadas netas atribuibles a las Clases de acumulación, por lo que no está previsto que se declaren dividendos respecto a las acciones de dichas clases.

Origen de las distribuciones

Los Estatutos facultan al Consejo de administración para declarar dividendos respecto de cualesquiera acciones con cargo a los ingresos netos (incluidos los ingresos por dividendos e intereses) o la diferencia entre las plusvalías materializadas y latentes y las minusvalías materializadas y latentes respecto de las inversiones de la Sociedad (conjuntamente «Ingresos netos») y también con cargo al capital. Los dividendos abonados con cargo al capital equivalen a una devolución o un reintegro de parte de la inversión inicial del accionista, o bien de cualesquiera plusvalías atribuibles a dicha inversión inicial. Dichos dividendos pueden dar lugar a una disminución inmediata del Valor liquidativo de las acciones correspondientes.

En la actualidad, el Consejo de administración tiene previsto, sin perjuicio de cualquier umbral *de minimis*, declarar y pagar un dividendo equivalente como mínimo al 85% de los Ingresos netos atribuibles a cada una de las clases de reparto, con excepción de las (i) clases de reparto (semanal); (ii) las clases de reparto (mensual); (iii) las clases de reparto (CG) y (iv) las demás clases de reparto de una Cartera respecto de las que el pago de dividendos con cargo al capital y de los Ingresos netos se disponga en el correspondiente Suplemento. No obstante, los accionistas deben tener en cuenta que el Consejo de administración puede decidir con total discrecionalidad si realiza dicha declaración y pagos en relación con una Clase de reparto.

En el caso de las Clases de reparto (semanal), las Clases de reparto (mensual) y las Clases de reparto (CG), el Consejo de administración tiene previsto declarar y pagar un dividendo semanal, mensual o semestral, según proceda, atribuible a las acciones de dichas clases, con cargo a una combinación de los Ingresos netos y capital, de manera que cuando los Ingresos netos del período correspondiente sean inferiores al importe declarado, el remanente se abonará con cargo al capital representado por las correspondientes acciones, lo que permitirá a las clases distribuir dividendos fijos de forma periódica. En el supuesto de que los Ingresos netos atribuibles a las clases de reparto (semanal), las clases de reparto (mensual) o a las clases de reparto (CG) superen el importe declarado durante el período correspondiente, la diferencia positiva entre los Ingresos netos y dicho importe se conservará en una cuenta de reparto respecto de las acciones correspondientes y formará parte del dividendo pagadero durante el siguiente período de reparto. Aunque lo expuesto constituye la intención del Consejo en el momento presente con respecto a la declaración y el pago de dividendos en las Clases de reparto (semanal), las Clases de reparto (mensual) y las Clases de reparto (CG), los Administradores podrán optar, a su entera discreción, por no realizar dicha declaración ni dichos pagos y no es posible garantizar que esos dividendos vayan a abonarse.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024**1. PRINCIPALES POLÍTICAS CONTABLES (CONT.)****Política de distribución (cont.)***Frecuencia de las distribuciones*

En circunstancias normales, el Consejo de administración tiene previsto que los dividendos relativos a:

- (a) cada una de las Clases de reparto (semanal) de todas las Carteras se declaren y abonen antes del último día hábil de cada semana;
- (b) cada una de las Clases de reparto (mensual) de todas las Carteras se declaren como máximo el último día hábil de cada mes y se abonen en el plazo de tres días hábiles después de dicha fecha;
- (c) cada una de las Clases de reparto (CG) de todas las Carteras se declaren con carácter semestral y se abonen en un plazo de treinta días hábiles;
- (d) cada una de las restantes Clases de reparto de China Bond, Euro Bond, Global Equity Megatrends y Ultra Short Term Euro Bond se declaren trimestralmente y se abonen en el plazo de treinta días hábiles en relación con los Ingresos netos de esas Clases de reparto correspondientes al trimestre anterior;
- (e) cada una de las restantes Clases de reparto de Climate Innovation, el CLO Income, el Commodities, el Corporate Hybrid Bond, el Developed Market FMP – 2027, el Emerging Market Debt - Hard Currency, el Emerging Market Debt - Local Currency, el Emerging Market Debt Blend, el Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend, el European High Yield Bond, el Event Driven , el Global Bond, el Global Flexible Credit Income, el Global High Yield SDG Engagement, el Global Investment Grade Credit, el Global Opportunistic Bond, el Global Real Estate Securities, el High Yield Bond, el Short Duration Emerging Market Debt, el Short Duration High Yield SDG Engagement, el Strategic Income, el Sustainable Asia High Yield, el Sustainable Emerging Market Corporate Debt, el Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency, el US Equity Index PutWrite y el US Real Estate Securities se declararán trimestralmente y se abonarán en el plazo de treinta días hábiles;
- (f) cada una de las restantes Clases de reparto de US Long Short Equity se declaren semestralmente y se abonen en el plazo de treinta días hábiles;
- (g) cada una de las restantes Clases de reparto de Uncorrelated Strategies, US Equity, US Large Cap Value, US Multi Cap Opportunities, US Small Cap y US Small Cap Intrinsic Value se declararán anualmente y se abonarán en el plazo de treinta días hábiles;
- (h) cada una de las restantes Clases de reparto de las demás Carteras se declaren de forma anual y se abonen como máximo en un plazo de treinta días hábiles en relación con los Ingresos netos de las Clases de reparto respecto del año natural finalizado el 31 de diciembre anterior;
- (i) cada una de las Clases de reparto de ingresos brutos (mensual) de las Carteras se declaren como máximo el último día hábil de cada mes y se abonen en el plazo de tres días hábiles, y
- (j) cada una de las restantes Clases de reparto de ingresos (brutos) de todas las Carteras se declaren con carácter trimestral y se abonen en un plazo de treinta días hábiles.

Siempre que existan ingresos disponibles para su distribución, el Consejo de administración también podrá acordar declarar y pagar dividendos a cuenta en relación con cualquiera de las Clases de reparto. Todas las Acciones en circulación de una Clase de reparto en cualquier fecha en la que el Consejo decida declarar un dividendo respecto de la misma tendrán derecho a recibir ese dividendo.

El Consejo de administración se reserva el derecho a modificar la política de dividendos de cualquier clase de acciones a su entera discreción, debiendo notificarlo previamente a los accionistas de la clase en cuestión. Una vez transcurridos seis años desde la fecha de su declaración, todo dividendo no reclamado vencerá y revertirá a la Cartera correspondiente.

Para el semestre finalizado el 30 de junio de 2024

2. Efectivo y equivalentes de efectivo

Todos los saldos de efectivo se mantienen en Brown Brothers Harriman & Co. o en otras entidades aprobadas por la Sociedad, en depósitos a un día o directamente en un subdepositario.

Varias cuentas de efectivo de la Sociedad están operadas por el Agente administrativo en representación de la Sociedad de acuerdo con las Directrices del Banco Central de Irlanda denominadas Fondos paraguas - Suscripción, reembolso y dividendos de cuentas de efectivo. La función de dichas cuentas de efectivo de la Sociedad es la de mantener los importes de suscripción no tramitados que se reciben de los inversores, los fondos para los reembolsos a los inversores u otras cantidades que se adeuden a estos. A fecha de 30 de junio de 2024, dichas cuentas de efectivo tenían un saldo de 4.148.051 USD (31 de diciembre de 2023: 331.887 USD). Todo saldo de estas cuentas de efectivo al final del período se refleja reflejado en el Balance consolidado de la Sociedad.

3. Descubierta bancario

A 30 de junio de 2024 y 31 de diciembre de 2023, todos los saldos por descubiertos bancarios que se reflejan en el Balance se mantienen con Brown Brothers Harriman & Co.

4. Capital social

El capital social autorizado de la Sociedad comprende 500.000.040.000 acciones sin valor nominal, de las que 40.000 son Acciones de fundadores sin valor nominal y 500.000.000.000 son acciones de participación sin valor nominal. El Consejo de administración está facultado para emitir un máximo de 500.000.000.000 acciones sin valor nominal de la Sociedad con arreglo a las condiciones que estime oportunas.

La Sociedad es una sociedad de inversión de capital variable por su capacidad para emitir y reembolsar acciones previa solicitud. El capital social de la Sociedad se divide en distintas series de acciones, y cada una de dichas series representa una cartera de activos de inversión diferente. Las Carteras gestionan el capital de conformidad con el Reglamento sobre OICVM y con los objetivos y políticas de inversión correspondientes a cada Cartera que se detallan en este Folleto y en el correspondiente Suplemento. Las Carteras no están sujetas a requisitos de capital impuestos desde el exterior. A pesar de que las Carteras invierten en valores mobiliarios y otros activos financieros líquidos, la Gestora también emplea un proceso de supervisión del riesgo de liquidez adecuado, que tiene en cuenta las operaciones de gestión eficiente utilizadas por las Carteras, con el fin de que cada una de ellas pueda cumplir sus términos y condiciones de reembolso establecidos.

Para mitigar posibles riesgos de liquidez, la Gestora adapta sus controles a diferentes estrategias de inversión, condiciones de liquidez y comportamientos históricos de los clientes. Durante su proceso de supervisión del riesgo la Gestora puede emplear diversas pruebas de liquidez, cuyos resultados pueden dar lugar a varias soluciones posibles, entre las que se incluyen el ajuste de la composición de activos, el uso de líneas de crédito o descubiertos aplicables o la adopción de otras medidas adecuadas para mantener un nivel aceptable de liquidez. Los acuerdos concretos de todas las Carteras serán revisados por el equipo de riesgo de la Gestora, los gestores de la Cartera correspondiente, el director de inversiones de la Gestora, así como el consejo de administración de la Gestora y los Consejeros. El equipo de riesgo de la Gestora somete las Carteras a pruebas de estrés periódicamente en el contexto de la composición de la cartera y de unas condiciones de mercado reales/potenciales. Se prueban escenarios de estrés con diferentes niveles de reembolso hipotéticos y se evalúa la capacidad de las Carteras para hacer frente en cada caso a las solicitudes de reembolso de forma ordenada. En caso de que el análisis concluya que alguna de las Carteras mantiene bajos índices de cobertura de liquidez, el equipo de riesgo de la Gestora y el equipo de la cartera debaten y emprenden acciones para valorar estos riesgos y determinar la mejor forma de mitigarlos. Además, se supervisan los informes diarios de reservas de liquidez para determinar el riesgo de liquidez de cada Cartera y se vigilan los factores de liquidez del mercado con el fin de detectar posibles anomalías en este sentido.

A 30 de junio de 2024 y a 31 de diciembre de 2023 había 2 Acciones de fundadores en circulación. Las Acciones de fundadores facultan a sus titulares para asistir y votar en las juntas generales de Accionistas de la Sociedad, pero no les otorgan derecho alguno a participar en los beneficios o en los activos de la Sociedad, salvo en el caso de la devolución del capital tras una liquidación. Las Acciones de participación facultan a sus titulares para asistir y votar en las juntas generales de la Sociedad, así como para participar en los beneficios y activos de la misma.

Los Accionistas fundadores son los siguientes:

Nombre del Accionista	Participación nominal
Matsack Nominees Limited	1
Neuberger Berman Europe Limited	1

Las suscripciones mínimas y los límites de reembolso de cada Cartera están recogidos en el Folleto de la Sociedad.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO

La Gestora tendrá derecho, con respecto a cada Clase, a una comisión por los servicios de gestión que presta a cada Cartera (la «Comisión de gestión»). La Gestora también tiene derecho a una comisión del 0,025% por los servicios auxiliares administrativos que presta a la Sociedad.

La comisión anual máxima que se cobrará a la Sociedad con respecto a una Cartera es del 2,5% de su Patrimonio neto; sin embargo, actualmente la Comisión de gestión pagadera con respecto a cada Cartera se divulgará en el correspondiente Suplemento. A continuación se recogen las comisiones de gestión vigentes para cada clase.

La Comisión de gestión se devenga diariamente y se paga a mes vencido al final de cada mes natural. A menos que en el Suplemento de la correspondiente Cartera se indique lo contrario, la Gestora pagará con cargo a su Comisión de gestión a todos los Gestores delegados de inversiones o asesores de inversiones designados para cada Cartera. La Gestora también puede solicitar a la Sociedad que le reembolse todos los gastos varios en que esta (o sus delegados) haya incurrido en el cumplimiento de sus obligaciones, y abonará dichos gastos reembolsados al proveedor de servicios correspondiente.

5G Connectivity	Comisión de gestión
Clase de acumulación A AUD	1,70%
Clase de acumulación E AUD	1,70%
Clase de acumulación I2 AUD	0,68%
Clase de acumulación A CHF	1,70%
Clase de acumulación I CHF	0,85%
Clase de acumulación I2 CHF	0,68%
Clase de acumulación A CNY	1,70%
Clase de acumulación I2 CNY	0,68%
Clase de acumulación A EUR	1,70%
Clase de acumulación sin cobertura A EUR	1,70%
Clase de acumulación I EUR	0,85%
Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,85%
Clase de acumulación I2 EUR	0,68%
Clase de acumulación I5 EUR	0,43%
Clase de acumulación sin cobertura M EUR	1,70%
Clase de acumulación A GBP	1,70%
Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,85%
Clase de acumulación I2 GBP	0,68%
Clase de acumulación A HKD	1,70%
Clase de acumulación I2 HKD	0,68%
Clase de acumulación A SGD	1,70%
Clase de acumulación I2 SGD	0,68%
Clase de acumulación A USD	1,70%
Clase de acumulación E USD	1,80%
Clase de acumulación I USD	0,85%
Clase de reparto I USD	0,85%
Clase de acumulación I2 USD	0,68%
Clase de acumulación I3 USD	0,60%
Clase de acumulación I5 USD	0,43%

5G Connectivity (cont.)	Comisión de gestión
Clase de acumulación M USD	1,70%
Clase de acumulación Z USD	0,00%
Clase de acumulación A ZAR	1,70%
Clase de acumulación E ZAR	1,80%

China A-Share Equity

Clase de acumulación I CNY	0,90%
Clase de acumulación sin cobertura I USD	0,90%
Clase de reparto sin cobertura I USD	0,90%

China Bond

Clase de reparto (mensual) A CNY	1,30%
Clase de reparto I CNY	0,65%
Clase de acumulación Z CNY	0,00%
Clase de acumulación I2 GBP	0,52%
Clase de reparto sin cobertura (mensual) A SGD	1,30%
Clase de acumulación sin cobertura I USD	0,65%
Clase de acumulación Z USD	0,00%
Clase de acumulación sin cobertura Z USD	0,00%

China Equity

Clase de acumulación I CHF	1,10%
Clase de acumulación A EUR	1,85%
Clase de acumulación I EUR	1,10%
Clase de acumulación Z EUR	0,00%
Clase de acumulación A SGD	1,85%
Clase de acumulación A USD	1,85%
Clase de reparto A USD	1,85%
Clase de acumulación I USD	1,10%

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO (CONT.)

China Equity (cont.)	Comisión de gestión
Clase de acumulación I2 USD	0,88%
Clase de acumulación M USD	1,85%
Clase de acumulación U USD	1,45%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

Climate Innovation¹

Clase de acumulación A USD	1,70%
Clase de acumulación I USD	0,85%
Clase de acumulación I5 USD	0,43%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

CLO Income

Clase de acumulación A EUR	1,50%
Clase de acumulación I EUR	0,75%
Clase de reparto I2 EUR	0,60%
Clase de acumulación X EUR	0,40%
Clase de acumulación Z GBP	0,00%
Clase de acumulación I SEK	0,75%
Clase de acumulación A USD	1,50%
Clase de acumulación I USD	0,75%
Clase de reparto I USD	0,75%
Clase de reparto I2 USD	0,60%
Clase de acumulación I4 USD	0,45%
Clase de reparto I5 USD	0,38%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

Commodities

Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,65%
Clase de acumulación I5 GBP	0,33%
Clase de acumulación A USD	1,40%
Clase de acumulación I USD	0,65%
Clase de acumulación I5 USD	0,33%
Clase de acumulación M USD	1,40%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

Corporate Hybrid Bond

Clase de reparto (mensual) A AUD	1,20%
Clase de reparto A CHF	1,20%
Clase de acumulación I3 CHF	0,42%
Clase de acumulación P CHF	0,57%
Clase de reparto P CHF	0,57%
Clase de reparto (mensual) A EUR	1,20%

Corporate Hybrid Bond (cont.)	Comisión de gestión
Clase de acumulación A EUR	1,20%
Clase de acumulación I EUR	0,60%
Clase de reparto I EUR	0,60%
Clase de acumulación I2 EUR	0,48%
Clase de reparto I2 EUR	0,48%
Clase de acumulación I3 EUR	0,42%
Clase de acumulación I5 EUR	0,30%
Clase de acumulación M EUR	1,20%
Clase de reparto M EUR	1,20%
Clase de acumulación P EUR	0,57%
Clase de reparto P EUR	0,57%
Clase de acumulación I GBP	0,60%
Clase de acumulación I2 GBP	0,48%
Clase de reparto I2 GBP	0,48%
Clase de acumulación P GBP	0,57%
Clase de reparto P GBP	0,57%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,20%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,20%
Clase de acumulación A USD	1,20%
Clase de reparto A USD	1,20%
Clase de acumulación C1 USD	1,20%
Clase de acumulación I USD	0,60%
Clase de reparto I USD	0,60%
Clase de acumulación I2 USD	0,48%
Clase de reparto I2 USD	0,48%
Clase de acumulación M USD	1,20%
Clase de reparto M USD	1,20%
Clase de acumulación P USD	0,57%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

Developed Market FMP – 2027¹

Clase de acumulación A EUR	0,65%
Clase de reparto I EUR	0,30%
Clase de acumulación A USD	0,65%
Clase de reparto A USD	0,65%
Clase de acumulación I USD	0,30%
Clase de reparto I USD	0,30%
Clase de acumulación X USD	0,40%

Emerging Market Debt - Hard Currency

Clase de reparto (mensual) A AUD	1,40%
Clase de reparto I AUD	0,70%

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO (CONT.)

Emerging Market Debt - Hard Currency (cont.)	Comisión de gestión	Emerging Market Debt - Local Currency	Comisión de gestión
Clase de acumulación sin cobertura I3 CAD	0,49%	Clase de reparto (mensual) B AUD	1,80%
Clase de acumulación I2 CHF	0,56%	Clase de acumulación B AUD	1,80%
Clase de acumulación P CHF	0,67%	Clase de reparto (mensual) E AUD	1,80%
Clase de reparto (mensual) A EUR	1,40%	Clase de acumulación E AUD	1,80%
Clase de acumulación A EUR	1,40%	Clase de reparto (mensual) T AUD	1,80%
Clase de acumulación I EUR	0,70%	Clase de acumulación T AUD	1,80%
Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,70%	Clase de acumulación A EUR	1,50%
Clase de reparto I EUR	0,70%	Clase de acumulación I EUR	0,75%
Clase de acumulación I2 EUR	0,56%	Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,75%
Clase de reparto I2 EUR	0,56%	Clase de acumulación sin cobertura I2 EUR	0,60%
Clase de acumulación I3 EUR	0,49%	Clase de reparto sin cobertura I4 EUR	0,45%
Clase de acumulación I4 EUR	0,42%	Clase de acumulación sin cobertura Y EUR	0,36%
Clase de acumulación sin cobertura I5 EUR	0,35%	Clase de acumulación I GBP	0,75%
Clase de acumulación M EUR	1,40%	Clase de acumulación sin cobertura I4 GBP	0,45%
Clase de reparto M EUR	1,40%	Clase de reparto sin cobertura I4 GBP	0,45%
Clase de acumulación P EUR	0,67%	Clase de acumulación sin cobertura Y GBP	0,36%
Clase de acumulación Z EUR	0,00%	Clase de acumulación A SEK	1,50%
Clase de acumulación I GBP	0,70%	Clase de reparto (mensual) A SGD	1,50%
Clase de reparto I GBP	0,70%	Clase de reparto (mensual) A USD	1,50%
Clase de acumulación I2 GBP	0,56%	Clase de acumulación A USD	1,50%
Clase de reparto I2 GBP	0,56%	Clase de reparto (mensual) B USD	1,80%
Clase de acumulación P GBP	0,67%	Clase de acumulación B USD	1,80%
Clase de reparto (mensual) A HKD	1,40%	Clase de reparto (mensual) E USD	1,80%
Clase de acumulación I JPY	0,70%	Clase de acumulación E USD	1,80%
Clase de acumulación A SEK	1,40%	Clase de reparto (mensual) I USD	0,75%
Clase de acumulación I2 SEK	0,56%	Clase de acumulación I USD	0,75%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,40%	Clase de reparto I USD	0,75%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,40%	Clase de acumulación I2 USD	0,60%
Clase de acumulación A USD	1,40%	Clase de acumulación I5 USD	0,38%
Clase de reparto A USD	1,40%	Clase de reparto (mensual) T USD	1,80%
Clase de acumulación C1 USD	1,40%	Clase de acumulación T USD	1,80%
Clase de acumulación I USD	0,70%	Clase de acumulación X USD	0,38%
Clase de reparto I USD	0,70%	Clase de acumulación Y USD	0,36%
Clase de acumulación I2 USD	0,56%	Clase de reparto (mensual) B ZAR	1,80%
Clase de reparto I2 USD	0,56%	Clase de acumulación B ZAR	1,80%
Clase de reparto I3 USD	0,49%	Clase de reparto (mensual) E ZAR	1,80%
Clase de acumulación M USD	1,40%	Clase de acumulación E ZAR	1,80%
Clase de reparto M USD	1,40%	Clase de reparto (mensual) T ZAR	1,80%
Clase de acumulación P USD	0,67%	Clase de acumulación T ZAR	1,80%
Clase de acumulación X USD	0,40%		
Clase de acumulación Z USD	0,00%		

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO (CONT.)

Emerging Market Debt Blend	Comisión de gestión
Clase de reparto I3 AUD	0,49%
Clase de acumulación A EUR	1,40%
Clase de acumulación I EUR	0,70%
Clase de reparto I EUR	0,70%
Clase de acumulación I2 EUR	0,56%
Clase de reparto I2 EUR	0,56%
Clase de reparto I3 EUR	0,49%
Clase de acumulación sin cobertura I4 EUR	0,42%
Clase de acumulación I5 EUR	0,35%
Clase de acumulación M EUR	1,40%
Clase de reparto M EUR	1,40%
Clase de acumulación Z EUR	0,00%
Clase de acumulación I GBP	0,70%
Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,70%
Clase de reparto I GBP	0,70%
Clase de reparto sin cobertura I GBP	0,70%
Clase de acumulación P GBP	0,67%
Clase de acumulación sin cobertura P GBP	0,67%
Clase de acumulación Z GBP	0,00%
Clase de acumulación U NOK	1,05%
Clase de acumulación A SEK	1,40%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,40%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,40%
Clase de acumulación A USD	1,40%
Clase de acumulación C1 USD	1,40%
Clase de acumulación I USD	0,70%
Clase de reparto I USD	0,70%
Clase de reparto I2 USD	0,56%
Clase de acumulación I5 USD	0,35%
Clase de acumulación M USD	1,40%
Clase de reparto M USD	1,40%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

**Emerging Market Debt Sustainable
Investment Grade Blend**

Clase de acumulación I2 AUD	0,48%
Clase de acumulación I NOK	0,60%
Clase de acumulación I3 NOK	0,42%
Clase de acumulación I USD	0,60%
Clase de acumulación I2 USD	0,48%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

Emerging Markets Equity	Comisión de gestión
Clase de acumulación B AUD	2,00%
Clase de acumulación E AUD	2,00%
Clase de acumulación T AUD	2,00%
Clase de reparto sin cobertura I CAD	1,00%
Clase de reparto I2 CAD	0,80%
Clase de acumulación I EUR	1,00%
Clase de acumulación M EUR	2,00%
Clase de acumulación Z EUR	0,00%
Clase de acumulación I GBP	1,00%
Clase de acumulación Z GBP	0,00%
Clase de acumulación A USD	2,00%
Clase de acumulación B USD	2,00%
Clase de acumulación E USD	2,00%
Clase de acumulación I USD	1,00%
Clase de acumulación M USD	2,00%
Clase de acumulación T USD	2,00%
Clase de acumulación Z USD	0,00%
Clase de acumulación B ZAR	2,00%
Clase de acumulación E ZAR	2,00%
Clase de acumulación T ZAR	2,00%

Euro Bond

Clase de acumulación I EUR	0,35%
Clase de reparto I EUR	0,35%
Clase de acumulación Z EUR	0,00%

Euro Bond Absolute Return

Clase de acumulación I EUR	0,45%
Clase de reparto I EUR	0,45%
Clase de acumulación I5 EUR	0,23%
Clase de acumulación Z EUR	0,00%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

European High Yield Bond

Clase de acumulación I CHF	0,60%
Clase de acumulación I EUR	0,60%
Clase de acumulación I2 EUR	0,48%
Clase de acumulación M EUR	1,20%
Clase de acumulación X EUR	0,20%
Clase de acumulación Y EUR	0,10%
Clase de reparto Y EUR	0,10%

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO (CONT.)

European High Yield Bond (cont.)	Comisión de gestión
Clase de reparto (mensual) A USD	1,20%
Clase de acumulación I USD	0,60%
Clase de acumulación X USD	0,20%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

European Sustainable Equity	
Clase de reparto A EUR	1,50%
Clase de acumulación I EUR	0,60%
Clase de reparto I EUR	0,60%
Clase de reparto I3 EUR	0,42%
Clase de acumulación I5 EUR	0,30%
Clase de acumulación M EUR	1,50%
Clase de acumulación Z EUR	0,00%
Clase de acumulación sin cobertura A USD	1,50%
Clase de acumulación sin cobertura I USD	0,60%
Clase de acumulación sin cobertura M USD	1,50%

Event Driven	
Clase de acumulación I EUR	1,00%
Clase de reparto I5 EUR	0,50%
Clase de acumulación I5 GBP	0,50%
Clase de reparto I5 GBP	0,50%
Clase de acumulación P GBP	0,95%
Clase de acumulación I USD	1,00%
Clase de acumulación I5 USD	0,50%

Global Bond	
Clase de reparto (mensual) T AUD	0,75%
Clase de acumulación I EUR - Índice con Cobertura	0,20%
Clase de acumulación C1 USD	0,40%
Clase de acumulación I USD - Índice con Cobertura	0,20%
Clase de acumulación I USD	0,20%
Clase de acumulación M USD	0,40%
Clase de reparto (mensual) T USD	0,75%
Clase de acumulación Z USD	0,00%
Clase de reparto (mensual) T ZAR	0,75%

Global Equity Megatrends	
Clase de acumulación I EUR	0,80%
Clase de acumulación sin cobertura M EUR	1,60%
Clase de acumulación sin cobertura I4 GBP	0,48%
Clase de reparto sin cobertura I4 GBP	0,48%

Global Equity Megatrends (cont.)	Comisión de gestión
Clase de acumulación sin cobertura P GBP	0,76%
Clase de acumulación A SGD	1,60%
Clase de acumulación A USD	1,60%
Clase de acumulación C1 USD	1,60%
Clase de acumulación I USD	0,80%
Clase de acumulación I4 USD	0,48%
Clase de acumulación M USD	1,60%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

Global Flexible Credit Income	
Clase de acumulación I5 CAD	0,30%
Clase de acumulación I EUR	0,60%
Clase de acumulación M EUR	1,20%
Clase de acumulación I5 GBP	0,30%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,20%
Clase de acumulación A USD	1,20%
Clase de acumulación I USD	0,60%
Clase de reparto I USD	0,60%
Clase de acumulación M USD	1,20%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

Global High Yield SDG Engagement	
Clase de reparto I AUD	0,60%
Clase de acumulación I4 AUD	0,37%
Clase de acumulación I4 CHF	0,37%
Clase de reparto I4 CHF	0,37%
Clase de acumulación X CHF	1,10%
Clase de acumulación I4 EUR	0,37%
Clase de reparto I4 EUR	0,37%
Clase de acumulación X EUR	1,10%
Clase de acumulación Z (PF) EUR	0,10%
Clase de acumulación I4 GBP	0,37%
Clase de acumulación X GBP	1,10%
Clase de acumulación A USD	1,20%
Clase de acumulación I USD	0,60%
Clase de acumulación I4 USD	0,37%
Clase de reparto M USD	1,20%
Clase de acumulación X USD	1,10%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

Global Investment Grade Credit	
Clase de acumulación I EUR	0,30%

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO (CONT.)

Global Investment Grade Credit (cont.)	Comisión de gestión
Clase de acumulación I USD	0,30%
Clase de acumulación X USD	0,10%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

Global Opportunistic Bond	
Clase de acumulación I EUR	0,30%
Clase de acumulación P GBP	0,29%
Clase de acumulación A USD	0,60%
Clase de acumulación I USD	0,30%
Clase de reparto I USD	0,30%
Clase de acumulación I2 USD	0,24%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

Global Real Estate Securities	
Clase de acumulación M EUR	1,50%
Clase de acumulación sin cobertura Z EUR	0,00%
Clase de acumulación Z GBP	0,00%
Clase de acumulación A USD	1,50%
Clase de acumulación CI USD	1,50%
Clase de acumulación I USD	0,75%
Clase de reparto I5 USD	0,38%
Clase de acumulación M USD	1,50%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

Global Sustainable Equity	
Clase de acumulación sin cobertura I5 EUR	0,30%
Clase de acumulación sin cobertura M EUR	1,50%
Clase de acumulación sin cobertura Z EUR	0,00%
Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,60%
Clase de acumulación sin cobertura I5 GBP	0,30%
Clase de acumulación A USD	1,50%
Clase de acumulación I USD	0,60%
Clase de reparto I USD	0,60%
Clase de acumulación M USD	1,50%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

Global Sustainable Value	
Clase de acumulación M EUR	0,90%
Clase de acumulación sin cobertura I5 GBP	0,23%
Clase de acumulación sin cobertura P GBP	0,43%
Clase de acumulación A USD	0,90%
Clase de acumulación I USD	0,45%

Global Sustainable Value (cont.)	Comisión de gestión
Clase de acumulación I3 USD	0,32%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

High Yield Bond	
Clase de reparto (mensual) A AUD	1,20%
Clase de acumulación A AUD	1,20%
Clase de reparto (mensual) B AUD	1,80%
Clase de acumulación B AUD	1,80%
Clase de reparto (mensual) E AUD	1,80%
Clase de acumulación E AUD	1,80%
Clase de reparto I AUD	0,60%
Clase de reparto (mensual) T AUD	1,80%
Clase de reparto (semanal) T AUD	1,80%
Clase de acumulación T AUD	1,80%
Clase de reparto (mensual) A CAD	1,20%
Clase de acumulación A CHF	1,20%
Clase de acumulación I CHF	0,60%
Clase de acumulación I2 CHF	0,50%
Clase de reparto (mensual) A CNY	1,20%
Clase de reparto (mensual) I CNY	0,60%
Clase de reparto (mensual) A EUR	1,20%
Clase de acumulación A EUR	1,20%
Clase de reparto A EUR	1,20%
Clase de acumulación I EUR	0,60%
Clase de reparto I EUR	0,60%
Clase de acumulación I2 EUR	0,50%
Clase de reparto I2 EUR	0,50%
Clase de acumulación M EUR	1,20%
Clase de acumulación Z EUR	0,00%
Clase de reparto (mensual) A GBP	1,20%
Clase de acumulación A GBP	1,20%
Clase de reparto A GBP	1,20%
Clase de acumulación I GBP	0,60%
Clase de reparto I GBP	0,60%
Clase de acumulación I2 GBP	0,50%
Clase de reparto I2 GBP	0,50%
Clase de acumulación Z GBP	0,00%
Clase de reparto (mensual) A HKD	1,20%
Clase de acumulación A SEK	1,20%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,20%
Clase de acumulación A SGD	1,20%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,20%

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO (CONT.)

High Yield Bond (cont.)	Comisión de gestión
Clase de reparto (semanal) A USD	1,20%
Clase de acumulación A USD	1,20%
Clase de reparto A USD	1,20%
Clase de reparto (mensual) B USD	1,80%
Clase de acumulación B USD	1,80%
Clase de acumulación C USD	0,80%
Clase de acumulación C1 USD	1,20%
Clase de reparto C1 USD	1,20%
Clase de reparto (mensual) E USD	1,80%
Clase de acumulación E USD	1,80%
Clase de reparto (mensual) I USD	0,60%
Clase de acumulación I USD	0,60%
Clase de reparto I USD	0,60%
Clase de reparto (mensual) I2 USD	0,50%
Clase de acumulación I2 USD	0,50%
Clase de reparto I2 USD	0,50%
Clase de reparto (mensual) I4 USD	0,36%
Clase de acumulación M USD	1,20%
Clase de reparto M USD	1,20%
Clase de acumulación P USD	0,57%
Clase de reparto (mensual) T USD	1,80%
Clase de reparto (semanal) T USD	1,80%
Clase de acumulación T USD	1,80%
Clase de reparto (mensual) U USD	0,90%
Clase de acumulación U USD	0,90%
Clase de acumulación Z USD	0,00%
Clase de reparto (mensual) B ZAR	1,80%
Clase de reparto (mensual) E ZAR	1,80%
Clase de acumulación E ZAR	1,80%
Clase de reparto (mensual) T ZAR	1,80%
Clase de acumulación T ZAR	1,80%

InnovAsia 5G	
Clase de acumulación I4 CHF	0,51%
Clase de acumulación A EUR	1,70%
Clase de acumulación I4 EUR	0,51%
Clase de acumulación sin cobertura M EUR	1,70%
Clase de acumulación X EUR	1,45%
Clase de acumulación A SGD	1,70%
Clase de acumulación I4 SGD	0,51%
Clase de acumulación X SGD	1,45%
Clase de acumulación A USD	1,70%

InnovAsia 5G (cont.)	Comisión de gestión
Clase de acumulación I USD	0,85%
Clase de acumulación I4 USD	0,51%
Clase de acumulación M USD	1,70%
Clase de acumulación X USD	1,45%

Japan Equity Engagement

Clase de reparto I5 EUR	0,43%
Clase de acumulación sin cobertura I5 GBP	0,43%
Clase de acumulación sin cobertura P GBP	0,81%
Clase de acumulación A JPY	1,70%
Clase de acumulación I JPY	0,85%
Clase de reparto I JPY	0,85%
Clase de acumulación I5 JPY	0,43%
Clase de acumulación Z JPY	0,00%
Clase de acumulación A USD	1,70%
Clase de acumulación I USD	0,85%

Next Generation Mobility

Clase de acumulación A EUR	1,70%
Clase de acumulación I EUR	0,85%
Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,85%
Clase de acumulación sin cobertura M EUR	1,70%
Clase de acumulación A USD	1,70%
Clase de acumulación C1 USD	1,70%
Clase de acumulación I USD	0,85%
Clase de reparto I USD	0,85%
Clase de acumulación M USD	1,70%
Clase de acumulación X USD	1,55%

Next Generation Space Economy

Clase de acumulación sin cobertura I3 EUR	0,60%
Clase de acumulación sin cobertura M EUR	1,70%
Clase de acumulación I USD	0,85%

Responsible Asian Debt – Hard Currency

Clase de reparto (mensual) A USD	1,20%
Clase de acumulación A USD	1,20%
Clase de acumulación C1 USD	1,20%
Clase de acumulación I USD	0,60%
Clase de reparto I USD	0,60%
Clase de reparto (mensual) I4 USD	0,36%
Clase de acumulación I4 USD	0,36%

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO (CONT.)

Responsible Asian Debt – Hard Currency (cont.)	Comisión de gestión	Short Duration Emerging Market Debt (cont.)	Comisión de gestión
Clase de acumulación M USD	1,20%	Clase de acumulación I USD	0,50%
Clase de reparto (mensual) X USD	1,10%	Clase de reparto I USD	0,50%
Clase de acumulación X USD	1,10%	Clase de acumulación I2 USD	0,40%
Clase de acumulación Z USD	0,00%	Clase de reparto I2 USD	0,40%
Short Duration Emerging Market Debt		Clase de acumulación I5 USD	0,25%
Clase de reparto (mensual) A AUD	1,00%	Clase de reparto I5 USD	0,25%
Clase de reparto (mensual) A CAD	1,00%	Clase de acumulación M USD	1,00%
Clase de acumulación A CHF	1,00%	Clase de reparto M USD	1,00%
Clase de reparto A CHF	1,00%	Clase de acumulación P USD	0,48%
Clase de acumulación I CHF	0,50%	Clase de acumulación Z USD	0,00%
Clase de reparto I CHF	0,50%	Short Duration High Yield SDG Engagement	
Clase de acumulación I2 CHF	0,40%	Clase de reparto (mensual) A AUD	1,20%
Clase de reparto I2 CHF	0,40%	Clase de acumulación A CHF	1,20%
Clase de acumulación I5 CHF	0,25%	Clase de acumulación I CHF	0,60%
Clase de acumulación P CHF	0,48%	Clase de reparto (mensual) A CNY	1,20%
Clase de acumulación A EUR	1,00%	Clase de acumulación A EUR	1,20%
Clase de reparto A EUR	1,00%	Clase de reparto A EUR	1,20%
Clase de acumulación I EUR	0,50%	Clase de acumulación I EUR	0,60%
Clase de reparto I EUR	0,50%	Clase de acumulación I2 EUR	0,50%
Clase de acumulación I2 EUR	0,40%	Clase de acumulación M EUR	1,20%
Clase de reparto I2 EUR	0,40%	Clase de reparto M EUR	1,20%
Clase de acumulación I5 EUR	0,25%	Clase de acumulación I GBP	0,60%
Clase de acumulación M EUR	1,00%	Clase de reparto I GBP	0,60%
Clase de reparto M EUR	1,00%	Clase de acumulación I2 GBP	0,50%
Clase de acumulación P EUR	0,48%	Clase de reparto I2 GBP	0,50%
Clase de acumulación U EUR	0,75%	Clase de reparto (mensual) A HKD	1,20%
Clase de acumulación A GBP	1,00%	Clase de acumulación I JPY	0,60%
Clase de acumulación I GBP	0,50%	Clase de reparto (mensual) A SGD	1,20%
Clase de reparto I GBP	0,50%	Clase de reparto (mensual) A USD	1,20%
Clase de acumulación I2 GBP	0,40%	Clase de acumulación A USD	1,20%
Clase de reparto I2 GBP	0,40%	Clase de reparto A USD	1,20%
Clase de reparto I5 GBP	0,25%	Clase de acumulación C1 USD	1,20%
Clase de acumulación P GBP	0,48%	Clase de acumulación I USD	0,60%
Clase de acumulación I JPY	0,50%	Clase de reparto I USD	0,60%
Clase de reparto I JPY	0,50%	Clase de acumulación I2 USD	0,50%
Clase de acumulación A SEK	1,00%	Clase de reparto I2 USD	0,50%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,00%	Clase de acumulación I4 USD	0,36%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,00%	Clase de acumulación I5 USD	0,30%
Clase de acumulación A USD	1,00%	Clase de acumulación M USD	1,20%
Clase de reparto A USD	1,00%	Clase de reparto M USD	1,20%
Clase de acumulación C1 USD	1,00%	Clase de acumulación Z USD	0,00%
Clase de reparto C1 USD	1,00%		

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO (CONT.)

Strategic Income	Comisión de gestión	Sustainable Emerging Market Corporate Debt (cont.)	Comisión de gestión
Clase de reparto (mensual) A AUD	1,00%	Clase de acumulación A EUR	1,60%
Clase de reparto (mensual) E AUD	1,00%	Clase de acumulación I EUR	0,80%
Clase de reparto (mensual) Z AUD	0,00%	Clase de acumulación I3 EUR	0,48%
Clase de reparto (mensual) A CNY	1,00%	Clase de acumulación M EUR	1,60%
Clase de reparto (mensual) A EUR	1,00%	Clase de reparto M EUR	1,60%
Clase de acumulación A EUR	1,00%	Clase de acumulación X EUR	0,35%
Clase de acumulación I EUR	0,50%	Clase de acumulación I GBP	0,80%
Clase de acumulación M EUR	1,00%	Clase de acumulación A SEK	1,60%
Clase de reparto (mensual) A GBP	1,00%	Clase de reparto (mensual) A USD	1,60%
Clase de reparto (mensual) I GBP	0,50%	Clase de acumulación A USD	1,60%
Clase de reparto (mensual) A HKD	1,00%	Clase de acumulación C1 USD	1,60%
Clase de reparto (mensual) A JPY	1,00%	Clase de acumulación I USD	0,80%
Clase de acumulación I JPY	0,50%	Clase de reparto I USD	0,80%
Clase de acumulación sin cobertura I JPY	0,50%	Clase de acumulación I2 USD	0,64%
Clase de reparto CG I JPY	0,50%	Clase de acumulación M USD	1,60%
Clase de reparto I JPY	0,50%	Clase de reparto M USD	1,60%
Clase de acumulación Z JPY	0,00%		
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,00%	Sustainable Emerging Market Debt-Hard Currency	
Clase de acumulación A SGD	1,00%	Clase de acumulación I3 EUR	0,49%
Clase de reparto (mensual) I SGD	0,50%	Clase de acumulación I4 EUR	0,42%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,00%	Clase de acumulación X EUR	0,35%
Clase de acumulación A USD	1,00%	Clase de acumulación I USD	0,70%
Clase de reparto A USD	1,00%	Clase de acumulación I5 USD	0,35%
Clase de acumulación C1 USD	1,00%		
Clase de reparto (mensual) E USD	1,00%	Tactical Macro¹	
Clase de acumulación I USD	0,50%	Clase de acumulación I5 EUR	0,40%
Clase de reparto I USD	0,50%	Clase de acumulación I USD	0,80%
Clase de acumulación M USD	1,00%	Clase de acumulación I5 USD	0,40%
Clase de reparto M USD	1,00%	Clase de acumulación Z USD	0,00%
Clase de acumulación Z USD	0,00%		
Clase de reparto (mensual) A ZAR	1,00%	Ultra Short Term Euro Bond	
Clase de reparto (mensual) E ZAR	1,00%	Clase de acumulación P CHF	0,18%
		Clase de acumulación U CHF	0,29%
Sustainable Asia High Yield		Clase de acumulación A EUR	0,38%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,20%	Clase de acumulación I EUR	0,19%
Clase de acumulación A USD	1,20%	Clase de reparto I EUR	0,19%
Clase de acumulación I USD	0,60%	Clase de acumulación I2 EUR	0,15%
Clase de acumulación Z USD	0,00%	Clase de acumulación I5 EUR	0,09%
Clase de reparto Z USD	0,00%	Clase de acumulación M EUR	0,38%
		Clase de acumulación U EUR	0,29%
Sustainable Emerging Market Corporate Debt		Clase de acumulación Z EUR	0,00%
Clase de acumulación I CHF	0,80%		

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO (CONT.)

Ultra Short Term Euro Bond (cont.)	Comisión de gestión
Clase de acumulación I USD	0,19%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

Uncorrelated Strategies

Clase de acumulación I CHF	0,75%
Clase de acumulación A EUR	1,50%
Clase de acumulación I EUR	0,75%
Clase de acumulación I2 EUR	0,60%
Clase de acumulación M EUR	1,50%
Clase de acumulación P EUR	0,71%
Clase de acumulación I GBP	0,75%
Clase de acumulación I2 GBP	0,60%
Clase de reparto I2 GBP	0,60%
Clase de acumulación I5 GBP	0,38%
Clase de acumulación P GBP	0,71%
Clase de acumulación Z GBP	0,00%
Clase de acumulación I JPY	0,75%
Clase de acumulación A SGD	1,50%
Clase de acumulación A USD	1,50%
Clase de acumulación C1 USD	1,50%
Clase de acumulación I USD	0,75%
Clase de acumulación I2 USD	0,60%
Clase de acumulación I5 USD	0,38%
Clase de acumulación M USD	1,50%
Clase de acumulación P USD	0,71%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

US Equity

Clase de acumulación I5 EUR	0,38%
Clase de acumulación sin cobertura I5 EUR	0,38%
Clase de reparto sin cobertura I5 EUR	0,38%
Clase de acumulación sin cobertura X EUR	0,15%
Clase de reparto sin cobertura I5 GBP	0,38%
Clase de acumulación sin cobertura X GBP	0,15%
Clase de acumulación I3 JPY	0,53%
Clase de acumulación A USD	1,50%
Clase de acumulación I USD	0,75%
Clase de reparto I USD	0,75%
Clase de acumulación I5 USD	0,38%
Clase de reparto I5 USD	0,38%
Clase de acumulación M USD	1,50%
Clase de acumulación X USD	0,15%

US Equity Index PutWrite	Comisión de gestión
Clase de acumulación I EUR	0,60%
Clase de reparto I3 EUR	0,42%
Clase de acumulación I4 EUR	0,36%
Clase de reparto I4 EUR	0,36%
Clase de acumulación M EUR	1,20%
Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,60%
Clase de acumulación I3 GBP	0,42%
Clase de reparto I3 GBP	0,42%
Clase de reparto sin cobertura I3 GBP	0,42%
Clase de acumulación sin cobertura I4 GBP	0,36%
Clase de reparto I4 GBP	0,36%
Clase de reparto sin cobertura P GBP	0,57%
Clase de acumulación sin cobertura X GBP	0,34%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,20%
Clase de acumulación A USD	1,20%
Clase de reparto (mensual) I USD	0,60%
Clase de acumulación I USD	0,60%
Clase de reparto I3 USD	0,42%
Clase de acumulación I4 USD	0,36%
Clase de acumulación M USD	1,20%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

US Large Cap Value

Clase de acumulación A EUR	1,50%
Clase de acumulación sin cobertura A EUR	1,50%
Clase de acumulación I EUR	0,70%
Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,70%
Clase de reparto sin cobertura I4 EUR	0,42%
Clase de acumulación sin cobertura I5 EUR	0,35%
Clase de acumulación I GBP	0,70%
Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,70%
Clase de reparto I GBP	0,70%
Clase de reparto sin cobertura I GBP	0,70%
Clase de reparto sin cobertura I4 GBP	0,42%
Clase de acumulación sin cobertura P GBP	0,67%
Clase de reparto P GBP	0,67%
Clase de acumulación sin cobertura Y GBP	0,63%
Clase de reparto sin cobertura Y GBP	0,63%
Clase de acumulación A USD	1,50%
Clase de acumulación I USD	0,70%
Clase de reparto I4 USD	0,42%
Clase de acumulación I5 USD	0,35%

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO (CONT.)

US Large Cap Value (cont.)	Comisión de gestión
Clase de acumulación M USD	1,50%
Clase de acumulación Y USD	0,63%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

US Long Short Equity	
Clase de acumulación A EUR	2,25%
Clase de acumulación I EUR	1,35%
Clase de acumulación I3 EUR	0,95%
Clase de acumulación sin cobertura I3 EUR	0,95%
Clase de acumulación M EUR	2,25%
Clase de reparto I3 GBP	0,95%
Clase de acumulación A1 SGD	1,80%
Clase de acumulación A (PF) USD	1,70%
Clase de acumulación A USD	2,25%
Clase de acumulación A1 USD	1,80%
Clase de reparto I (PF) USD	1,00%
Clase de acumulación I USD	1,35%
Clase de acumulación I3 USD	0,95%
Clase de acumulación M USD	2,25%
Clase de acumulación U USD	1,80%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

US Multi Cap Opportunities	
Clase de acumulación E AUD	1,80%
Clase de acumulación T AUD	1,80%
Clase de acumulación I3 EUR	0,50%
Clase de acumulación M EUR	1,70%
Clase de acumulación A EUR1	1,70%
Clase de acumulación I EUR1	0,85%
Clase de reparto I3 GBP	0,50%
Clase de reparto sin cobertura I3 GBP	0,50%
Clase de acumulación A SGD	1,70%
Clase de acumulación B USD	1,80%
Clase de acumulación C1 USD	1,70%
Clase de acumulación E USD	1,80%
Clase de acumulación I2 USD	0,68%
Clase de acumulación I3 USD	0,50%
Clase de acumulación M USD	1,70%
Clase de acumulación T USD	1,80%
Clase de acumulación U USD	1,25%
Clase de acumulación Z USD	0,00%
Clase de acumulación A USD1	1,70%
Clase de acumulación I USD1	0,85%

US Multi Cap Opportunities (cont.)	Comisión de gestión
Clase de reparto I USD1	0,85%
Clase de acumulación B ZAR	1,80%
Clase de acumulación E ZAR	1,80%
Clase de acumulación T ZAR	1,80%

US Real Estate Securities	
Clase de reparto (mensual) A AUD	1,50%
Clase de reparto (mensual) B AUD	1,80%
Clase de acumulación B AUD	1,80%
Clase de reparto (mensual) E AUD	1,80%
Clase de acumulación E AUD	1,80%
Clase de reparto (mensual) T AUD	1,80%
Clase de acumulación T AUD	1,80%
Clase de acumulación A CHF	1,50%
Clase de acumulación A EUR	1,50%
Clase de acumulación I EUR	0,75%
Clase de acumulación M EUR	1,50%
Clase de reparto (mensual) A HKD	1,50%
Clase de acumulación A SGD	1,50%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,50%
Clase de acumulación A USD	1,50%
Clase de reparto A USD	1,50%
Clase de reparto (mensual) B USD	1,80%
Clase de acumulación B USD	1,80%
Clase de acumulación C1 USD	1,50%
Clase de reparto (mensual) E USD	1,80%
Clase de acumulación E USD	1,80%
Clase de reparto (mensual) I USD	0,75%
Clase de acumulación I USD	0,75%
Clase de reparto I USD	0,75%
Clase de acumulación I2 USD	0,54%
Clase de acumulación M USD	1,50%
Clase de reparto (mensual) T USD	1,80%
Clase de acumulación T USD	1,80%
Clase de acumulación Z USD	0,00%
Clase de reparto (mensual) B ZAR	1,80%
Clase de acumulación B ZAR	1,80%
Clase de reparto (mensual) E ZAR	1,80%
Clase de acumulación E ZAR	1,80%
Clase de reparto (mensual) T ZAR	1,80%
Clase de acumulación T ZAR	1,80%

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO (CONT.)

US Small Cap	Comisión de gestión	US Small Cap (cont.)	Comisión de gestión
Clase de acumulación B AUD	1,80%	Clase de acumulación I3 USD	0,60%
Clase de acumulación E AUD	1,80%	Clase de acumulación M USD	1,70%
Clase de acumulación T AUD	1,80%	Clase de acumulación T USD	1,80%
Clase de acumulación A EUR	1,70%	Clase de acumulación Z USD	0,00%
Clase de acumulación sin cobertura A EUR	1,70%	Clase de acumulación E ZAR	1,80%
Clase de acumulación I EUR	0,85%	Clase de acumulación T ZAR	1,80%
Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,85%		
Clase de acumulación sin cobertura I2 EUR	0,68%		
Clase de acumulación sin cobertura I4 EUR	0,51%		
Clase de acumulación M EUR	1,70%		
Clase de acumulación Z EUR	0,00%		
Clase de reparto sin cobertura I JPY	0,85%		
Clase de acumulación A USD	1,70%		
Clase de reparto A USD	1,70%		
Clase de acumulación B USD	1,80%		
Clase de acumulación E USD	1,80%		
Clase de acumulación I USD	0,85%		
Clase de reparto I USD	0,85%		

US Small Cap Intrinsic Value	
Clase de acumulación I3 EUR	0,60%
Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,85%
Clase de acumulación sin cobertura I2 GBP	0,68%
Clase de acumulación sin cobertura I3 JPY	0,60%
Clase de acumulación A USD	1,70%
Clase de acumulación I USD	0,85%
Clase de acumulación I2 USD	0,68%
Clase de acumulación M USD	1,70%

¹ Cartera lanzada durante el ejercicio contable anterior.

Cuando proceda, se puede aplicar un descuento a las comisiones citadas.

La Gestora puede renunciar a la totalidad o parte de sus comisiones para limitar los Ratios de gastos totales («TER») de las Carteras. Estas renunciaciones son voluntarias y la Gestora puede suspenderlas en cualquier momento sin previo aviso. La Gestora no podrá recuperar las comisiones a las que haya renunciado voluntariamente. En el Anexo I se incluye un desglose de los TER de las Carteras.

El Gestor delegado de inversiones tendrá derecho a percibir una comisión (la «Comisión suplementaria de asesoría») con respecto a cada Clase de Uncorrelated Strategies, a un tipo máximo del 0,75% del Valor liquidativo de la Cartera, a cambio de los servicios que los Asesores prestan a esta. La Comisión suplementaria de asesoría se acumulará a diario y se abonará a mes vencido en un plazo de 30 Días hábiles contados desde el final del mes natural.

La Sociedad pagará unas Comisiones de administración que no superarán el 0,20% anual del Patrimonio neto de la correspondiente Cartera. La Comisión de administración comprenderá una comisión pagadera al Agente administrativo por los servicios de administración que presta a cada Cartera y una comisión pagadera a la Gestora por los servicios auxiliares administrativos que presta a cada Cartera. Esta Comisión de administración se devengará mensualmente y se abonará a mes vencido.

La Sociedad abona/abonó al Agente administrativo comisiones de administración basadas en el valor al cierre de mes del Patrimonio neto de Uncorrelated Strategies y Uncorrelated Trading, a los tipos siguientes:

Activos entre 0 y 500 millones USD	0,055%
Activos entre 500 y 2.000 millones USD	0,05%
Activos por encima de 2.000 millones USD	0,04%

A partir del 1 de enero de 2024, la Sociedad abona al Agente administrativo comisiones de administración basadas en el valor al cierre de mes del Patrimonio neto de cada una de las restantes Carteras, a los tipos siguientes:

Activos entre 0 y 25.000 millones USD	0,0055%
Activos por encima de 25.000 millones USD	0,0025%

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024**5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO (CONT.)**

Las comisiones antes citadas están sujetas a una comisión mínima mensual de 1.900 USD por Cartera y se aplican a cinco clases de acciones por Cartera. A las Carteras que tengan más de cinco clases de acciones se les cobrará una comisión mensual de 100 USD por cada clase de acciones adicional.

En el ejercicio cerrado el 31 de diciembre de 2023, la Sociedad abonaba al Agente administrativo comisiones de administración basadas en el valor al cierre de mes del patrimonio neto de cada una de las restantes Carteras, a los tipos siguientes:

Activos entre 0 y 25.000 millones USD	0,008%
Activos por encima de 25.000 millones USD	0,005%

Las comisiones antes citadas estaban sujetas a una comisión mínima mensual de 4.000 USD por Cartera y se aplican a cuatro clases de acciones por Cartera. A las Carteras que tuvieran más de cuatro clases de acciones se les cobró una comisión mensual de 150 USD por cada clase de acciones adicional.

Por otra parte, el Agente administrativo tiene derecho a percibir una comisión adicional por los servicios de agencia de transmisiones que presta a las Carteras.

En relación con las Acciones B, C, E, C1 y C2 de cada Cartera, la Gestora y/o la Entidad comercializadora correspondiente tendrá derecho a cobrar, por los servicios de comercialización prestados a dichas Clases, una comisión de comercialización a una tasa anual del 1,00% del Valor liquidativo de las Clases en cuestión, que se devengará diariamente y se abonará a mes vencido al final de cada mes natural. En relación con las Acciones M de cada Cartera, la Gestora y/o la Entidad comercializadora correspondiente tendrá derecho a cobrar una comisión de comercialización anual por los servicios de comercialización prestados a dichas Clases. Esta se expresa como porcentaje del Valor liquidativo de las Clases en cuestión, que se devengará diariamente y se abonará a mes vencido al final de cada mes natural. El porcentaje de dicha comisión de comercialización varía según las Carteras y se detalla en el Suplemento de cada Cartera. En relación con todas las demás Clases, la Gestora podrá abonar a la Entidad comercializadora una comisión (a las tasas comerciales habituales) por los servicios de comercialización prestados, que también será pagadera con cargo a la Comisión de gestión.

Comisiones de los Subasesores no vinculados:

Las comisiones abonadas a los Subasesores no vinculados nombrados por la Gestora y/o el Gestor delegado de inversiones, a excepción de Green Court Capital Management Limited y de los subasesores de Uncorrelated Strategies Fund, se pagarán con cargo a los activos de la Cartera. Las comisiones totales abonadas a todos los asesores se situaron en torno al 0,65% y el 1,50% del Patrimonio neto de la Cartera. La comisión agregada de asesoría correspondiente al semestre finalizado el 30 de junio de 2024 fue de cero USD (30 de junio de 2023: 1.145.544 USD).

Comisiones de rentabilidad

En el periodo cerrado el 30 de junio de 2024 se calcula una comisión de rentabilidad correspondiente a US Long Short Equity, Global High Yield SDG Engagement, Event Driven, Tactical Macro y Uncorrelated Strategies.

Comisión de rentabilidad abonada a la Gestora y al Gestor delegado de Inversiones

La Gestora y un Gestor delegado de inversiones podrían tener derecho a percibir una comisión de rentabilidad (la "Comisión de rentabilidad") pagadera con cargo a los activos de la Cartera en relación con cada Clase PF de la Cartera pertinente. El Depositario verificará el cálculo de la Comisión de rentabilidad. El Consejo de administración podrá reducir la Comisión de rentabilidad pagadera por cada Clase de Acciones con el consentimiento de la Gestora. Las comisiones de rentabilidad se pagan sobre las plusvalías tanto materializadas como latentes, teniendo en cuenta las minusvalías materializadas y latentes al cierre del Período de cálculo que se indica más adelante para cada Cartera en cuestión. En consecuencia, las comisiones de rentabilidad podrán abonarse sobre las plusvalías latentes que podrían no llegar a materializarse.

Se informa a los Accionistas de que, dado que la Comisión de rentabilidad se calcula para la Clase y no para cada Accionista individual, podrían estar sujetos a dicha comisión incluso cuando el Valor liquidativo de sus Acciones no registre variaciones o descienda, por ejemplo, cuando los Accionistas compren o reembolsen Acciones en momentos distintos del inicio y el final del Período de cálculo.

En caso de que el Contrato de gestión o de un Gestor delegado de inversiones se resolviese antes de finalizar el Período de cálculo en cualquier año, la Comisión de rentabilidad relativa al Período de cálculo vigente en ese momento se calculará y abonará como si la fecha de resolución fuese la fecha final del Período de cálculo pertinente.

La Comisión de rentabilidad se tendrá en cuenta en el Patrimonio neto en cada Día de negociación y normalmente se abonará a la Gestora o a un Gestor delegado de inversiones en el plazo de 30 Días hábiles una vez finalizado el Período de cálculo. No obstante, si las Acciones se reembolsasen durante un Período de cálculo, la comisión de rentabilidad devengada en relación con las mismas se abonará a la Gestora o a un Gestor delegado de inversiones en el plazo de 30 Días hábiles a partir de la fecha de reembolso. Las Comisiones de rentabilidad cristalizadas se mantendrán en la Clase pertinente (pero no participarán en las posteriores ganancias y pérdidas de dicha Clase) hasta que se abonen a la Gestora o a un Gestor delegado de inversiones, y no se utilizarán ni estarán disponibles para atender los reembolsos o el pago de cualesquiera comisiones y gastos de la Clase pertinente.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO (CONT.)

Comisiones de rentabilidad (cont.)

Comisión de rentabilidad abonada a la Gestora y al Gestor delegado de Inversiones (cont.)

La metodología empleada para calcular la Comisión de rentabilidad para cada Cartera es la siguiente:

US Long Short Equity

La Gestora puede tener derecho a percibir una comisión de rentabilidad pagadera con cargo a los activos de la Cartera en relación con cada Clase PF de la Cartera.

Definiciones

Período de cálculo	El Período de cálculo comprenderá por lo general del 1 de enero al 31 de diciembre de cada año, con las siguientes excepciones: • cuando se produzca la emisión inicial de Acciones en cada Clase PF, el primer Período de cálculo irá desde la fecha de emisión hasta el 31 de diciembre; • cuando una Clase PF se extinga, el Período de cálculo terminará en la fecha en que se produzca tal extinción; y • si el Contrato de gestión se resuelve en cualquier año, el Período de cálculo terminará en la fecha en que se produzca esa resolución. El primer valor utilizado para determinar la primera Comisión de rentabilidad de una Clase PF será el Precio de oferta inicial.
Cristalización	Momento en el que es pagadera una Comisión de rentabilidad a la Gestora. La Cristalización se producirá bien al final del Período de cálculo o bien un Día de negociación en el que un Accionista reembolse o canjee total o parcialmente su Participación en Acciones.
Cota máxima	El que resulte mayor entre: (i) el precio de oferta inicial por Acción; y (ii) el Valor liquidativo de la Acción al final de cualquier Período de cálculo anterior respecto del que se abonara una Comisión de rentabilidad.

Metodología

En cada Período de cálculo, se devenga una Comisión de rentabilidad respecto de cada Clase PF en circulación en el caso de que el Valor liquidativo de la Acción al final del Período de cálculo supere la Cota máxima de esa Clase PF concreta.

La Comisión de rentabilidad se calculará en cada Día de negociación y ascenderá al 15% del importe en que el aumento porcentual del Valor liquidativo de la Acción en el Período de cálculo supere al crecimiento porcentual de la Cota máxima. La Comisión de rentabilidad se devengará en cada Día de negociación y formará parte del Valor liquidativo de la Acción de cada Clase PF cuando proceda. Cualquier devengo de una Comisión de rentabilidad en un Día de negociación será reemplazado por cualquier devengo que tenga lugar el siguiente Día de negociación, y así sucesivamente hasta el último Día de negociación del Período de cálculo.

El Valor liquidativo de la Acción utilizado en el cálculo de la Comisión de rentabilidad no incluye en ningún caso ajustes por *swing pricing*.

No se abonará Comisión de rentabilidad alguna hasta que el Valor liquidativo de la Acción supere la Cota máxima y dicha comisión se abonará únicamente sobre la diferencia positiva de rentabilidad entre el Valor liquidativo de la Acción y la Cota máxima, tal y como se ha descrito anteriormente.

Se informa a los Accionistas de que, dado que la Comisión de rentabilidad se calcula para la Clase y no para cada Accionista individual, podrían estar sujetos a dicha comisión incluso cuando el Valor liquidativo de sus acciones no registre variaciones o descienda, por ejemplo, cuando los Accionistas compren o reembolsen Acciones en momentos distintos del inicio y el final del Período de cálculo.

La Comisión de rentabilidad se tendrá en cuenta en el Patrimonio neto en cada Día de negociación y normalmente se abonará a la Gestora en el plazo de 30 Días hábiles una vez finalizado el Período de cálculo. No obstante, si las Acciones se reembolsasen durante un Período de cálculo, la Comisión de rentabilidad devengada en relación con las mismas se abonará a la Gestora en el plazo de 30 Días hábiles a partir de la fecha de reembolso.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO (CONT.)

Comisiones de rentabilidad (cont.)

Comisión de rentabilidad abonada a la Gestora y al Gestor delegado de Inversiones (cont.)

US Long Short Equity (cont.)

Metodología (cont.)

Las Comisiones de rentabilidad cristalizadas se mantendrán en la Clase PF pertinente (pero no participarán en las posteriores ganancias y pérdidas de dicha Clase) hasta que se abonen a la Gestora, y no se utilizarán ni estarán disponibles para atender los reembolsos o el pago de cualesquiera comisiones y gastos de la Clase PF pertinente.

El Depositario verificará el cálculo de la Comisión de rentabilidad.

El Consejo de administración podrá reducir la Comisión de rentabilidad pagadera por cada Clase PF con el consentimiento de la Gestora. Las comisiones de rentabilidad se pagan sobre las plusvalías tanto materializadas como latentes, lo que, a fin de evitar cualquier duda, incluye los ingresos de las inversiones, teniendo en cuenta las minusvalías materializadas y latentes al cierre del Período de cálculo. En consecuencia, las comisiones de rentabilidad podrán abonarse sobre las plusvalías latentes que podrían no llegar a materializarse.

En el período finalizado el viernes, 30 de junio de 2024, la Gestora percibió una comisión de rentabilidad de 138.911 USD (30 de junio de 2023: cero).

Global High Yield SDG Engagement

La Gestora puede tener derecho a percibir una comisión de rentabilidad pagadera con cargo a los activos de la Cartera en relación con cada Clase PF de la Cartera.

Definiciones

Índice de referencia	ICE BofA Global High Yield Constrained Index en la moneda de la clase correspondiente (que se indica a continuación)
Período de cálculo	El Período de cálculo comprenderá por lo general del 1 de enero al 31 de diciembre de cada año, con las siguientes excepciones: - cuando se produzca la emisión inicial de Acciones en cada Clase PF, el primer Período de cálculo irá desde la fecha de emisión hasta el 31 de diciembre; - cuando una Clase PF se extinga, el Período de cálculo terminará en la fecha en que se produzca tal extinción; y - si el Contrato de gestión se resuelve en cualquier año, el Período de cálculo terminará en la fecha en que se produzca esa resolución. El primer valor utilizado para determinar la primera Comisión de rentabilidad de una Clase PF será el Precio de oferta inicial.
Cristalización	Momento en el que es pagadera una Comisión de rentabilidad a la Gestora. La Cristalización se producirá, bien al final del Período de cálculo o bien en un Día de negociación en el que un Accionista reembolse o convierta total o parcialmente su Participación en Acciones.
Diferencia positiva de rentabilidad	La diferencia positiva entre el crecimiento del Valor liquidativo de la Acción y la rentabilidad del Índice de referencia durante el Período de cálculo.

Metodología

En cada Período de cálculo, se devenga una Comisión de rentabilidad respecto de cada Clase PF en circulación con relación a cualquier Diferencia positiva de rentabilidad, es decir, la diferencia entre el crecimiento del Valor liquidativo de la Acción y la rentabilidad del Índice de referencia aplicable a esa Clase PF concreta durante el Período de cálculo. La Comisión de rentabilidad se calculará cada Día de negociación y ascenderá al 20% de la Diferencia positiva de rentabilidad aplicable a esa Clase PF concreta durante el mismo período.

El Valor liquidativo de la Acción utilizado en el cálculo de la Comisión de rentabilidad no incluye en ningún caso ajustes por *swing pricing*.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO (CONT.)

Comisiones de rentabilidad (cont.)

Comisión de rentabilidad abonada a la Gestora y al Gestor delegado de Inversiones (cont.)

Global High Yield SDG Engagement (cont.)

Metodología (cont.)

En caso de que la rentabilidad de una Clase PF durante un Período de cálculo fuese inferior a la rentabilidad del Índice de referencia, no se abonará ninguna Comisión de rentabilidad en relación con dicha Clase PF hasta que se haya recuperado la rentabilidad inferior acumulada con respecto a la rentabilidad del Índice de referencia.

Si la Clase PF ha logrado una Diferencia positiva de rentabilidad en un Período de cálculo, deberá abonarse una Comisión de rentabilidad con respecto a esa Clase PF. Una vez realizado el pago, el Índice de referencia se reiniciará, lo que garantiza que el Valor liquidativo de la Acción y el Índice partan del mismo punto al inicio del Período de cálculo. Por lo tanto, el valor inicial del Índice de referencia para el siguiente Período de cálculo será igual al Valor liquidativo por acción de la Clase PF para la que se abonó una Comisión de rentabilidad, de tal forma que, por ejemplo, si el Valor liquidativo por acción era 110, el valor inicial del Índice de referencia sería también 110.

Índices de referencia

Clases	Índice	Código
Clases PF USD	ICE BofA Global High Yield Constrained Index	HW0C seleccionar moneda USD
Clases PF EUR con cobertura	ICE BofA Global High Yield Constrained Index – EUR Hedged	HW0C seleccionar moneda EUR
Clases PF GBP con cobertura	ICE BofA Global High Yield Constrained Index – GBP Hedged	HW0C seleccionar moneda GBP

Se informa a los Accionistas de que, dado que la Comisión de rentabilidad se abona sobre la rentabilidad superior con respecto al Índice de referencia, podrían tener que hacer frente a dicha comisión cuando el Valor liquidativo de sus acciones haya disminuido, pero en menor medida que el Índice.

Se informa a los Accionistas de que, dado que la Comisión de rentabilidad se calcula para la Clase y no para cada Accionista individual, podrían estar sujetos a dicha comisión incluso cuando el Valor liquidativo de sus acciones no registre variaciones o descienda, por ejemplo, cuando los Accionistas compren o reembolsen Acciones en momentos distintos del inicio y el final del Período de cálculo.

La Comisión de rentabilidad se tendrá en cuenta en el Patrimonio neto en cada Día de negociación y normalmente se abonará a la Gestora en el plazo de 30 Días hábiles una vez finalizado el Período de cálculo. No obstante, si las Acciones se reembolsasen durante un Período de cálculo, la Comisión de rentabilidad devengada en relación con las mismas se abonará a la Gestora en el plazo de 30 Días hábiles a partir de la fecha de reembolso.

Las Comisiones de rentabilidad cristalizadas se mantendrán en la Clase PF pertinente (pero no participarán en las posteriores ganancias y pérdidas de dicha Clase) hasta que se abonen a la Gestora, y no se utilizarán ni estarán disponibles para atender los reembolsos o el pago de cualesquiera comisiones y gastos de la Clase PF pertinente.

El Depositario verificará el cálculo de la Comisión de rentabilidad.

El Consejo de administración podrá reducir la Comisión de rentabilidad pagadera por cada Clase PF con el consentimiento de la Gestora. Las comisiones de rentabilidad se pagan sobre las plusvalías tanto materializadas como latentes, lo que, a fin de evitar cualquier duda, incluye los ingresos de las inversiones, teniendo en cuenta las minusvalías materializadas y latentes al cierre del Período de cálculo. En consecuencia, las comisiones de rentabilidad podrán abonarse sobre las plusvalías latentes que podrían no llegar a materializarse.

La Cartera no abonó ninguna comisión de rentabilidad a la Gestora correspondiente a los períodos finalizados el 30 de junio de 2024 y el 30 de junio de 2023.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO (CONT.)

Comisiones de rentabilidad (cont.)

Comisión de rentabilidad abonada a la Gestora y al Gestor delegado de Inversiones (cont.)

Event Driven

La Gestora puede tener derecho a percibir una comisión de rentabilidad pagadera con cargo a los activos de la Cartera en relación con cada Clase PF de la Cartera. Todas las clases de la Cartera son Clases PF.

Definiciones

Período de cálculo	El Período de cálculo comprenderá por lo general del 1 de enero al 31 de diciembre de cada año, con las siguientes excepciones: • cuando se produzca la emisión inicial de Acciones en cada Clase PF, el primer Período de cálculo irá desde la fecha de emisión hasta el 31 de diciembre; • cuando una Clase PF se extinga, el Período de cálculo terminará en la fecha en que se produzca tal extinción; y • si el Contrato de gestión se resuelve en cualquier año, el Período de cálculo terminará en la fecha en que se produzca esa resolución. El primer valor utilizado para determinar la primera Comisión de rentabilidad de una Clase PF será el Precio de oferta inicial.
Cristalización	Momento en el que es pagadera una Comisión de rentabilidad a la Gestora. La Cristalización se producirá bien al final del Período de cálculo o bien un Día de negociación en el que un Accionista reembolse o canjee total o parcialmente su Participación en Acciones.
Cota máxima	El que resulte mayor entre: (i) el precio de oferta inicial por Acción; y (ii) el Valor liquidativo de la Acción al final de cualquier Período de cálculo anterior respecto del que se abonara una Comisión de rentabilidad.

Metodología

Para cada Período de cálculo, se devenga una Comisión de rentabilidad respecto de cada Clase PF en circulación en el caso de que el Valor liquidativo por Acción al final de dicho Periodo supere la Cota máxima (una vez descontados todos los costes y antes de deducirse cualquier Comisión de rentabilidad devengada, siempre que redunde en interés del Accionista) respecto de esa Clase PF en particular.

La Comisión de rentabilidad se calculará en cada Día de negociación y será igual al 20% del importe en que el aumento porcentual del Valor liquidativo por Acción en el Período de cálculo supere al crecimiento porcentual de la Cota máxima, a excepción de las Clases I5, en cuyo caso la Comisión de rentabilidad será igual al 15% del importe en que el aumento porcentual del Valor liquidativo por Acción en el Período de cálculo supere al crecimiento porcentual de la Cota máxima.

La Comisión de rentabilidad se devengará en cada Día de negociación y formará parte del Valor liquidativo por Acción de cada Clase PF cuando proceda. Cualquier devengo de una Comisión de rentabilidad en un Día de negociación será reemplazado por cualquier devengo que tenga lugar el siguiente Día de negociación, y así sucesivamente hasta el último Día de negociación del Período de cálculo.

El Valor liquidativo por Acción utilizado en el cálculo de la Comisión de rentabilidad no incluye en ningún caso ajustes por *swing pricing*.

No se abonará Comisión de rentabilidad alguna hasta que el Valor liquidativo por Acción supere la Cota máxima y dicha comisión se abonará solo sobre la diferencia positiva de rentabilidad entre el Valor liquidativo por Acción y la Cota máxima, según lo descrito anteriormente.

Para el semestre finalizado el 30 de junio de 2024

5. Comisiones de Gestión, Administración, Distribución y Depósito (cont.)

Comisiones de rentabilidad (cont.)

Comisión de rentabilidad abonada a la Gestora y al Gestor delegado de Inversiones (cont.)

Event Driven (cont.)

Metodología (cont.)

Se informa a los Accionistas de que, dado que la Comisión de rentabilidad se calcula para la Clase y no para cada Accionista individual, podrían estar sujetos a dicha comisión incluso cuando el Valor liquidativo de sus Acciones no registre variaciones o incluso descienda, por ejemplo, cuando los Accionistas compren o reembolsen Acciones en momentos distintos del inicio y el final del Periodo de cálculo.

La comisión de rentabilidad se tendrá en cuenta en el Patrimonio neto en cada Día de negociación y normalmente se abonará al Gestor en el plazo de 30 Días hábiles una vez finalizado el Periodo de cálculo. No obstante, si las Acciones se reembolsasen durante un Periodo de cálculo, la Comisión de rentabilidad devengada en relación con las mismas se abonará a la Gestora en el plazo de 30 Días hábiles a partir de la fecha de reembolso.

Las Comisiones de rentabilidad cristalizadas se mantendrán en la Clase PF pertinente (pero no participarán en las posteriores ganancias y pérdidas de dicha Clase) hasta que se abonen a la Gestora, y no se utilizarán ni estarán disponibles para atender los reembolsos o el pago de cualesquiera comisiones y gastos de la Clase PF pertinente.

El Depositario verificará el cálculo de la Comisión de rentabilidad y se asegurará de que no esté abierta a la posibilidad de manipulación.

El Consejo de administración podrá reducir la Comisión de rentabilidad pagadera por cada Clase PF con el consentimiento de la Gestora. Las comisiones de rentabilidad se pagan sobre las plusvalías tanto materializadas como latentes, lo que, a fin de evitar cualquier duda, incluye los ingresos de las inversiones, teniendo en cuenta las minusvalías materializadas y latentes al cierre del Periodo de cálculo. En consecuencia, las comisiones de rentabilidad podrán abonarse sobre las plusvalías latentes que podrían no llegar a materializarse.

En el período finalizado el viernes, 30 de junio de 2024, la Gestora percibió una comisión de rentabilidad de 990.102 USD (30 de junio de 2023: 211.938 USD).

Tactical Macro

El Gestor delegado de inversiones puede tener derecho a percibir una comisión de rentabilidad pagadera con cargo a los activos de la Cartera en relación con cada Clase PF de la Cartera. Todas las clases de la Cartera son Clases PF.

Definiciones

Periodo de cálculo	El Periodo de cálculo comprenderá por lo general del 1 de enero al 31 de diciembre de cada año, con las siguientes excepciones: • cuando se produzca la emisión inicial de Acciones de cada Clase, el primer Periodo de cálculo irá desde la fecha de emisión hasta el 31 de diciembre del año siguiente; • cuando una Clase se extinga, el Periodo de cálculo terminará en la fecha en que se produzca esa extinción; y • en caso de rescisión del Gestor delegado de inversiones, el Periodo de cálculo terminará en la fecha en que se produzca esa rescisión.
Cristalización	Momento en el que es pagadera una Comisión de rentabilidad al Gestor delegado de inversiones. La Cristalización se producirá (i) al final del Periodo de cálculo; (ii) a la rescisión del nombramiento del Gestor delegado de inversiones; o (iii) un Día de negociación en el que un Accionista reembolse o canjee la totalidad o parte de su Participación en Acciones.
Diferencia positiva de rentabilidad	La diferencia positiva entre el crecimiento del Valor liquidativo por Acción y la rentabilidad del Índice de referencia durante el Periodo de cálculo.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO (CONT.)

Comisiones de rentabilidad (cont.)

Comisión de rentabilidad abonada a la Gestora y al Gestor delegado de Inversiones (cont.)

Tactical Macro (cont.)

Índices de referencia

Clases	Índice
Clases USD	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD)
Clases EUR con cobertura	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - EUR Hedged)
Clases GBP con cobertura	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - GBP Hedged)
Clases CHF con cobertura	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - CHF Hedged)
Clases JPY con cobertura	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - JPY Hedged)

El Índice de referencia se utiliza con frecuencia para los tipos de interés a corto plazo y proporciona una indicación de los tipos medios a los que los bancos podrían obtener financiación mayorista y no garantizada durante periodos determinados en monedas concretas.

En el caso de las Clases denominadas en monedas distintas de las anteriormente expuestas, el Índice de referencia será el ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) cubierto en la moneda de la clase correspondiente, dado que representa un indicador más apropiado para los inversores en dichas Clases.

Metodología

En cada Período de cálculo, se devenga una Comisión de rentabilidad respecto de cada Clase en circulación por cualquier Diferencia positiva de rentabilidad, es decir, el exceso de rentabilidad del Valor liquidativo por Acción (una vez descontados todos los costes y sin descontar ninguna Comisión de rentabilidad acumulada, siempre que redunde en interés del Accionista) respecto de la rentabilidad del Índice de referencia aplicable a esa Clase en concreto en el Período de cálculo. La Comisión de rentabilidad se calculará cada Día de negociación y ascenderá hasta un máximo del 20% de la Diferencia positiva de rentabilidad aplicable a esa Clase concreta durante el mismo período.

En caso de que la rentabilidad de una Clase durante un Período de cálculo fuese inferior a la rentabilidad del Índice de referencia, no se abonará ninguna Comisión de rentabilidad en relación con dicha Clase hasta que se haya recuperado la rentabilidad inferior acumulada con respecto a la rentabilidad del Índice de referencia.

Si la Clase ha logrado una Diferencia positiva de rentabilidad en un Período de cálculo, deberá abonarse una Comisión de rentabilidad con respecto a esa Clase. Una vez realizado el pago, el Índice de referencia se reiniciará, lo que garantiza que el Valor liquidativo por Acción y el Índice partan del mismo punto al inicio del Período de cálculo. Por lo tanto, el valor inicial del Índice de referencia para el siguiente Período de cálculo será igual al Valor liquidativo por Acción de la Clase para la que se abonó la Comisión de rentabilidad, de tal forma que, por ejemplo, si el Valor liquidativo por Acción era de 110 al cierre del Período de cálculo en el que se abonó una Comisión de rentabilidad, el valor inicial del Índice de referencia al comienzo del siguiente Período de cálculo sería también de 110.

Se informa a los Accionistas de que, dado que la comisión de rentabilidad se abona sobre la rentabilidad superior con respecto al Índice de referencia, podrían tener que hacer frente a una comisión de rentabilidad cuando el Valor liquidativo de sus Acciones haya disminuido, aunque en menor medida que el Índice.

Se informa a los Accionistas de que, dado que la Comisión de rentabilidad se calcula para la Clase y no para cada Accionista individual, y que no se aplica una contabilidad de series al respecto, podrían estar sujetos a dicha comisión incluso cuando el Valor liquidativo de sus Acciones no registre variaciones o descenda, por ejemplo, cuando los Accionistas compren o reembolsen Acciones en momentos distintos del inicio y el final del Período de cálculo.

La comisión de rentabilidad se calculará y devengará diariamente en cada Punto de valoración. La Comisión de rentabilidad se calcula sobre el Valor liquidativo por Acción no ajustado por *swing pricing* (para más información sobre el mecanismo de «*swing pricing*», véase el apartado «Cálculo del Patrimonio neto y el Valor liquidativo - Ajustes de valoración y *swing pricing*» del Folleto).

La Comisión de rentabilidad normalmente se abonará al Gestor delegado de inversiones a período vencido en el plazo de 30 Días hábiles contados desde el 31 de diciembre de cada año. Sin embargo, si se produce la Cristalización de una Comisión de rentabilidad durante un Período de cálculo, la Comisión de rentabilidad devengada por esos importes se abonará en el plazo de 30 Días hábiles contados a partir del cierre del trimestre natural en el que se produjo la Cristalización.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO (CONT.)

Comisiones de rentabilidad (cont.)

Comisión de rentabilidad abonada a la Gestora y al Gestor delegado de Inversiones (cont.)

Tactical Macro (cont.)

Metodología (cont.)

Las Comisiones de rentabilidad cristalizadas se mantendrán en la Cartera hasta que se abonen al Gestor delegado de inversiones y no participarán de las ganancias y pérdidas posteriores de la Cartera. Las comisiones de rentabilidad cristalizadas no se emplearán ni estarán disponibles para satisfacer reembolsos o abonar comisiones y gastos de la Cartera o de la Sociedad (excepto el abono de las Comisiones de rentabilidad pagaderas al Gestor delegado de inversiones).

El Depositario verificará el cálculo de cualquier Comisión de rentabilidad y se asegurará de que no esté abierta a la posibilidad de manipulación.

Las comisiones de rentabilidad se pagan sobre las plusvalías tanto materializadas como latentes, lo que, a fin de evitar cualquier duda, incluye los ingresos de las inversiones, teniendo en cuenta las minusvalías materializadas y latentes al cierre del Período de cálculo. En consecuencia, las comisiones de rentabilidad podrán abonarse sobre las plusvalías latentes que podrían no llegar a materializarse.

La Cartera no abonó al Gestor delegado de inversiones ninguna comisión de rentabilidad correspondiente a los períodos finalizados el 30 de junio de 2024 y el 30 de junio de 2023.

Uncorrelated Strategies

El Gestor delegado de inversiones puede tener derecho a percibir una comisión de rentabilidad pagadera con cargo a los activos de la Cartera en relación con cada Clase PF de la Cartera. Todas las clases de la Cartera son Clases PF.

Definiciones

Período de cálculo	El Período de cálculo comprenderá por lo general del 1 de enero al 31 de diciembre de cada año, con las siguientes excepciones: • cuando se produzca la emisión inicial de Acciones de cada Clase, el primer Período de cálculo irá desde la fecha de emisión hasta el 31 de diciembre del año siguiente; • cuando una Clase se extinga, el Período de cálculo terminará en la fecha en que se produzca esa extinción; y • en caso de rescisión del Gestor delegado de inversiones, el Período de cálculo terminará en la fecha en que se produzca esa rescisión.
Cristalización	Momento en el que es pagadera una Comisión de rentabilidad al Gestor delegado de inversiones. La Cristalización se producirá (i) al final del Período de cálculo; (ii) a la rescisión del nombramiento del Gestor delegado de inversiones; o (iii) un Día de negociación en el que un Accionista reembolse o canjee la totalidad o parte de su Participación en Acciones.
Diferencia positiva de rentabilidad	La diferencia positiva entre el crecimiento del Valor liquidativo por Acción y la rentabilidad del Índice de referencia durante el Período de cálculo.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO (CONT.)

Comisiones de rentabilidad (cont.)

Comisión de rentabilidad abonada a la Gestora y al Gestor delegado de Inversiones (cont.)

Uncorrelated Strategies (cont.)

Índices de referencia

Clases	Índice
Clases USD	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD)
Clases EUR con cobertura	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - EUR Hedged)
Clases GBP con cobertura	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - GBP Hedged)
Clases CHF con cobertura	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - CHF Hedged)
Clases JPY con cobertura	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - JPY Hedged)

El Índice de referencia se utiliza con frecuencia para los tipos de interés a corto plazo y proporciona una indicación de los tipos medios a los que los bancos podrían obtener financiación mayorista y no garantizada durante periodos determinados en monedas concretas.

En el caso de las Clases denominadas en monedas distintas de las anteriormente expuestas, el Índice de referencia será el ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) cubierto en la moneda de la clase correspondiente.

Metodología

En cada Período de cálculo, se devenga una Comisión de rentabilidad respecto de cada Clase en circulación por cualquier Diferencia positiva de rentabilidad, es decir, el exceso de rentabilidad del Valor liquidativo por Acción (una vez descontados todos los costes y sin descontar ninguna Comisión de rentabilidad acumulada, siempre que redunde en interés del Accionista) respecto de la rentabilidad del Índice de referencia aplicable a esa Clase en concreto en el Período de cálculo. La Comisión de rentabilidad se calculará cada Día de negociación y ascenderá hasta un máximo del 20% de la Diferencia positiva de rentabilidad aplicable a esa Clase concreta durante el mismo período.

En caso de que la rentabilidad de una Clase durante un Período de cálculo fuese inferior a la rentabilidad del Índice de referencia, no se abonará ninguna Comisión de rentabilidad en relación con dicha Clase hasta que se haya recuperado la rentabilidad inferior acumulada con respecto a la rentabilidad del Índice de referencia.

Si la Clase ha logrado una Diferencia positiva de rentabilidad en un Período de cálculo, deberá abonarse una Comisión de rentabilidad con respecto a esa Clase. Una vez realizado el pago, el Índice de referencia se reiniciará, lo que garantiza que el Valor liquidativo por Acción y el Índice partan del mismo punto al inicio del Período de cálculo. Por lo tanto, el valor inicial del Índice de referencia para el siguiente Período de cálculo será igual al Valor liquidativo por Acción de la Clase para la que se abonó la Comisión de rentabilidad, de tal forma que, por ejemplo, si el Valor liquidativo por Acción era de 110 al cierre del Período de cálculo en el que se abonó una Comisión de rentabilidad, el valor inicial del Índice de referencia al comienzo del siguiente Período de cálculo sería también de 110.

Se informa a los Accionistas de que, dado que la comisión de rentabilidad se abona sobre la rentabilidad superior con respecto al Índice de referencia, podrían tener que hacer frente a una comisión de rentabilidad cuando el Valor liquidativo de sus Acciones haya disminuido, aunque en menor medida que el Índice.

Se informa a los Accionistas de que, dado que la Comisión de rentabilidad se calcula para la Clase y no para cada Accionista individual, podrían estar sujetos a dicha comisión incluso cuando el Valor liquidativo de sus Acciones no registre variaciones o incluso descienda, por ejemplo, cuando los Accionistas compren o reembolsen Acciones en momentos distintos del inicio y el final del Período de cálculo.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

5. COMISIONES DE GESTIÓN, ADMINISTRACIÓN, DISTRIBUCIÓN Y DEPÓSITO (CONT.)

Comisiones de rentabilidad (cont.)

Comisión de rentabilidad abonada a la Gestora y al Gestor delegado de Inversiones (cont.)

Uncorrelated Strategies (cont.)Metodología (cont.)

La comisión de rentabilidad se calculará y devengará diariamente en cada Punto de valoración. La Comisión de rentabilidad se calcula sobre el Valor liquidativo por Acción no ajustado por *swing pricing* (para más información sobre el mecanismo de «*swing pricing*», véase el apartado «Cálculo del Patrimonio neto y el Valor liquidativo - Ajustes de valoración y *swing pricing*» del Folleto).

La Comisión de rentabilidad normalmente se abonará al Gestor delegado de inversiones a período vencido en el plazo de 30 Días hábiles contados desde el 31 de diciembre de cada año. Sin embargo, si se produce la Cristalización de una Comisión de rentabilidad durante un Período de cálculo, la Comisión de rentabilidad devengada por esos importes se abonará en el plazo de 30 Días hábiles contados a partir del cierre del trimestre natural en el que se produjo la Cristalización.

Las Comisiones de rentabilidad cristalizadas se mantendrán en la Cartera hasta que se abonen al Gestor delegado de inversiones y no participarán de las ganancias y pérdidas posteriores de la Cartera. Las comisiones de rentabilidad cristalizadas no se emplearán ni estarán disponibles para satisfacer reembolsos o abonar comisiones y gastos de la Cartera o de la Sociedad (excepto el abono de las Comisiones de rentabilidad pagaderas al Gestor delegado de inversiones).

El Depositario verificará el cálculo de cualquier Comisión de rentabilidad y se asegurará de que no esté abierta a la posibilidad de manipulación.

Las comisiones de rentabilidad se pagan sobre las plusvalías tanto materializadas como latentes, lo que, a fin de evitar cualquier duda, incluye los ingresos de las inversiones, teniendo en cuenta las minusvalías materializadas y latentes al cierre del Período de cálculo. En consecuencia, las comisiones de rentabilidad podrán abonarse sobre las plusvalías latentes que podrían no llegar a materializarse.

La Cartera no abonó al Gestor delegado de inversiones ninguna comisión de rentabilidad correspondiente a los períodos finalizados el 30 de junio de 2024 y el 30 de junio de 2023.

Comisión del Depositario

La Sociedad abona al Depositario una comisión por los servicios de fiduciario prestados a cada Cartera, que no podrá ser superior al 0,02% anual del Patrimonio neto de la Cartera correspondiente y que se devenga mensualmente y se abona a mes vencido. El Depositario también puede solicitar a la Sociedad que le reembolse, con cargo a los activos de la Cartera, las comisiones de custodia, los gastos de operaciones y los gastos varios razonables («Comisiones de depósito») en que incurra en beneficio de la Cartera, incluidos los honorarios (que no podrán superar las tarifas comerciales normales) y los gastos varios razonables de cualquier subdepositario nombrado por el Depositario.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024**6. HONORARIOS Y GASTOS DE LOS CONSEJEROS**

Los Consejeros pueden cobrar honorarios como retribución por sus servicios, cuya cuantía fijará el Consejo de administración, si bien el importe de la retribución que se abone a cualquier Consejero en un mismo año por los servicios prestados a la Sociedad no podrá superar los 75.000 euros (u 85.000 euros en el caso de la presidencia de la Sociedad) u otro importe que determine oportunamente el Consejo de administración. Asimismo, los Consejeros y cualesquiera Consejeros suplentes tendrán derecho a que se les abonen los gastos de desplazamiento, alojamiento y de otro tipo en que incurran debidamente al asistir a juntas de Accionistas o reuniones del Consejo o a cualquier otra reunión relacionada con la actividad de la Sociedad. Todas las retenciones abonadas en relación con los Honorarios de los Consejeros se incluyen en los gastos totales. Ninguno de los Consejeros ha firmado un contrato de servicios con la Sociedad, ni tampoco se ha propuesto la firma de un contrato de ese tipo. Ninguno de los Consejeros tiene funciones ejecutivas en la Sociedad. Los Consejeros que también son empleados de Neuberger Berman Europe Limited no percibirán comisión alguna por sus servicios como consejeros de la Sociedad.

La retribución total del Consejo de administración (incluidos los gastos) correspondiente al semestre cerrado el 30 de junio de 2024 ascendió a 85.500 USD en total (30 de junio de 2023: 125.151 USD) de los que 18.163 USD estaban pendientes de pago al cierre del periodo (31 de diciembre de 2023: 19.272 USD).

A 30 de junio de 2024, Dña. Michelle Green y D. Alex Duncan eran Consejeros y empleados de Neuberger Berman Europe Limited («NBEL»), Gestor delegado de inversiones y Entidad comercializadora de la Sociedad. Dña. Gráinne Alexander es Consejera de Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited («NBAMIL»), la Gestora de la Sociedad. Dña. Michelle Green y D. Alex Duncan renunciaron voluntariamente a su derecho a cobrar honorarios en relación con sus funciones como Consejeros durante el semestre finalizado el 30 de junio de 2024 (30 de junio de 2023: igual).

Los honorarios de los Consejeros se reflejan sin descontar el impuesto sobre la renta. Estos no percibieron remuneraciones en especie durante el ejercicio.

7. OTRAS COMISIONES Y GASTOS

Los costes de transacción son los costes en que se incurre con motivo de la adquisición, la emisión o la enajenación de activos y pasivos financieros. Engloban las comisiones abonadas a intermediarios financieros, las tasas impuestas por agencias reguladoras y mercados de valores y los impuestos y tasas que gravan las transmisiones. Los costes de transacción no incluyen primas ni descuentos de deuda, costes de financiación ni costes administrativos o de tenencia de valores de carácter interno. Estos costes se contabilizan cuando se producen y se reconocen como gastos a efectos de la información financiera, en la Cuenta de pérdidas y ganancias.

La Sociedad y las Carteras abonan también otros costes, comisiones y gastos en los que incurren en el marco de sus operaciones. Estos pueden incluir, entre otros, comisiones y gastos bancarios o de corretaje en que se incurra en la compraventa de valores de las Carteras, impuestos, seguros, los costes y gastos de mantener sus libros contables y de elaborar, imprimir, publicar y distribuir (en los idiomas en que sea preciso) folletos, suplementos, informes anuales y semestrales y otra documentación o información a Accionistas actuales o potenciales (incluidos los costes de las técnicas de transmisión electrónica para distribuir dicha documentación o información), los gastos de publicar información sobre precios o rentabilidades en los medios de comunicación pertinentes, los costes y gastos de obtener autorizaciones o registros de la Sociedad o de cualquiera de las acciones ante autoridades reguladoras de diversas jurisdicciones, incluida cualquier tasa aplicada por el Banco Central de Irlanda, el coste de admisión a cotización y el mantenimiento de la cotización de acciones en cualquier bolsa de valores, gastos de marketing y promocionales, el coste de convocar y celebrar juntas de Accionistas y reuniones del Consejo de administración, los costes derivados de ejercer los derechos de voto vinculados a la inversión de la Sociedad atendiendo al interés de los Accionistas, y los honorarios profesionales y gastos de servicios jurídicos, de auditoría o consultoría, todos y cada uno de los gastos derivados de la liquidación o cierre de la Sociedad y cualesquiera otros costes y gastos (incluidos los costes y gastos extraordinarios o no recurrentes) que se puedan producir periódicamente y que hayan sido autorizados por el Consejo de administración por estimarlos necesarios o apropiados para la explotación continuada de la Sociedad o de cualquier Cartera.

En relación con el registro de la Sociedad o de las Acciones para su venta en determinadas jurisdicciones, la Sociedad abonará las comisiones y gastos de agentes de pago, agentes de información y o bancos corresponsales, en todos los casos a tarifas comerciales normales.

La Gestora pagará directamente todos los análisis que utiliza, con independencia de su procedencia. Los Gestores delegados de inversiones que se encuentran fuera de la UE, que no envían a esta región ninguno de los análisis que reciben, pueden cobrar los gastos de análisis con cargo a la correspondiente Cartera mediante la provisión de un presupuesto anual para análisis correspondiente a cada Cartera.

A efectos de la información financiera, los gastos de constitución se cargan en la Cuenta de pérdidas y ganancias a medida que se incurre en ellos. A los efectos del cálculo del Valor liquidativo de la Acción utilizado en las operaciones de los accionistas, los gastos de constitución se amortizan durante los dos primeros ejercicios de la vida de la Cartera.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS

En virtud de lo previsto en la norma FRS 102 «Related Party Transactions» (Transacciones con partes relacionadas), se entenderá que las partes están relacionadas si una de ellas tiene la capacidad de controlar a la otra o de ejercer una influencia significativa sobre la otra a la hora de tomar decisiones financieras u operativas.

Michelle Green y Alex Duncan son Consejeros de la Sociedad y también Consejeros y empleados de NBEL, el Gestor delegado de inversiones y Entidad comercializadora de la Sociedad. Dña. Gráinne Alexander es consejera de NBAMIL, la Gestora de la Sociedad. Las comisiones percibidas por NBEL y NBAMIL durante los semestre cerrados el 30 de junio de 2024 y el 30 de junio de 2023 se muestran en la tabla siguiente. Consúltase la Nota 6 para más información sobre los honorarios de los Consejeros abonados en los períodos finalizados a 30 de junio de 2024 y a 30 de junio de 2023.

Comisiones de gestión, administración y rentabilidad*	30 de junio de 2024	30 de junio de 2023
	USD	USD
Comisiones de gestión y administración percibidas por NBAMIL, sin incluir aquellas a cuyo cobro se había renunciado.	98.414.999	115.480.410
Comisión de asesoría	4.530.690	-
Comisión de asesoría y gastos a cuyo cobro se ha renunciado	(1.460.835)	(1.670.750)
Comisiones de gestión pendientes	16.073.547	15.860.154
Comisiones de rentabilidad a percibir por NBAMIL**	1.129.013	211.938

*En la Nota 5 se incluye más información sobre las Comisiones de gestión y rentabilidad.

**Las Comisiones de rentabilidad normalmente se abonarán al Gestor a período vencido en el plazo de 30 días hábiles contados desde el cierre de cada período de cálculo. En la sección Comisiones de rentabilidad de la Nota 5 se recogen más detalles.

A 30 de junio de 2024 y 31 de diciembre de 2023, las siguientes Carteras mantenían otras Carteras gestionadas por filiales de la Gestora:

Cartera	Posición*	Gestionada por	30 de junio de 2024		31 de diciembre de 2023	
			Acciones	Valor	Acciones	Valor
Corporate Hybrid Bond	Global Investment Grade Credit	NBAMIL	1.300.000	11.426.172	1.300.000	10.956.412
Emerging Market Debt - Hard Currency	Ultra Short Term Euro Bond	NBAMIL	-	-	150.000	17.580.000
Emerging Market Debt - Local Currency	China Bond	NBAMIL	559.000	5.847.140	1.595.000	16.173.300
Emerging Market Debt Blend	China Bond	NBAMIL	555.447	5.809.975	1.409.964	14.297.035
Global Flexible Credit Income	NB Global Monthly Income Fund Ltd**	NBAMIL	9.642	6.826	75.108	66.832
Global Opportunistic Bond	NB Global Monthly Income Fund Ltd**	NBAMIL	3.054	2.162	23.786	21.165
High Yield Bond	NB Global Monthly Income Fund Ltd**	NBAMIL	520.942	368.773	4.058.488	3.611.285
Short Duration Emerging Market Debt	Ultra Short Term Euro Bond	NBAMIL	-	-	425.000	49.810.000
Short Duration High Yield SDG Engagement	NB Global Monthly Income Fund Ltd**	NBAMIL	34.770	24.613	270.876	241.028
Strategic Income	China Bond	NBAMIL	579.894	5.706.156	1.208.113	11.936.155
Strategic Income	Euro Bond Absolute Return	NBAMIL	760.691	9.546.677	760.691	9.158.724
Strategic Income	European High Yield Bond	NBAMIL	486.855	6.679.649	486.855	6.382.668
Strategic Income	Global Flexible Credit Income	NBAMIL	459.982	5.786.568	459.982	5.570.377
Strategic Income	Global High Yield SDG Engagement	NBAMIL	654.438	9.279.934	654.438	8.952.716
Strategic Income	Global Investment Grade Credit	NBAMIL	2.000.000	18.840.000	2.000.000	18.620.000
Strategic Income	NB Global Monthly Income Fund Ltd**	NBAMIL	21.035	14.891	163.871	145.814
Ultra Short Term Euro Bond	Euro Bond	NBAMIL	293.000	2.924.140	-	-
Ultra Short Term Euro Bond	Euro Bond Absolute Return	NBAMIL	1.117.000	11.259.360	-	-

*A 30 de junio de 2024 (31 de diciembre de 2023, según proceda), la comisión de gestión efectiva tras aplicar los descuentos en cada una de las anteriores posiciones de cada Cartera era del 0,00%.

** La comisión de gestión de NB Global Monthly Income Fund Ltd es del 0,75%.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024**8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)**

La Gestora ofreció un descuento a las anteriores Carteras en relación con su inversión, por lo que su comisión de gestión efectiva sobre las inversiones era del 0,00% (31 de diciembre de 2023: igual). El importe del descuento ofrecido a cada Cartera se recoge en el apartado «Descuento de la comisión de asesoría» de la Cuenta de pérdidas y ganancias.

A 30 de junio de 2024 y 31 de diciembre de 2023, las inversiones cruzadas entre Carteras de la Sociedad estaban excluidas de las cuentas conjuntas de la Sociedad.

Personas vinculadas

Con arreglo al apartado 48(1) del Reglamento sobre OICVM del Banco Central, toda transacción llevada a cabo con la Sociedad por el Gestor de inversiones, el Depositario, el Asesor de inversiones o sociedades asociadas o del mismo grupo que estas entidades ("personas vinculadas") debe realizarse en condiciones de mercado. Asimismo, dichas operaciones deben redundar en el interés de los accionistas de la Sociedad.

El Consejo de administración de la Sociedad determina que (i) hay acuerdos vigentes (cuya existencia queda demostrada mediante procedimientos escritos) que garantizan que las obligaciones antes señaladas se aplican a todas las operaciones con partes vinculadas; y que (ii) las operaciones con partes vinculadas que se hayan celebrado durante el período cumplen dichas obligaciones.

El Consejo de Administración no tiene conocimiento de la existencia de transacciones con partes relacionadas durante el período finalizado el 30 de junio de 2024 (31 de diciembre de 2023: igual), exceptuando las que constan en estas cuentas.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

A 30 de junio de 2024 y 31 de diciembre de 2023, los siguientes accionistas habían efectuado las inversiones que se indican a continuación en la Sociedad y se consideraban, por tanto, partes relacionadas.

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2024 Número de Acciones	31 de diciembre de 2023 Número de Acciones
5G Connectivity	Clase de acumulación I2 AUD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	4.665	-
5G Connectivity	Clase de acumulación I2 AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	4.665
5G Connectivity	Clase de acumulación A CHF	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.627	2.627
5G Connectivity	Clase de acumulación I CHF	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.627	2.627
5G Connectivity	Clase de acumulación I2 CHF	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.675	-
5G Connectivity	Clase de acumulación I2 CHF	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.675
5G Connectivity	Clase de acumulación I2 CNY	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.181	-
5G Connectivity	Clase de acumulación I2 CNY	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.181
5G Connectivity	Clase de acumulación I2 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.791	-
5G Connectivity	Clase de acumulación I2 EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.791
5G Connectivity	Clase de acumulación I5 EUR	Empleado de Neuberger Berman	1.965	1.965
5G Connectivity	Clase de acumulación sin cobertura I GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.326	2.326
5G Connectivity	Clase de acumulación I2 GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.400	-
5G Connectivity	Clase de acumulación I2 GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.400
5G Connectivity	Clase de acumulación I2 HKD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	23.473	-
5G Connectivity	Clase de acumulación I2 HKD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	23.473
5G Connectivity	Clase de acumulación I2 SGD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.039	-
5G Connectivity	Clase de acumulación I2 SGD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.039
5G Connectivity	Clase de acumulación I3 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
5G Connectivity	Clase de acumulación I5 USD	Empleado de Neuberger Berman	9.953	9.953
5G Connectivity	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	106.374	108.423

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2024 Número de Acciones	31 de diciembre de 2023 Número de Acciones
China A-Share Equity	Clase de acumulación I CNY	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	688
China A-Share Equity	Clase de acumulación I CNY	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	688	-
China A-Share Equity	Clase de acumulación I CNY	Empleado de Neuberger Berman	774	774
China A-Share Equity	Clase de acumulación sin cobertura I USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	1.000
China A-Share Equity	Clase de acumulación sin cobertura I USD	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	1.000	-
China A-Share Equity	Clase de acumulación sin cobertura I USD	Empleado de Neuberger Berman	1.934	1.934
China A-Share Equity	Clase de reparto sin cobertura I USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	250.091
China A-Share Equity	Clase de reparto sin cobertura I USD	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	250.091	-
China Bond	Clase de reparto (mensual) A CNY	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.993	1.993
China Bond	Clase de reparto I CNY	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.347	2.347
China Bond	Clase de acumulación Z CNY	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	614	-
China Bond	Clase de acumulación Z CNY	Empleado de Neuberger Berman	1.218	1.218
China Bond	Clase de acumulación Z CNY	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	614
China Bond	Clase de acumulación I2 GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.176	2.176
China Bond	Clase de acumulación sin cobertura I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.003
China Bond	Clase de acumulación Z USD	Emerging Market Debt - Local Currency	559.000	1.595.000
China Bond	Clase de acumulación Z USD	Emerging Market Debt Blend	555.447	1.409.964
China Bond	Clase de acumulación Z USD	Multi-Asset Income	-	-
China Bond	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	40.000	40.000
China Bond	Clase de acumulación sin cobertura Z USD	Empleado de Neuberger Berman	196	196
China Bond	Clase de acumulación sin cobertura Z USD	Strategic Income	579.894	1.208.113
China Equity	Clase de acumulación Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	891	891
China Equity	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	16.177	16.177
Climate Innovation	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2024 Número de Acciones	31 de diciembre de 2023 Número de Acciones
Climate Innovation	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Climate Innovation	Clase de acumulación I5 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Climate Innovation	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	300.000	-
Climate Innovation	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	300.000
CLO Income	Clase de acumulación A EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.824	2.824
CLO Income	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.144	3.144
CLO Income	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	52.392	51.167
Commodities	Clase de acumulación sin cobertura I GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	806
Commodities	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	-	1.431
Commodities	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	14.960	15.263
Corporate Hybrid Bond	Clase de reparto (mensual) A AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.390
Corporate Hybrid Bond	Clase de acumulación I3 CHF	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.690	-
Corporate Hybrid Bond	Clase de acumulación I EUR	Empleado de Neuberger Berman	15.690	15.690
Corporate Hybrid Bond	Clase de acumulación I GBP	Empleado de Neuberger Berman	973	973
Corporate Hybrid Bond	Clase de reparto A USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.000	3.000
Corporate Hybrid Bond	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	3.000
Corporate Hybrid Bond	Clase de reparto I2 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.128	-
Corporate Hybrid Bond	Clase de reparto I2 USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.128
Corporate Hybrid Bond	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	33.729	33.729
Emerging Market Debt - Hard Currency	Clase de acumulación I2 CHF	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.911
Emerging Market Debt - Hard Currency	Clase de acumulación P CHF	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.118
Emerging Market Debt - Hard Currency	Clase de acumulación I4 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.644	2.644
Emerging Market Debt - Hard Currency	Clase de acumulación Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	66.439	59.506
Emerging Market Debt - Hard Currency	Clase de reparto A USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	1.000

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2024 Número de Acciones	31 de diciembre de 2023 Número de Acciones
Emerging Market Debt - Hard Currency	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	7.290	9.752
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación B AUD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	824	-
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación B AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	824
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación C2 AUD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	925
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación E AUD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.494	-
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación E AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.494
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación T AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.472
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación I EUR	Empleado de Neuberger Berman	14.328	14.328
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación I GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.011	-
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación I GBP	Empleado de Neuberger Berman	25.991	25.991
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación I GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.011
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación A SEK	Empleado de Neuberger Berman	11.535	11.535
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación B USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación B USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.000
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación E USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación E USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.000
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de reparto (mensual) I USD	Bond-Plus Income & Growth Multi-Asset Class Securities Investment Trust	3.411.529	4.340.412
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de reparto (mensual) I USD	Global Strategic Income	192.560	192.560
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación I5 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.579	-
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación I5 USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.579
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación T USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	950
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación C2 ZAR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	1.596
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación E ZAR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	855	-

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2024 Número de Acciones	31 de diciembre de 2023 Número de Acciones
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación E ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	855
Emerging Market Debt - Local Currency	Clase de acumulación T ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.683
Emerging Market Debt Blend	Clase de reparto I3 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.000	-
Emerging Market Debt Blend	Clase de reparto I3 EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	3.000
Emerging Market Debt Blend	Clase de acumulación Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	18.544	13.085
Emerging Market Debt Blend	Clase de reparto sin cobertura I GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	746	-
Emerging Market Debt Blend	Clase de reparto sin cobertura I GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	746
Emerging Market Debt Blend	Clase de acumulación sin cobertura P GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	772	772
Emerging Market Debt Blend	Clase de acumulación Z GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.876	-
Emerging Market Debt Blend	Clase de acumulación U NOK	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.286	2.286
Emerging Market Debt Blend	Clase de reparto (mensual) A SGD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	699
Emerging Market Debt Blend	Clase de reparto (mensual) A USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.025
Emerging Market Debt Blend	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	9	-
Emerging Market Debt Blend	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	9
Emerging Market Debt Blend	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	8.827	9.460
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Clase de acumulación I NOK	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	808	-
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Clase de acumulación I NOK	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	808
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Clase de acumulación I3 NOK	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.219	-
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Clase de acumulación I3 NOK	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	3.219
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	325	-
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	81	81
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	155.674
Emerging Markets Equity	Clase de acumulación B AUD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.356	-
Emerging Markets Equity	Clase de acumulación B AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.356

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2024 Número de Acciones	31 de diciembre de 2023 Número de Acciones
Emerging Markets Equity	Clase de acumulación C2 AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.575
Emerging Markets Equity	Clase de acumulación E AUD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.356	-
Emerging Markets Equity	Clase de acumulación E AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.356
Emerging Markets Equity	Clase de acumulación T AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.662
Emerging Markets Equity	Clase de reparto sin cobertura I CAD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	8.283	8.283
Emerging Markets Equity	Clase de acumulación M EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	901	-
Emerging Markets Equity	Clase de acumulación M EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	901
Emerging Markets Equity	Clase de acumulación Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	22.279	22.279
Emerging Markets Equity	Clase de acumulación Z GBP	Empleado de Neuberger Berman	-	800
Emerging Markets Equity	Clase de acumulación C2 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	967
Emerging Markets Equity	Clase de acumulación T USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	670
Emerging Markets Equity	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	19.050	22.606
Emerging Markets Equity	Clase de acumulación B ZAR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.410	-
Emerging Markets Equity	Clase de acumulación B ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.410
Emerging Markets Equity	Clase de acumulación E ZAR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.410	-
Emerging Markets Equity	Clase de acumulación E ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.410
Emerging Markets Equity	Clase de acumulación T ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.765
Euro Bond	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	3.000
Euro Bond	Clase de reparto I EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	978.926	-
Euro Bond	Clase de reparto I EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	978.926
Euro Bond	Clase de acumulación Z EUR	Ultra Short Term Euro Bond	293.000	-
Euro Bond Absolute Return	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	28.155	-
Euro Bond Absolute Return	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	28.155
Euro Bond Absolute Return	Clase de reparto I EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	930	930

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2024 Número de Acciones	31 de diciembre de 2023 Número de Acciones
Euro Bond Absolute Return	Clase de acumulación Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	2.000	-
Euro Bond Absolute Return	Clase de acumulación Z EUR	Ultra Short Term Euro Bond	1.117.000	-
Euro Bond Absolute Return	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	247.390
Euro Bond Absolute Return	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	247.390	-
Euro Bond Absolute Return	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.146.064	-
Euro Bond Absolute Return	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.146.064
Euro Bond Absolute Return	Clase de acumulación Z USD	Strategic Income	760.691	760.691
European High Yield Bond	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.947
European High Yield Bond	Clase de acumulación X EUR	Empleado de Neuberger Berman	13.224	13.224
European High Yield Bond	Clase de acumulación X USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.639	-
European High Yield Bond	Clase de acumulación X USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	3.639
European High Yield Bond	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	7.885	386
European High Yield Bond	Clase de acumulación Z USD	Strategic Income	486.855	486.855
European Sustainable Equity	Clase de reparto A EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.627	2.627
European Sustainable Equity	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	825
European Sustainable Equity	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	825	-
European Sustainable Equity	Clase de reparto I EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.027	1.027
European Sustainable Equity	Clase de reparto I3 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.593	2.593
European Sustainable Equity	Clase de acumulación M EUR	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	1.649
European Sustainable Equity	Clase de acumulación M EUR	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	1.649	-
European Sustainable Equity	Clase de acumulación Z EUR	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	408.530
European Sustainable Equity	Clase de acumulación Z EUR	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	408.530	-
European Sustainable Equity	Clase de acumulación Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	28.495	31.579
European Sustainable Equity	Clase de acumulación Z EUR	Neuberger Berman Group LLC	4.772.441	4.772.441

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2024 Número de Acciones	31 de diciembre de 2023 Número de Acciones
European Sustainable Equity	Clase de acumulación sin cobertura A USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
European Sustainable Equity	Clase de acumulación sin cobertura I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
European Sustainable Equity	Clase de acumulación sin cobertura M USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Event Driven	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	922	-
Event Driven	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	922
Event Driven	Clase de reparto I5 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.761	-
Event Driven	Clase de reparto I5 GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.584
Event Driven	Clase de acumulación P GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.584	2.584
Event Driven	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Global Bond	Clase de reparto (mensual) T AUD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.937	3.937
Global Bond	Clase de acumulación I EUR - Índice con Cobertura	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.766	2.766
Global Bond	Clase de acumulación I USD - Índice con Cobertura	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.000	3.000
Global Bond	Clase de acumulación I USD - Índice con Cobertura	Empleado de Neuberger Berman	2.405	-
Global Bond	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	888
Global Bond	Clase de reparto (mensual) T USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.000	3.000
Global Bond	Clase de reparto (mensual) T ZAR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	4.481	4.481
Global Equity Megatrends	Clase de acumulación sin cobertura I4 GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.361	-
Global Equity Megatrends	Clase de reparto sin cobertura I4 GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	789	-
Global Equity Megatrends	Clase de acumulación sin cobertura P GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	786	786
Global Equity Megatrends	Clase de acumulación A SGD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.010	-
Global Equity Megatrends	Clase de acumulación A SGD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.010
Global Equity Megatrends	Clase de acumulación I USD	Empleado de Neuberger Berman	14.434	12.401
Global Equity Megatrends	Clase de acumulación I4 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.000	-
Global Equity Megatrends	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2024 Número de Acciones	31 de diciembre de 2023 Número de Acciones
Global Flexible Credit Income	Clase de acumulación M EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.359	2.359
Global Flexible Credit Income	Clase de reparto mensual A USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.000	-
Global Flexible Credit Income	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	7.763
Global Flexible Credit Income	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	7.763	-
Global Flexible Credit Income	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	46.495	32.935
Global Flexible Credit Income	Clase de acumulación Z USD	Strategic Income	459.982	459.982
Global High Yield SDG Engagement	Clase de reparto I AUD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	4.223	-
Global High Yield SDG Engagement	Clase de reparto I AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	4.223
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación I4 AUD	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	4.589	-
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación I4 CHF	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.931	-
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación I4 CHF	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.931
Global High Yield SDG Engagement	Clase de reparto I4 CHF	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.931	-
Global High Yield SDG Engagement	Clase de reparto I4 CHF	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.931
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación X CHF	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.931	-
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación X CHF	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.931
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación I4 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.846	-
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación I4 EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.846
Global High Yield SDG Engagement	Clase de reparto I4 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.846	-
Global High Yield SDG Engagement	Clase de reparto I4 EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.846
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación X EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.846	-
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación X EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.846
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación Z (PF) EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.539	-
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación Z (PF) EUR	Empleado de Neuberger Berman	13.678	13.678
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación Z (PF) EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.539

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2024 Número de Acciones	31 de diciembre de 2023 Número de Acciones
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación I4 GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.398	-
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación I4 GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.398
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación X GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.398	-
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación X GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.398
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.796
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	816	-
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	816
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación I4 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación I4 USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.000
Global High Yield SDG Engagement	Clase de reparto M USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.208	-
Global High Yield SDG Engagement	Clase de reparto M USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.208
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación X USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.013	1.000
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación X USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.013
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	789	-
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	-	2.226
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	789
Global High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación Z USD	Strategic Income	654.438	654.438
Global Investment Grade Credit	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.730	2.730
Global Investment Grade Credit	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Global Investment Grade Credit	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.000
Global Investment Grade Credit	Clase de acumulación X USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Global Investment Grade Credit	Clase de acumulación X USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.000
Global Investment Grade Credit	Clase de acumulación Z USD	Corporate Hybrid Bond	1.300.000	1.300.000
Global Investment Grade Credit	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.498.000	-

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2024 Número de Acciones	31 de diciembre de 2023 Número de Acciones
Global Investment Grade Credit	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	535	535
Global Investment Grade Credit	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.498.000
Global Investment Grade Credit	Clase de acumulación Z USD	Strategic Income	2.000.000	2.000.000
Global Opportunistic Bond	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.530	-
Global Opportunistic Bond	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.530
Global Opportunistic Bond	Clase de acumulación P GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.295	2.295
Global Opportunistic Bond	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.175	-
Global Opportunistic Bond	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.175
Global Opportunistic Bond	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Group LLC	669	669
Global Opportunistic Bond	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.083	-
Global Opportunistic Bond	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.083
Global Real Estate Securities	Clase de acumulación M EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.000
Global Real Estate Securities	Clase de acumulación sin cobertura Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	18.144	18.144
Global Real Estate Securities	Clase de acumulación Z GBP	Empleado de Neuberger Berman	500	500
Global Real Estate Securities	Clase de reparto I5 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.315	3.315
Global Real Estate Securities	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	9.811	9.811
Global Sustainable Equity	Clase de acumulación sin cobertura M EUR	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	1.649
Global Sustainable Equity	Clase de acumulación sin cobertura M EUR	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	1.649	-
Global Sustainable Equity	Clase de acumulación sin cobertura Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	120.430	120.430
Global Sustainable Equity	Clase de acumulación sin cobertura I5 GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	722	722
Global Sustainable Equity	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	1.000
Global Sustainable Equity	Clase de acumulación I USD	Empleado de Neuberger Berman	-	9.518
Global Sustainable Equity	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.131	1.131
Global Sustainable Equity	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	528.063

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2024 Número de Acciones	31 de diciembre de 2023 Número de Acciones
Global Sustainable Equity	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	528.063	-
Global Sustainable Equity	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Global Sustainable Equity	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	-	160
Global Sustainable Equity	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Group LLC	2.481.151	2.481.151
Global Sustainable Value	Clase de acumulación sin cobertura I5 GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	927	927
Global Sustainable Value	Clase de acumulación sin cobertura P GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	823	-
Global Sustainable Value	Clase de acumulación sin cobertura P GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	823
Global Sustainable Value	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	3.166	3.166
High Yield Bond	Clase de reparto (semanal) T AUD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.675	-
High Yield Bond	Clase de reparto (semanal) T AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.675
High Yield Bond	Clase de acumulación Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	16.506	15.211
High Yield Bond	Clase de acumulación Z GBP	Empleado de Neuberger Berman	2.729	2.729
High Yield Bond	Clase de reparto (mensual) I USD	Bond-Plus Income & Growth Multi-Asset Class Securities Investment Trust	3.040.762	3.907.647
High Yield Bond	Clase de reparto (mensual) I USD	Global Strategic Income	124.531	259.531
High Yield Bond	Clase de acumulación P USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.208	-
High Yield Bond	Clase de acumulación P USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.208
High Yield Bond	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	5.615	7.741
High Yield Bond	Clase de acumulación T ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.308
InnovAsia 5G	Clase de acumulación I4 CHF	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.747	-
InnovAsia 5G	Clase de acumulación I4 CHF	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.747
InnovAsia 5G	Clase de acumulación A EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.539	-
InnovAsia 5G	Clase de acumulación A EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.539
InnovAsia 5G	Clase de acumulación I4 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.539	-

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2024 Número de Acciones	31 de diciembre de 2023 Número de Acciones
InnovAsia 5G	Clase de acumulación I4 EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.539
InnovAsia 5G	Clase de acumulación sin cobertura M EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.584	2.584
InnovAsia 5G	Clase de acumulación X EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.539	-
InnovAsia 5G	Clase de acumulación X EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.539
InnovAsia 5G	Clase de acumulación A SGD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.031	-
InnovAsia 5G	Clase de acumulación A SGD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.031
InnovAsia 5G	Clase de acumulación I4 SGD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.031	-
InnovAsia 5G	Clase de acumulación I4 SGD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.031
InnovAsia 5G	Clase de acumulación X SGD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.031	-
InnovAsia 5G	Clase de acumulación X SGD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.031
InnovAsia 5G	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.000
InnovAsia 5G	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	268.823	-
InnovAsia 5G	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	476.000
InnovAsia 5G	Clase de acumulación I4 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
InnovAsia 5G	Clase de acumulación I4 USD	Empleado de Neuberger Berman	2.037	2.037
InnovAsia 5G	Clase de acumulación I4 USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.000
InnovAsia 5G	Clase de acumulación M USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
InnovAsia 5G	Clase de acumulación X USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
InnovAsia 5G	Clase de acumulación X USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.000
Japan Equity Engagement	Clase de reparto I5 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.662	-
Japan Equity Engagement	Clase de reparto I5 EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.662
Japan Equity Engagement	Clase de acumulación sin cobertura I5 GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	787	787
Japan Equity Engagement	Clase de acumulación sin cobertura P GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.242
Japan Equity Engagement	Clase de acumulación A JPY	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	4.678	-

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2024 Número de Acciones	31 de diciembre de 2023 Número de Acciones
Japan Equity Engagement	Clase de acumulación I JPY	Empleado de Neuberger Berman	3.576	3.576
Japan Equity Engagement	Clase de acumulación Z JPY	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	778.814
Japan Equity Engagement	Clase de acumulación Z JPY	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	778.814	-
Japan Equity Engagement	Clase de acumulación Z JPY	Empleado de Neuberger Berman	141.708	147.815
Japan Equity Engagement	Clase de acumulación Z JPY	Neuberger Berman Group LLC	2.005.146	2.005.146
Japan Equity Engagement	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.000	-
Japan Equity Engagement	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.000	-
Macro Opportunities FX	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	1.000
Macro Opportunities FX	Clase de acumulación Z GBP	Empleado de Neuberger Berman	-	2.005
Macro Opportunities FX	Clase de acumulación I SEK	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.830
Macro Opportunities FX	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	1.081
Macro Opportunities FX	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	-	7.959
Next Generation Mobility	Clase de acumulación A EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Next Generation Mobility	Clase de acumulación A EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.000
Next Generation Mobility	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.459	2.459
Next Generation Mobility	Clase de acumulación C1 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	10	10
Next Generation Mobility	Clase de acumulación I USD	Empleado de Neuberger Berman	638	738
Next Generation Mobility	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	730
Next Generation Mobility	Clase de acumulación X USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	3.000
Next Generation Mobility	Clase de acumulación X USD	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	3.000	-
Next Generation Mobility	Clase de acumulación X USD	Empleado de Neuberger Berman	588	588
Next Generation Space Economy	Clase de acumulación sin cobertura I3 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	94.928	-
Next Generation Space Economy	Clase de acumulación sin cobertura I3 EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	94.928
Next Generation Space Economy	Clase de acumulación sin cobertura M EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	94.928	-

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2024 Número de Acciones	31 de diciembre de 2023 Número de Acciones
Next Generation Space Economy	Clase de acumulación sin cobertura M EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	94.928
Next Generation Space Economy	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	300.000	-
Next Generation Space Economy	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	300.000
Responsible Asian Debt – Hard Currency	Clase de reparto (mensual) A USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.046	-
Responsible Asian Debt – Hard Currency	Clase de reparto (mensual) A USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.046
Responsible Asian Debt – Hard Currency	Clase de reparto (mensual) I4 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Responsible Asian Debt – Hard Currency	Clase de acumulación I4 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Responsible Asian Debt – Hard Currency	Clase de reparto (mensual) X USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Responsible Asian Debt – Hard Currency	Clase de acumulación X USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.193	2.193
Responsible Asian Debt – Hard Currency	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	3.887.269
Responsible Asian Debt – Hard Currency	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	3.887.269	-
Responsible Asian Debt – Hard Currency	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.004.281	-
Responsible Asian Debt – Hard Currency	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.004.281
Responsible Asian Debt – Hard Currency	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Group LLC	848.201	848.201
Short Duration Emerging Market Debt	Clase de reparto (mensual) A CAD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.365	-
Short Duration Emerging Market Debt	Clase de reparto (mensual) A CAD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.365
Short Duration Emerging Market Debt	Clase de acumulación A SEK	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.374	-
Short Duration Emerging Market Debt	Clase de acumulación A SEK	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.374
Short Duration Emerging Market Debt	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	57.298	31.591
Short Duration High Yield SDG Engagement	Clase de reparto (mensual) A HKD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	23.546	23.546
Short Duration High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación I4 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Short Duration High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	7.984
Short Duration High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	12.032	2.654
Short Duration High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	20.946	876

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2024 Número de Acciones	31 de diciembre de 2023 Número de Acciones
Short Duration High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	40.446	40.341
Short Duration High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	3.422
Short Duration High Yield SDG Engagement	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Group LLC	6.528	5.823
Strategic Income	Clase de reparto (mensual) A CNY	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.137
Strategic Income	Clase de acumulación A EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.861	2.861
Strategic Income	Clase de acumulación I EUR	Empleado de Neuberger Berman	83.400	83.400
Strategic Income	Clase de reparto (mensual) A HKD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	11.473
Strategic Income	Clase de reparto mensual A JPY	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	4.505	-
Strategic Income	Clase de reparto I JPY	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	5.300	5.300
Strategic Income	Clase de acumulación A SGD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	682
Strategic Income	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	69.556	20.836
Sustainable Asia High Yield	Clase de reparto (mensual) A USD	Neuberger Berman Group LLC	1.000	1.000
Sustainable Asia High Yield	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Group LLC	1.000	1.000
Sustainable Asia High Yield	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.225	1.225
Sustainable Asia High Yield	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	9.794	11.395
Sustainable Asia High Yield	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Group LLC	2.395.262	2.395.262
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	Clase de acumulación I GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	787	-
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	Clase de acumulación I GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	787
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	Clase de acumulación A SEK	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.409	-
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	Clase de acumulación A SEK	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.409
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Tactical Macro	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Tactical Macro	Clase de acumulación I5 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Tactical Macro	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	500.000	-

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2024 Número de Acciones	31 de diciembre de 2023 Número de Acciones
Tactical Macro	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	500.000
Ultra Short Term Euro Bond	Clase de acumulación U CHF	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	294
Ultra Short Term Euro Bond	Clase de reparto I EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	119
Ultra Short Term Euro Bond	Clase de acumulación M EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	252
Ultra Short Term Euro Bond	Clase de acumulación U EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	79
Ultra Short Term Euro Bond	Clase de acumulación Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	15.831	19.030
Ultra Short Term Euro Bond	Clase de acumulación Z USD	Emerging Market Debt - Hard Currency	-	150.000
Ultra Short Term Euro Bond	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	250	-
Ultra Short Term Euro Bond	Clase de acumulación Z USD	Short Duration Emerging Market Debt	-	425.000
Uncorrelated Strategies	Clase de acumulación P EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.931	2.931
Uncorrelated Strategies	Clase de reparto I2 GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	858	858
Uncorrelated Strategies	Clase de acumulación Z GBP	Empleado de Neuberger Berman	21.992	21.992
Uncorrelated Strategies	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	20.480	24.926
US Equity	Clase de acumulación I5 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.799	-
US Equity	Clase de acumulación sin cobertura I5 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	933	-
US Equity	Clase de reparto sin cobertura I5 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	933	-
US Equity	Clase de acumulación sin cobertura X EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	921	-
US Equity	Clase de acumulación sin cobertura X EUR	Empleado de Neuberger Berman	9.259	-
US Equity	Clase de reparto sin cobertura I5 GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	788	-
US Equity	Clase de acumulación sin cobertura X GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	786	-
US Equity	Clase de acumulación I USD	Empleado de Neuberger Berman	415	415
US Equity	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Group LLC	229.104	229.104
US Equity	Clase de reparto I5 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.000	-
US Equity	Clase de acumulación M USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	1.000

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2024 Número de Acciones	31 de diciembre de 2023 Número de Acciones
US Equity	Clase de acumulación X USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
US Equity Index PutWrite	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.132	-
US Equity Index PutWrite	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.132
US Equity Index PutWrite	Clase de reparto I3 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.655
US Equity Index PutWrite	Clase de acumulación I4 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.111	-
US Equity Index PutWrite	Clase de acumulación I4 EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.111
US Equity Index PutWrite	Clase de reparto I4 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.748	-
US Equity Index PutWrite	Clase de reparto I4 EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.748
US Equity Index PutWrite	Clase de acumulación M EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.143
US Equity Index PutWrite	Clase de reparto sin cobertura I3 GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	785	-
US Equity Index PutWrite	Clase de reparto sin cobertura I3 GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	785
US Equity Index PutWrite	Clase de reparto (mensual) A SGD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	809
US Equity Index PutWrite	Clase de reparto (mensual) I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	890	-
US Equity Index PutWrite	Clase de reparto (mensual) I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	890
US Equity Index PutWrite	Clase de reparto I3 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	1.000
US Equity Index PutWrite	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	104.648	102.917
US Large Cap Value	Clase de acumulación A EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.066	3.066
US Large Cap Value	Clase de acumulación sin cobertura A EUR	Neuberger Berman Group LLC	947	947
US Large Cap Value	Clase de acumulación I GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.528	2.528
US Large Cap Value	Clase de acumulación sin cobertura I GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	843	843
US Large Cap Value	Clase de reparto I GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.528	2.528
US Large Cap Value	Clase de reparto sin cobertura I GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	843	843
US Large Cap Value	Clase de acumulación sin cobertura P GBP	Neuberger Berman Group LLC	-	797
US Large Cap Value	Clase de reparto P GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.678	2.678

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2024 Número de Acciones	31 de diciembre de 2023 Número de Acciones
US Large Cap Value	Clase de reparto sin cobertura Y GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	858	858
US Large Cap Value	Clase de acumulación Y USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
US Large Cap Value	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	20.291	20.291
US Long Short Equity	Clase de acumulación sin cobertura I3 EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	933	-
US Long Short Equity	Clase de reparto I3 GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.302	2.302
US Long Short Equity	Clase de acumulación I3 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	1.000
US Long Short Equity	Clase de acumulación M USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.115
US Long Short Equity	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	13.313	13.313
US Multi Cap Opportunities	Clase de acumulación T AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	516
US Multi Cap Opportunities	Clase de reparto I3 GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.367	-
US Multi Cap Opportunities	Clase de reparto sin cobertura I3 GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.065	-
US Multi Cap Opportunities	Clase de reparto sin cobertura I3 GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.065
US Multi Cap Opportunities	Clase de acumulación I2 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
US Multi Cap Opportunities	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	12.011	12.011
US Multi Cap Opportunities	Clase de acumulación I USD1	Bond-Plus Income & Growth Multi-Asset Class Securities Investment Trust	117.855	-
US Multi Cap Opportunities	Clase de reparto I USD1	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	268	-
US Multi Cap Opportunities	Clase de reparto I USD1	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	268
US Real Estate Securities	Clase de reparto (mensual) B AUD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.418	-
US Real Estate Securities	Clase de reparto (mensual) B AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.418
US Real Estate Securities	Clase de reparto (mensual) E AUD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.586	-
US Real Estate Securities	Clase de reparto (mensual) E AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.586
US Real Estate Securities	Clase de reparto (mensual) T AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.424
US Real Estate Securities	Clase de acumulación T AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.140

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2024 Número de Acciones	31 de diciembre de 2023 Número de Acciones
US Real Estate Securities	Clase de reparto (mensual) I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	943	943
US Real Estate Securities	Clase de reparto (mensual) T USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	985
US Real Estate Securities	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	13.787	15.120
US Real Estate Securities	Clase de acumulación C2 ZAR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	1.776
US Real Estate Securities	Clase de reparto (mensual) E ZAR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.790	-
US Real Estate Securities	Clase de reparto (mensual) E ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.790
US Real Estate Securities	Clase de reparto (mensual) T ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.208
US Small Cap	Clase de acumulación B AUD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	727	-
US Small Cap	Clase de acumulación B AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	727
US Small Cap	Clase de acumulación C2 AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.010
US Small Cap	Clase de acumulación E AUD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	756	-
US Small Cap	Clase de acumulación E AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	756
US Small Cap	Clase de acumulación T AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.329
US Small Cap	Clase de acumulación sin cobertura A EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.531	2.531
US Small Cap	Clase de acumulación Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	25.051	19.268
US Small Cap	Clase de acumulación C2 USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	153
US Small Cap	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	7.631	8.635
US Small Cap	Clase de acumulación E ZAR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	745	-
US Small Cap	Clase de acumulación E ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	745
US Small Cap	Clase de acumulación T ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.812
US Small Cap Intrinsic Value	Clase de acumulación I USD	Empleado de Neuberger Berman	958	958

¹ Cartera lanzada durante el ejercicio contable anterior.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO
5G Connectivity

Período finalizado el	Clase de acumulación A AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación A AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación E AUD* Valor liquidativo	Clase de acumulación E AUD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 AUD* Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 AUD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	26.606.532 AUD	13,75 AUD	474.755 AUD	11,37 AUD	67.769 AUD	14,53 AUD
31 de diciembre de 2023	20.787.257 AUD	10,77 AUD	—	—	52.808 AUD	11,32 AUD

Período finalizado el	Clase de acumulación A CHF* Valor liquidativo	Clase de acumulación A CHF* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I CHF* Valor liquidativo	Clase de acumulación I CHF* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 CHF* Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 CHF* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	35.208 CHF	13,40 CHF	35.482 CHF	13,51 CHF	67.470 CHF	14,43 CHF
31 de diciembre de 2023	27.888 CHF	10,62 CHF	27.986 CHF	10,65 CHF	30.421 CHF	11,37 CHF

Período finalizado el	Clase de acumulación A CNY Valor liquidativo	Clase de acumulación A CNY Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 CNY* Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 CNY* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	2.888.769 CNY	97,60 CNY	317.172 CNY	145,43 CNY	49.825.908 EUR	14,32 EUR
31 de diciembre de 2023	2.264.556 CNY	76,51 CNY	247.376 CNY	113,42 CNY	44.215.951 EUR	11,22 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación sin cobertura A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	82.431.487 EUR	16,57 EUR	54.730.658 EUR	13,47 EUR	56.469.701 EUR	16,19 EUR
31 de diciembre de 2023	54.229.594 EUR	12,48 EUR	40.203.669 EUR	10,50 EUR	44.112.500 EUR	12,14 EUR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

5G Connectivity (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación I2 EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I5 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura M EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	40.563 EUR	14,53 EUR	24.022 EUR	12,23 EUR	62.536.206 EUR	16,01 EUR
31 de diciembre de 2023	31.606 EUR	11,32 EUR	18.694 EUR	9,51 EUR	58.300.824 EUR	12,11 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación A GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación A GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 GBP* Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 GBP* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	10.456.384 GBP	14,87 GBP	399.708 GBP	13,41 GBP	35.244 GBP	14,69 GBP
31 de diciembre de 2023	9.193.764 GBP	11,57 GBP	295.419 GBP	10,28 GBP	27.290 GBP	11,37 GBP

Período finalizado el	Clase de acumulación A HKD Valor liquidativo	Clase de acumulación A HKD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 HKD* Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 HKD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A SGD Valor liquidativo	Clase de acumulación A SGD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	120.757.990 HKD	15,44 HKD	647.329 HKD	14,68 HKD	43.185.564 SGD	29,96 SGD
31 de diciembre de 2023	49.137.389 HKD	12,04 HKD	267.255 HKD	11,39 HKD	41.638.661 SGD	23,47 SGD

Período finalizado el	Clase de acumulación I2 SGD* Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 SGD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación E USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación E USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	59.291 SGD	29,07 SGD	457.751.032 USD	16,24 USD	5.898.594 USD	15,28 USD
31 de diciembre de 2023	46.226 SGD	22,67 SGD	439.282.138 USD	12,60 USD	708.213 USD	11,92 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
5G Connectivity (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I USD Valor liquidativo	Clase de reparto I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	117.300.051 USD	17,66 USD	21.109.394 USD	17,65 USD	979.045 USD	11,31 USD
31 de diciembre de 2023	126.685.506 USD	13,65 USD	21.016.657 USD	13,65 USD	852.918 USD	8,74 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I3 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I3 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I5 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	114.541.536 USD	12,04 USD	19.628.005 USD	16,47 USD	24.563.612 USD	14,15 USD
31 de diciembre de 2023	83.057.543 USD	9,30 USD	15.006.722 USD	12,70 USD	25.425.604 USD	11,02 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A ZAR* Valor liquidativo	Clase de acumulación A ZAR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación E ZAR* Valor liquidativo	Clase de acumulación E ZAR* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.213.202 USD	11,41 USD	10.657.036 ZAR	164,15 ZAR	27.228.031 ZAR	164,05 ZAR
31 de diciembre de 2023	951.757 USD	8,78 USD	3.680.438 ZAR	125,63 ZAR	2.072.410 ZAR	126,25 ZAR

China A-Share Equity

Período finalizado el	Clase de acumulación I CNY Valor liquidativo	Clase de acumulación I CNY Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto sin cobertura I USD Valor liquidativo	Clase de reparto sin cobertura I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	119.178 CNY	81,55 CNY	22.960 USD	7,83 USD	1.939.559 USD	7,76 USD
31 de diciembre de 2023	117.417 CNY	80,34 CNY	23.194 USD	7,90 USD	1.974.225 USD	7,89 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

China Bond

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) A CNY Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A CNY Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I CNY Valor liquidativo	Clase de reparto I CNY Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z CNY Valor liquidativo	Clase de acumulación Z CNY Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	152.262 CNY	76,41 CNY	214.017 CNY	91,19 CNY	223.150 CNY	121,83 CNY
31 de diciembre de 2023	152.534 CNY	76,55 CNY	212.640 CNY	90,61 CNY	218.817 CNY	119,47 CNY

Período finalizado el	Clase de acumulación I2 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto sin cobertura (mensual) A SGD Valor liquidativo	Clase de reparto sin cobertura (mensual) A SGD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	21.285 GBP	9,78 GBP	733.085 SGD	13,72 SGD	1.044.124 USD	10,17 USD
31 de diciembre de 2023	20.687 GBP	9,51 GBP	704.160 SGD	13,71 SGD	3.072.338 USD	10,27 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	18.608.664 USD	10,46 USD	5.705.837 USD	9,84 USD
31 de diciembre de 2023	48.865.775 USD	10,14 USD	11.943.662 USD	9,88 USD

China Equity

Período finalizado el	Clase de acumulación I CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación I CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	171.249 CHF	9,46 CHF	870.559 EUR	16,94 EUR	900.227 EUR	18,59 EUR
31 de diciembre de 2023	164.919 CHF	9,11 CHF	874.281 EUR	16,18 EUR	886.658 EUR	17,69 EUR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
China Equity (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación Z EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación Z EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto A GBP* Valor liquidativo	Clase de reparto A GBP* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A SGD Valor liquidativo	Clase de acumulación A SGD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	13.014 EUR	14,60 EUR	–	–	1.457.626 SGD	23,97 SGD
31 de diciembre de 2023	12.316 EUR	13,82 EUR	10.372 GBP	8,15 GBP	1.478.317 SGD	22,90 SGD

Período finalizado el	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto A USD Valor liquidativo	Clase de reparto A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	15.324.071 USD	20,94 USD	623.232 USD	12,84 USD	87.593.873 USD	23,07 USD
31 de diciembre de 2023	16.602.580 USD	19,81 USD	589.764 USD	12,15 USD	120.715.813 USD	21,74 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación U USD Valor liquidativo	Clase de acumulación U USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	19.120.842 USD	14,30 USD	15.509 USD	11,97 USD	14.320.370 USD	14,72 USD
31 de diciembre de 2023	21.040.703 USD	13,47 USD	15.431 USD	11,38 USD	15.726.473 USD	13,90 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	255.523 USD	15,80 USD
31 de diciembre de 2023	239.524 USD	14,81 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Climate Innovation¹

Período finalizado el	Clase de acumulación A USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I5 USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	10.427 USD	10,43 USD	10.508 USD	10,51 USD	10.550 USD	10,55 USD
31 de diciembre de 2023	9.662 USD	9,66 USD	9.696 USD	9,70 USD	9.713 USD	9,71 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación Z USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	3.176.933 USD	10,59 USD
31 de diciembre de 2023	2.919.017 USD	9,73 USD

CLO Income

Período finalizado el	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I2 EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I2 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	149.273 EUR	12,46 EUR	49.851.799 EUR	13,34 EUR	13.508.478 EUR	8,93 EUR
31 de diciembre de 2023	32.309 EUR	11,44 EUR	31.596.103 EUR	12,20 EUR	10.206.824 EUR	8,52 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación X EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación X EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación Z GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I SEK Valor liquidativo	Clase de acumulación I SEK Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	25.784.791 EUR	10,40 EUR	69.506 GBP	14,32 GBP	31.236.132 SEK	135,77 SEK
31 de diciembre de 2023	—	—	63.534 GBP	13,09 GBP	30.311.516 SEK	124,19 SEK

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
CLO Income (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I USD* Valor liquidativo	Clase de reparto I USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	2.961.772 USD	13,03 USD	169.549.913 USD	15,01 USD	9.135.382 USD	10,93 USD
31 de diciembre de 2023	42.064 USD	11,87 USD	58.957.866 USD	13,62 USD	2.616.887 USD	10,42 USD

Período finalizado el	Clase de reparto I2 USD Valor liquidativo	Clase de reparto I2 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I4 USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 USD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I5 USD Valor liquidativo	Clase de reparto I5 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	63.670.979 USD	10,49 USD	41.244.515 USD	10,31 USD	55.640.634 USD	9,99 USD
31 de diciembre de 2023	42.131.223 USD	9,99 USD	—	—	31.820.798 USD	9,51 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	819.510 USD	15,64 USD
31 de diciembre de 2023	723.771 USD	14,15 USD

Commodities

Período finalizado el	Clase de acumulación sin cobertura I GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I5 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	46.978.004 GBP	9,84 GBP	39.314.311 GBP	9,27 GBP	862.943 USD	9,52 USD
31 de diciembre de 2023	42.161.474 GBP	9,20 GBP	30.032.518 GBP	8,74 GBP	1.138.135 USD	9,00 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Commodities (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I5 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.741.574 USD	11,11 USD	50.447.005 USD	9,74 USD	839.423 USD	8,66 USD
31 de diciembre de 2023	1.744.147 USD	10,47 USD	55.640.585 USD	9,17 USD	379.973 USD	8,21 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	2.309.570 USD	11,33 USD
31 de diciembre de 2023	2.438.888 USD	10,65 USD

Corporate Hybrid Bond

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) A AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto A CHF* Valor liquidativo	Clase de reparto A CHF* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I3 CHF* Valor liquidativo	Clase de acumulación I3 CHF* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	6.498.924 AUD	8,06 AUD	3.511.786 CHF	10,08 CHF	26.898 CHF	10,00 CHF
31 de diciembre de 2023	5.093.356 AUD	8,02 AUD	—	—	—	—

Período finalizado el	Clase de acumulación P CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación P CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto P CHF Valor liquidativo	Clase de reparto P CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A EUR Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	4.993.729 CHF	10,51 CHF	25.598.881 CHF	9,05 CHF	61.159.127 EUR	8,16 EUR
31 de diciembre de 2023	4.766.253 CHF	10,24 CHF	1.630.621 CHF	9,00 CHF	39.329.425 EUR	8,09 EUR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Corporate Hybrid Bond (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	183.773.137 EUR	11,54 EUR	715.772.162 EUR	12,43 EUR	191.105.472 EUR	9,55 EUR
31 de diciembre de 2023	150.158.972 EUR	11,14 EUR	861.799.950 EUR	11,96 EUR	160.639.032 EUR	9,38 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación I2 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I2 EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I2 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I3 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I3 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	373.683.386 EUR	11,48 EUR	53.785.272 EUR	8,70 EUR	74.380.096 EUR	11,61 EUR
31 de diciembre de 2023	258.577.307 EUR	11,04 EUR	54.536.069 EUR	8,55 EUR	4.512.654 EUR	11,16 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación I5 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto M EUR Valor liquidativo	Clase de reparto M EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	115.344.843 EUR	12,76 EUR	12.078.664 EUR	12,01 EUR	4.518.506 EUR	7,86 EUR
31 de diciembre de 2023	112.450.285 EUR	12,26 EUR	11.102.489 EUR	11,62 EUR	3.338.833 EUR	7,80 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación P EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación P EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto P EUR Valor liquidativo	Clase de reparto P EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	8.615.562 EUR	11,07 EUR	18.764.650 EUR	9,58 EUR	2.934.248 GBP	12,12 GBP
31 de diciembre de 2023	8.972.769 EUR	10,65 EUR	19.262.572 EUR	9,41 EUR	2.291.998 GBP	11,58 GBP

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Corporate Hybrid Bond (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación I2 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I2 GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I2 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación P GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación P GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.592.908 GBP	11,96 GBP	24.666 GBP	9,88 GBP	1.115.551 GBP	10,90 GBP
31 de diciembre de 2023	1.749.168 GBP	11,42 GBP	24.129 GBP	9,64 GBP	1.523.093 GBP	10,42 GBP

Período finalizado el	Clase de reparto P GBP Valor liquidativo	Clase de reparto P GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A SGD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A SGD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	7.276.132 GBP	9,55 GBP	1.825.436 SGD	16,51 SGD	51.477.066 USD	8,55 USD
31 de diciembre de 2023	6.890.614 GBP	9,32 GBP	1.755.818 SGD	16,40 SGD	49.232.073 USD	8,49 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto A USD Valor liquidativo	Clase de reparto A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	52.355.314 USD	12,81 USD	72.990 USD	9,23 USD	2.727.697 USD	10,91 USD
31 de diciembre de 2023	49.383.201 USD	12,27 USD	71.151 USD	8,99 USD	3.418.540 USD	10,50 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I USD Valor liquidativo	Clase de reparto I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	55.109.437 USD	14,28 USD	1.378.864 USD	9,24 USD	7.024.568 USD	13,35 USD
31 de diciembre de 2023	47.532.250 USD	13,63 USD	980.224 USD	9,01 USD	5.936.845 USD	12,74 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Corporate Hybrid Bond (cont.)

Período finalizado el	Clase de reparto I2 USD Valor liquidativo	Clase de reparto I2 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto M USD Valor liquidativo	Clase de reparto M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	9.733.026 USD	10,58 USD	9.871.747 USD	11,20 USD	2.064.790 USD	8,74 USD
31 de diciembre de 2023	5.151.520 USD	10,31 USD	7.409.176 USD	10,76 USD	2.046.883 USD	8,60 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación P USD Valor liquidativo	Clase de acumulación P USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	7.362.589 USD	12,72 USD	465.980 USD	13,82 USD
31 de diciembre de 2023	7.705.875 USD	12,14 USD	443.619 USD	13,15 USD

Developed Market FMP – 2027¹

Período finalizado el	Clase de acumulación A EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I EUR* Valor liquidativo	Clase de reparto I EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	704.201 EUR	10,37 EUR	304.274 EUR	10,24 EUR	69.578.808 USD	10,53 USD
31 de diciembre de 2023	699.973 EUR	10,31 EUR	308.247 EUR	10,38 EUR	69.482.815 USD	10,38 USD

Período finalizado el	Clase de reparto A USD* Valor liquidativo	Clase de reparto A USD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I USD* Valor liquidativo	Clase de reparto I USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	26.644.518 USD	10,29 USD	992.779 USD	10,56 USD	2.165.580 USD	10,40 USD
31 de diciembre de 2023	27.217.946 USD	10,38 USD	977.254 USD	10,40 USD	2.182.151 USD	10,48 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Developed Market FMP – 2027¹ (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación X USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación X USD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto X USD* Valor liquidativo	Clase de reparto X USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	36.254.835 USD	10,55 USD	–	–
31 de diciembre de 2023	35.874.119 USD	10,39 USD	873.350 USD	10,39 USD

Emerging Market Debt – Hard Currency

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) A AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I AUD Valor liquidativo	Clase de reparto I AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I3 CAD Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I3 CAD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	545.772 AUD	7,07 AUD	72.807 AUD	8,50 AUD	57.657.982 CAD	13,41 CAD
31 de diciembre de 2023	1.943.558 AUD	7,08 AUD	23.198.262 AUD	8,31 AUD	52.703.579 CAD	12,26 CAD

Período finalizado el	Clase de acumulación I2 CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación P CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación P CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A EUR Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	89.223.582 CHF	8,73 CHF	16.672.506 CHF	8,78 CHF	6.442.679 EUR	6,33 EUR
31 de diciembre de 2023	134.304.949 CHF	8,45 CHF	25.327.791 CHF	8,51 CHF	7.633.978 EUR	6,33 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	51.243.381 EUR	10,96 EUR	113.942.924 EUR	11,97 EUR	18.125.220 EUR	10,54 EUR
31 de diciembre de 2023	51.163.108 EUR	10,53 EUR	89.529.420 EUR	11,46 EUR	17.230.269 EUR	9,70 EUR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Emerging Market Debt – Hard Currency (cont.)

Período finalizado el	Clase de reparto I EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I2 EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I2 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	178.871.761 EUR	7,00 EUR	28.996.792 EUR	9,16 EUR	37.457.155 EUR	7,51 EUR
31 de diciembre de 2023	175.147.404 EUR	6,86 EUR	45.795.061 EUR	8,77 EUR	36.308.806 EUR	7,36 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación I3 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I3 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I4 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I5 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I5 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	74.394.091 EUR	10,29 EUR	49.379.520 EUR	11,64 EUR	71.121.430 EUR	12,01 EUR
31 de diciembre de 2023	68.995.700 EUR	9,84 EUR	44.153.327 EUR	11,13 EUR	89.770.039 EUR	11,04 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto M EUR Valor liquidativo	Clase de reparto M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación P EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación P EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	521.451 EUR	10,16 EUR	106.852 EUR	6,42 EUR	11.273.822 EUR	9,28 EUR
31 de diciembre de 2023	525.911 EUR	9,81 EUR	138.890 EUR	6,36 EUR	10.477.004 EUR	8,88 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación Z EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación Z EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	645.236 EUR	9,71 EUR	12.560.746 GBP	11,34 GBP	1.132.220 GBP	7,62 GBP
31 de diciembre de 2023	551.473 EUR	9,27 EUR	14.312.566 GBP	10,78 GBP	1.045.922 GBP	7,41 GBP

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Emerging Market Debt – Hard Currency (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación I2 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I2 GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I2 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación P GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación P GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	10.058.498 GBP	9,97 GBP	14.129.180 GBP	7,93 GBP	5.008.787 GBP	10,17 GBP
31 de diciembre de 2023	52.006.312 GBP	9,48 GBP	14.500.268 GBP	7,71 GBP	6.285.375 GBP	9,67 GBP

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) A HKD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A HKD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I JPY Valor liquidativo	Clase de acumulación I JPY Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A SEK Valor liquidativo	Clase de acumulación A SEK Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	2.064.559 HKD	7,67 HKD	1.592.523.397 JPY	895,91 JPY	666.109.446 SEK	105,48 SEK
31 de diciembre de 2023	1.470.947 HKD	7,64 HKD	1.753.662.260 JPY	876,83 JPY	650.472.349 SEK	101,47 SEK

Período finalizado el	Clase de acumulación I2 SEK Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 SEK Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A SGD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A SGD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	57.533.091 SEK	90,25 SEK	31.484.787 SGD	14,33 SGD	139.637.993 USD	7,27 USD
31 de diciembre de 2023	66.952.498 SEK	86,45 SEK	19.324.573 SGD	14,34 SGD	138.241.930 USD	7,21 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto A USD Valor liquidativo	Clase de reparto A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	119.644.408 USD	13,35 USD	383.494 USD	8,61 USD	9.781.183 USD	9,87 USD
31 de diciembre de 2023	120.778.298 USD	12,73 USD	377.098 USD	8,36 USD	9.941.291 USD	9,46 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Emerging Market Debt – Hard Currency (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I USD Valor liquidativo	Clase de reparto I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	674.893.604 USD	14,44 USD	73.723.215 USD	8,57 USD	292.331.233 USD	12,55 USD
31 de diciembre de 2023	571.487.781 USD	13,71 USD	73.431.118 USD	8,32 USD	273.160.580 USD	11,91 USD

Período finalizado el	Clase de reparto I2 USD Valor liquidativo	Clase de reparto I2 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I3 USD Valor liquidativo	Clase de reparto I3 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	25.047.496 USD	8,31 USD	90.885.484 USD	8,46 USD	19.346.800 USD	9,99 USD
31 de diciembre de 2023	19.503.916 USD	8,07 USD	88.359.188 USD	8,22 USD	17.071.508 USD	9,56 USD

Período finalizado el	Clase de reparto M USD Valor liquidativo	Clase de reparto M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación P USD Valor liquidativo	Clase de acumulación P USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	3.876.363 USD	6,87 USD	61.474.155 USD	10,73 USD	129.392.777 USD	9,81 USD
31 de diciembre de 2023	3.623.006 USD	6,75 USD	62.007.224 USD	10,19 USD	112.274.225 USD	9,30 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	88.504 USD	12,14 USD
31 de diciembre de 2023	112.030 USD	11,49 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Emerging Market Debt – Local Currency

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) B AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) B AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación B AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación B AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación C2 AUD* Valor liquidativo	Clase de acumulación C2 AUD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.143.162 AUD	3,15 AUD	169.247 AUD	7,83 AUD	–	–
31 de diciembre de 2023	1.680.905 AUD	3,51 AUD	288.975 AUD	8,34 AUD	7.713 AUD	8,34 AUD

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) E AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) E AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación E AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación E AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) T AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) T AUD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	243.150 AUD	3,15 AUD	45.714 AUD	7,82 AUD	22.360.985 AUD	3,45 AUD
31 de diciembre de 2023	508.897 AUD	3,52 AUD	68.860 AUD	8,33 AUD	25.930.999 AUD	3,82 AUD

Período finalizado el	Clase de acumulación T AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación T AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	2.014.766 AUD	8,56 AUD	6.096.360 EUR	6,79 EUR	17.639.344 EUR	7,35 EUR
31 de diciembre de 2023	2.144.666 AUD	9,07 AUD	1.976.819 EUR	7,19 EUR	26.979.998 EUR	7,76 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación sin cobertura I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I2 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I2 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto sin cobertura I4 EUR Valor liquidativo	Clase de reparto sin cobertura I4 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	129.319.226 EUR	10,00 EUR	15.243.803 EUR	11,80 EUR	18.719.193 EUR	7,27 EUR
31 de diciembre de 2023	160.972.265 EUR	10,15 EUR	15.466.180 EUR	11,97 EUR	19.486.748 EUR	7,57 EUR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Emerging Market Debt – Local Currency (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación sin cobertura Y EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura Y EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I4 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I4 GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	83.412.465 EUR	10,05 EUR	369.529 GBP	8,23 GBP	96.969.333 GBP	10,06 GBP
31 de diciembre de 2023	78.895.093 EUR	10,18 EUR	371.999 GBP	8,63 GBP	80.057.410 GBP	10,42 GBP

Período finalizado el	Clase de reparto sin cobertura I4 GBP Valor liquidativo	Clase de reparto sin cobertura I4 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura Y GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura Y GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A SEK Valor liquidativo	Clase de acumulación A SEK Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	14.099.257 GBP	6,96 GBP	26.746.817 GBP	9,61 GBP	5.473.187 SEK	83,56 SEK
31 de diciembre de 2023	40.220.459 GBP	7,40 GBP	37.033.049 GBP	9,95 GBP	7.555.579 SEK	88,68 SEK

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) A SGD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A SGD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	515.411 SGD	10,06 SGD	3.449.544 USD	4,58 USD	12.069.371 USD	8,37 USD
31 de diciembre de 2023	715.536 SGD	11,03 SGD	3.826.624 USD	4,97 USD	13.576.056 USD	8,79 USD

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) B USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) B USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación B USD Valor liquidativo	Clase de acumulación B USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) C2 USD* Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) C2 USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	8.463.353 USD	3,63 USD	386.126 USD	8,43 USD	–	–
31 de diciembre de 2023	11.403.018 USD	4,02 USD	516.378 USD	8,91 USD	3.620 USD	4,02 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Emerging Market Debt – Local Currency (cont.)

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) E USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) E USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación E USD Valor liquidativo	Clase de acumulación E USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) I USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	830.396 USD	3,63 USD	107.940 USD	8,43 USD	27.749.261 USD	7,37 USD
31 de diciembre de 2023	1.731.121 USD	4,02 USD	259.037 USD	8,92 USD	36.107.420 USD	7,97 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I USD Valor liquidativo	Clase de reparto I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	156.572.962 USD	9,10 USD	1.104.337 USD	7,03 USD	71.562.954 USD	8,85 USD
31 de diciembre de 2023	194.371.958 USD	9,52 USD	1.184.970 USD	7,55 USD	70.501.757 USD	9,26 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I5 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) T USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) T USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación T USD Valor liquidativo	Clase de acumulación T USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	15.435 USD	9,76 USD	44.154.014 USD	4,04 USD	3.673.000 USD	9,23 USD
31 de diciembre de 2023	16.123 USD	10,20 USD	51.105.062 USD	4,45 USD	4.366.661 USD	9,71 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Y USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Y USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) B ZAR Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) B ZAR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	131.711.144 USD	9,06 USD	152.889.512 USD	8,79 USD	32.913.477 ZAR	32,91 ZAR
31 de diciembre de 2023	142.192.091 USD	9,46 USD	158.436.161 USD	9,18 USD	46.066.036 ZAR	36,52 ZAR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Emerging Market Debt – Local Currency (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación B ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación B ZAR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) C2 ZAR* Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) C2 ZAR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación C2 ZAR* Valor liquidativo	Clase de acumulación C2 ZAR* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	3.230.754 ZAR	118,16 ZAR	–	–	–	–
31 de diciembre de 2023	12.043.264 ZAR	123,28 ZAR	68.175 ZAR	36,53 ZAR	193.673 ZAR	121,37 ZAR

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) E ZAR Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) E ZAR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación E ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación E ZAR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) T ZAR Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) T ZAR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	11.650.309 ZAR	32,92 ZAR	214.292 ZAR	118,13 ZAR	489.721.973 ZAR	36,05 ZAR
31 de diciembre de 2023	14.044.410 ZAR	36,52 ZAR	223.552 ZAR	123,23 ZAR	562.071.052 ZAR	39,80 ZAR

Período finalizado el	Clase de acumulación T ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación T ZAR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	42.148.117 ZAR	129,42 ZAR
31 de diciembre de 2023	48.967.524 ZAR	134,35 ZAR

Emerging Market Debt Blend

Período finalizado el	Clase de reparto I3 AUD Valor liquidativo	Clase de reparto I3 AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	8.422.904 AUD	7,80 AUD	8.035.947 EUR	10,50 EUR	237.428.973 EUR	10,89 EUR
31 de diciembre de 2023	8.072.686 AUD	7,96 AUD	10.852.194 EUR	10,46 EUR	239.809.262 EUR	10,81 EUR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Emerging Market Debt Blend (cont.)

Período finalizado el	Clase de reparto I EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I2 EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I2 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	20.051.356 EUR	7,11 EUR	11.166.172 EUR	11,21 EUR	8.123.593 EUR	6,92 EUR
31 de diciembre de 2023	23.015.364 EUR	7,22 EUR	13.866.675 EUR	11,12 EUR	8.681.343 EUR	7,03 EUR

Período finalizado el	Clase de reparto I3 EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I3 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I4 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I4 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I5 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	31.138.385 EUR	7,71 EUR	1.982.467 EUR	10,97 EUR	20.495.007 EUR	11,88 EUR
31 de diciembre de 2023	37.124.103 EUR	7,83 EUR	1.921.897 EUR	10,67 EUR	20.761.167 EUR	11,77 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto M EUR Valor liquidativo	Clase de reparto M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación Z EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	827.104 EUR	10,02 EUR	1.676.259 EUR	5,77 EUR	219.317 EUR	11,83 EUR
31 de diciembre de 2023	523.183 EUR	10,02 EUR	1.045.469 EUR	5,99 EUR	153.104 EUR	11,70 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	291.436 GBP	11,57 GBP	5.659 GBP	10,58 GBP	8.541.064 GBP	7,86 GBP
31 de diciembre de 2023	447.473 GBP	11,57 GBP	5.642 GBP	10,53 GBP	9.742.793 GBP	8,05 GBP

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Emerging Market Debt Blend (cont.)

Período finalizado el	Clase de reparto sin cobertura I GBP Valor liquidativo	Clase de reparto sin cobertura I GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación P GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación P GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura P GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura P GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	3.281.057 GBP	8,33 GBP	2.174.006 GBP	10,13 GBP	807.153 GBP	10,48 GBP
31 de diciembre de 2023	572.809 GBP	8,49 GBP	3.109.393 GBP	10,14 GBP	925.166 GBP	10,44 GBP

Período finalizado el	Clase de acumulación Z GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación Z GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación U NOK Valor liquidativo	Clase de acumulación U NOK Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A SEK Valor liquidativo	Clase de acumulación A SEK Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	23.755 GBP	12,66 GBP	260.825 NOK	114,11 NOK	23.896.656 SEK	113,96 SEK
31 de diciembre de 2023	213.173 GBP	12,62 GBP	256.896 NOK	112,39 NOK	26.654.232 SEK	112,47 SEK

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) A SGD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A SGD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	4.049.297 SGD	12,25 SGD	716.941 USD	6,27 USD	7.181.136 USD	11,60 USD
31 de diciembre de 2023	4.180.476 SGD	12,67 SGD	329.767 USD	6,55 USD	6.722.677 USD	11,69 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I USD Valor liquidativo	Clase de reparto I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	709.121 USD	8,97 USD	17.759.191 USD	11,02 USD	358.846 USD	8,03 USD
31 de diciembre de 2023	826.659 USD	9,08 USD	16.801.138 USD	11,06 USD	379.773 USD	8,25 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Emerging Market Debt Blend (cont.)

Período finalizado el	Clase de reparto I2 USD Valor liquidativo	Clase de reparto I2 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I5 USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 USD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	41.671.945 USD	7,36 USD	33.849.234 USD	10,37 USD	441.743 USD	9,06 USD
31 de diciembre de 2023	40.972.944 USD	7,57 USD	33.920.715 USD	10,40 USD	731.356 USD	9,16 USD

Período finalizado el	Clase de reparto M USD Valor liquidativo	Clase de reparto M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	280.638 USD	5,77 USD	116.696 USD	13,22 USD
31 de diciembre de 2023	572.534 USD	6,06 USD	125.103 USD	13,23 USD

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

Período finalizado el	Clase de acumulación I2 AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I NOK Valor liquidativo	Clase de acumulación I NOK Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I3 NOK* Valor liquidativo	Clase de acumulación I3 NOK* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	23.267.313 AUD	9,18 AUD	2.081.995 NOK	111,32 NOK	407.786.893 NOK	102,86 NOK
31 de diciembre de 2023	23.549.524 AUD	9,29 AUD	3.209.047 NOK	111,71 NOK	379.560.196 NOK	103,13 NOK

Período finalizado el	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	40.586 USD	11,03 USD	4.323.984 USD	9,20 USD	5.056.517 USD	11,12 USD
31 de diciembre de 2023	41.218 USD	11,20 USD	4.388.707 USD	9,34 USD	6.869.103 USD	11,26 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Emerging Markets Equity

Período finalizado el	Clase de acumulación B AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación B AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación C2 AUD* Valor liquidativo	Clase de acumulación C2 AUD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación E AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación E AUD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	315.081 AUD	10,67 AUD	—	—	25.066 AUD	10,66 AUD
31 de diciembre de 2023	275.609 AUD	9,42 AUD	14.841 AUD	9,43 AUD	42.510 AUD	9,41 AUD

Período finalizado el	Clase de acumulación T AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación T AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto sin cobertura I CAD Valor liquidativo	Clase de reparto sin cobertura I CAD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I2 CAD Valor liquidativo	Clase de reparto I2 CAD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.956.414 AUD	11,50 AUD	79.583 CAD	9,61 CAD	13.589.119 CAD	9,10 CAD
31 de diciembre de 2023	1.771.385 AUD	10,11 AUD	66.826 CAD	8,07 CAD	11.897.241 CAD	7,97 CAD

Período finalizado el	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación Z EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	3.402.353 EUR	10,34 EUR	417.652 EUR	11,52 EUR	199.331 EUR	8,95 EUR
31 de diciembre de 2023	709.680 EUR	9,04 EUR	408.164 EUR	10,17 EUR	173.388 EUR	7,78 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación Z GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	22.309 GBP	12,01 GBP	88.375 GBP	14,63 GBP	2.649.309 USD	11,57 USD
31 de diciembre de 2023	406.653 GBP	10,43 GBP	86.537 GBP	12,65 GBP	5.239.268 USD	10,08 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Emerging Markets Equity (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación B USD Valor liquidativo	Clase de acumulación B USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación C2 USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación C2 USD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación E USD Valor liquidativo	Clase de acumulación E USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	2.086.523 USD	12,02 USD	–	–	423.298 USD	12,00 USD
31 de diciembre de 2023	856.399 USD	10,52 USD	10.153 USD	10,50 USD	138.219 USD	10,50 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación T USD Valor liquidativo	Clase de acumulación T USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	48.807.279 USD	13,25 USD	2.810.392 USD	12,80 USD	4.330.728 USD	12,98 USD
31 de diciembre de 2023	41.804.429 USD	11,48 USD	439.380 USD	11,20 USD	4.026.797 USD	11,29 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación B ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación B ZAR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación C2 ZAR* Valor liquidativo	Clase de acumulación C2 ZAR* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	36.322.082 USD	13,82 USD	10.393.368 ZAR	151,47 ZAR	–	–
31 de diciembre de 2023	23.862.482 USD	11,91 USD	4.948.769 ZAR	131,03 ZAR	47.220 ZAR	131,00 ZAR

Período finalizado el	Clase de acumulación E ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación E ZAR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación T ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación T ZAR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	3.069.793 ZAR	151,46 ZAR	26.908.984 ZAR	163,65 ZAR
31 de diciembre de 2023	3.798.941 ZAR	131,02 ZAR	23.945.169 ZAR	140,86 ZAR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Euro Bond

Período finalizado el	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación Z EUR* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.272.203 EUR	11,02 EUR	9.872.511 EUR	10,09 EUR	2.924.502 EUR	9,98 EUR
31 de diciembre de 2023	653.118 EUR	10,95 EUR	9.919.526 EUR	10,13 EUR	—	—

Euro Bond Absolute Return

Período finalizado el	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I5 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	6.243.494 EUR	11,75 EUR	10.125 EUR	10,89 EUR	5.716.054 EUR	11,81 EUR
31 de diciembre de 2023	1.020.367 EUR	11,38 EUR	9.922 EUR	10,67 EUR	5.531.035 EUR	11,43 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación Z EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación Z EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	11.277.820 EUR	10,08 EUR	31.667.268 USD	12,55 USD
31 de diciembre de 2023	—	—	30.372.279 USD	12,04 USD

European High Yield Bond

Período finalizado el	Clase de acumulación I CHF* Valor liquidativo	Clase de acumulación I CHF* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 EUR* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	2.528.240 CHF	11,00 CHF	67.512.905 EUR	14,51 EUR	5.306.992 EUR	10,93 EUR
31 de diciembre de 2023	1.796.679 CHF	10,75 CHF	47.206.772 EUR	14,01 EUR	208.432 EUR	10,54 EUR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

European High Yield Bond (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación I5 EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación X EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación X EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	—	—	1.126.273 EUR	13,06 EUR	57.903.535 EUR	12,80 EUR
31 de diciembre de 2023	6.258.149 EUR	10,44 EUR	787.345 EUR	12,68 EUR	48.934.376 EUR	12,33 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación Y EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación Y EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto Y EUR* Valor liquidativo	Clase de reparto Y EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	353.038.765 EUR	11,73 EUR	6.304.805 EUR	10,88 EUR	1.039.247 USD	9,22 USD
31 de diciembre de 2023	281.409.669 EUR	11,30 EUR	2.941.098 EUR	10,74 EUR	320.629 USD	9,25 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	243.994 USD	17,21 USD	609.780 USD	14,54 USD	20.526.259 USD	13,72 USD
31 de diciembre de 2023	228.440 USD	16,49 USD	585.996 USD	13,90 USD	19.509.577 USD	13,11 USD

European Sustainable Equity

Período finalizado el	Clase de reparto A EUR Valor liquidativo	Clase de reparto A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	25.585 EUR	9,74 EUR	36.201 EUR	11,35 EUR	11.501 EUR	11,20 EUR
31 de diciembre de 2023	24.542 EUR	9,34 EUR	34.572 EUR	10,84 EUR	11.039 EUR	10,75 EUR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
European Sustainable Equity (cont.)

Período finalizado el	Clase de reparto I3 EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I3 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I5 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	89.808.886 EUR	9,59 EUR	1.720.398 EUR	9,96 EUR	53.745 EUR	10,72 EUR
31 de diciembre de 2023	112.925.635 EUR	9,21 EUR	2.081.086 EUR	9,49 EUR	39.633 EUR	10,33 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación Z EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación Z EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	59.742.390 EUR	11,47 EUR	9.911 USD	9,91 USD	10.203 USD	10,20 USD
31 de diciembre de 2023	56.967.179 EUR	10,92 EUR	9.798 USD	9,80 USD	10.041 USD	10,04 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación sin cobertura M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	9.654 USD	9,65 USD
31 de diciembre de 2023	9.581 USD	9,58 USD

Event Driven

Período finalizado el	Clase de acumulación I EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I5 EUR* Valor liquidativo	Clase de reparto I5 EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I5 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	9.790 EUR	10,61 EUR	28.087 EUR	10,17 EUR	90.454.209 GBP	10,94 GBP
31 de diciembre de 2023	9.507 EUR	10,31 EUR	–	–	75.985.117 GBP	10,54 GBP

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Event Driven (cont.)

Período finalizado el	Clase de reparto I5 GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I5 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación P GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación P GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	8.876.190 GBP	10,90 GBP	28.074 GBP	10,86 GBP	10.927 USD	10,93 USD
31 de diciembre de 2023	12.132.056 GBP	10,55 GBP	27.125 GBP	10,50 GBP	10.548 USD	10,55 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I5 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	12.634.705 USD	11,03 USD
31 de diciembre de 2023	13.846.477 USD	10,61 USD

Global Bond

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) T AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) T AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I en EUR - Índice con Cobertura* Valor liquidativo	Clase de acumulación I en EUR - Índice con Cobertura* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	27.895 AUD	7,09 AUD	6.016.633 EUR	10,32 EUR	317.712 USD	8,70 USD
31 de diciembre de 2023	29.629 AUD	7,53 AUD	28.777 EUR	10,40 EUR	340.537 USD	9,02 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I en USD - Índice con Cobertura Valor liquidativo	Clase de acumulación I en USD - Índice con Cobertura Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	59.269 USD	10,96 USD	1.765.425 USD	9,95 USD	812.241 USD	9,23 USD
31 de diciembre de 2023	32.939 USD	10,98 USD	3.215.877 USD	10,26 USD	420.409 USD	9,54 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Global Bond (cont.)

	Clase de reparto (mensual) T USD	Clase de reparto (mensual) T USD	Clase de acumulación Z USD	Clase de acumulación Z USD	Clase de reparto (mensual) T ZAR	Clase de reparto (mensual) T ZAR
Período finalizado el	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	22.477 USD	7,49 USD	101.993.244 USD	10,48 USD	326.409 ZAR	72,85 ZAR
31 de diciembre de 2023	23.698 USD	7,90 USD	104.673.682 USD	10,79 USD	345.130 ZAR	77,03 ZAR

Global Diversified Income FMP – 2024**

	Clase de acumulación A EUR	Clase de acumulación A EUR	Clase de reparto A EUR	Clase de reparto A EUR	Clase de reparto I EUR	Clase de reparto I EUR
Período finalizado el	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.242.467 EUR	10,17 EUR	224.032 EUR	8,96 EUR	885.276 EUR	8,85 EUR
31 de diciembre de 2023	1.220.917 EUR	9,99 EUR	223.121 EUR	8,92 EUR	881.687 EUR	8,82 EUR

	Clase de reparto I GBP	Clase de reparto I GBP	Clase de reparto A HKD	Clase de reparto A HKD	Clase de reparto A SGD	Clase de reparto A SGD
Período finalizado el	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.926.759 GBP	9,40 GBP	6.926.306 HKD	9,24 HKD	3.813.710 SGD	18,58 SGD
31 de diciembre de 2023	1.906.267 GBP	9,30 GBP	6.877.059 HKD	9,17 HKD	4.402.150 SGD	18,52 SGD

	Clase de acumulación A USD	Clase de acumulación A USD	Clase de reparto A USD	Clase de reparto A USD	Clase de acumulación I USD	Clase de acumulación I USD
Período finalizado el	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	24.814.423 USD	10,83 USD	34.186.986 USD	9,51 USD	2.788.943 USD	11,00 USD
31 de diciembre de 2023	27.345.677 USD	10,56 USD	37.856.568 USD	9,40 USD	2.714.197 USD	10,70 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Global Diversified Income FMP – 2024** (cont.)

Período finalizado el	Clase de reparto I USD Valor liquidativo	Clase de reparto I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto X USD Valor liquidativo	Clase de reparto X USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	2.133.680 USD	9,52 USD	5.468.963 USD	10,98 USD	23.901.121 USD	9,52 USD
31 de diciembre de 2023	2.108.874 USD	9,41 USD	22.493.910 USD	10,69 USD	54.424.599 USD	9,41 USD

** La Cartera se liquidó el 28 de junio de 2024.

Global Equity Megatrends

Período finalizado el	Clase de acumulación I EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I4 GBP* Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I4 GBP* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	7.344.605 EUR	11,67 EUR	14.043.324 EUR	18,60 EUR	4.096.621 GBP	9,94 GBP
31 de diciembre de 2023	7.537.600 EUR	9,95 EUR	7.793.561 EUR	15,99 EUR	–	–

Período finalizado el	Clase de reparto sin cobertura I4 GBP* Valor liquidativo	Clase de reparto sin cobertura I4 GBP* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura P GBP* Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura P GBP* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A SGD* Valor liquidativo	Clase de acumulación A SGD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	8.009 GBP	10,15 GBP	24.885 GBP	12,20 GBP	839.144 SGD	23,45 SGD
31 de diciembre de 2023	–	–	8.355 GBP	10,63 GBP	41.911 SGD	20,85 SGD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Global Equity Megatrends (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	69.423.648 USD	17,17 USD	3.801.255 USD	16,16 USD	56.632.296 USD	18,20 USD
31 de diciembre de 2023	43.806.365 USD	15,15 USD	3.687.503 USD	14,33 USD	35.156.723 USD	15,99 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I4 USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 USD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.088.655 USD	10,57 USD	34.414.223 USD	16,25 USD	43.337.213 USD	12,42 USD
31 de diciembre de 2023	–	–	21.892.795 USD	14,39 USD	22.954.011 USD	10,87 USD

Global Flexible Credit Income

Período finalizado el	Clase de acumulación I5 CAD Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 CAD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	15.126.148 CAD	10,83 CAD	2.337.874 EUR	10,96 EUR	904.820 EUR	10,25 EUR
31 de diciembre de 2023	14.626.794 CAD	10,47 CAD	5.816.508 EUR	10,66 EUR	445.491 EUR	10,05 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación I5 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A USD* Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A USD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	159.479.415 GBP	12,18 GBP	326.420 USD	10,05 USD	14.993.862 USD	11,24 USD
31 de diciembre de 2023	151.941.174 GBP	11,76 GBP	–	–	9.962.495 USD	10,89 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Global Flexible Credit Income (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I USD Valor liquidativo	Clase de reparto I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	166.316.369 USD	12,28 USD	332.281 USD	10,25 USD	8.370.569 USD	10,91 USD
31 de diciembre de 2023	157.808.987 USD	11,86 USD	355.209 USD	10,15 USD	6.408.215 USD	10,60 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	6.372.723 USD	12,58 USD
31 de diciembre de 2023	6.004.606 USD	12,11 USD

Global High Yield SDG Engagement

Período finalizado el	Clase de reparto I AUD Valor liquidativo	Clase de reparto I AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I4 AUD* Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 AUD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I4 CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 CHF Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	40.767 AUD	9,65 AUD	4.419.655 AUD	10,23 AUD	78.761.483 CHF	10,26 CHF
31 de diciembre de 2023	40.737 AUD	9,65 AUD	–	–	74.837.938 CHF	10,11 CHF

Período finalizado el	Clase de reparto I4 CHF Valor liquidativo	Clase de reparto I4 CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación X CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación X CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I4 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	4.607.042 CHF	9,23 CHF	29.618 CHF	10,10 CHF	60.580.606 EUR	10,56 EUR
31 de diciembre de 2023	4.796.137 CHF	9,36 CHF	29.298 CHF	10,00 CHF	64.352.654 EUR	10,29 EUR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Global High Yield SDG Engagement (cont.)

Período finalizado el	Clase de reparto I4 EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I4 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación X EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación X EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z (PF) EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación Z (PF) EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	969.303 EUR	9,50 EUR	29.586 EUR	10,40 EUR	23.512.962 EUR	11,91 EUR
31 de diciembre de 2023	1.101.288 EUR	9,52 EUR	28.912 EUR	10,16 EUR	23.929.260 EUR	11,58 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación I4 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación X GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación X GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	18.054.472 GBP	10,95 GBP	25.847 GBP	10,78 GBP	1.520.880 USD	12,76 USD
31 de diciembre de 2023	18.172.947 GBP	10,59 GBP	25.092 GBP	10,46 GBP	621.460 USD	12,38 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I4 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto M USD Valor liquidativo	Clase de reparto M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	6.130.722 USD	13,53 USD	406.083.193 USD	11,10 USD	1.238.074 USD	7,90 USD
31 de diciembre de 2023	5.429.150 USD	13,08 USD	325.223.085 USD	10,73 USD	1.251.730 USD	7,92 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	21.715 USD	10,79 USD	9.292.802 USD	14,18 USD
31 de diciembre de 2023	21.053 USD	10,46 USD	8.991.111 USD	13,68 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Global Investment Grade Credit

Período finalizado el	Clase de acumulación I EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	28.738 EUR	10,53 EUR	1.795.475 USD	9,34 USD	40.712.686 USD	9,39 USD
31 de diciembre de 2023	28.687 EUR	10,51 EUR	1.777.609 USD	9,25 USD	40.267.522 USD	9,29 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	45.204.579 USD	9,42 USD
31 de diciembre de 2023	44.688.102 USD	9,31 USD

Global Opportunistic Bond

Período finalizado el	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación P GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación P GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	14.671 EUR	9,59 EUR	22.509 GBP	9,81 GBP	20.814 USD	10,80 USD
31 de diciembre de 2023	14.805 EUR	9,68 EUR	22.561 GBP	9,83 GBP	20.869 USD	10,83 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I USD Valor liquidativo	Clase de reparto I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	6.274.076 USD	11,57 USD	12.071.404 USD	9,65 USD	23.830.310 USD	10,96 USD
31 de diciembre de 2023	4.553.699 USD	11,59 USD	12.262.296 USD	9,80 USD	23.293.272 USD	10,97 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Global Opportunistic Bond (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	24.452.233 USD	10,71 USD
31 de diciembre de 2023	25.233.838 USD	10,70 USD

Global Real Estate Securities

Período finalizado el	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura Z EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura Z EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación Z GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	762.957 EUR	9,38 EUR	207.763 EUR	11,45 EUR	5.737 GBP	11,47 GBP
31 de diciembre de 2023	877.918 EUR	10,17 EUR	213.904 EUR	11,79 EUR	89.203 GBP	12,21 GBP

Período finalizado el	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación CI USD Valor liquidativo	Clase de acumulación CI USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	3.166.163 USD	9,83 USD	94.970 USD	8,63 USD	10.497.142 USD	12,69 USD
31 de diciembre de 2023	3.456.439 USD	10,51 USD	135.797 USD	9,28 USD	12.394.725 USD	13,51 USD

Período finalizado el	Clase de reparto I5 USD Valor liquidativo	Clase de reparto I5 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	28.644 USD	8,64 USD	586.599 USD	8,85 USD	4.543.536 USD	13,09 USD
31 de diciembre de 2023	30.861 USD	9,31 USD	718.797 USD	9,51 USD	2.419.204 USD	13,89 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Global Sustainable Equity

Período finalizado el	Clase de acumulación sin cobertura I5 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I5 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura Z EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura Z EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	90.294.514 EUR	13,28 EUR	92.976 EUR	12,42 EUR	1.550.599 EUR	12,88 EUR
31 de diciembre de 2023	86.892.096 EUR	12,11 EUR	78.678 EUR	11,43 EUR	1.439.413 EUR	11,72 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación sin cobertura I GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I5 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I5 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.794.075 GBP	12,32 GBP	4.734.922 GBP	12,44 GBP	259.235 USD	9,43 USD
31 de diciembre de 2023	981.020 GBP	11,49 GBP	4.420.169 GBP	11,59 GBP	471.447 USD	8,92 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I USD Valor liquidativo	Clase de reparto I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	7.208.888 USD	11,61 USD	13.151 USD	11,63 USD	153.061 USD	10,94 USD
31 de diciembre de 2023	11.121.650 USD	10,93 USD	12.373 USD	10,94 USD	417.625 USD	10,38 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	44.582.445 USD	11,04 USD
31 de diciembre de 2023	37.957.449 USD	10,35 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Global Sustainable Value

Período finalizado el	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I5 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I5 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura P GBP* Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura P GBP* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	456.199 EUR	16,64 EUR	11.961.039 GBP	12,03 GBP	295.458 GBP	11,57 GBP
31 de diciembre de 2023	520.510 EUR	15,76 EUR	10.307 GBP	11,12 GBP	8.811 GBP	10,70 GBP

Período finalizado el	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I3 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I3 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.687.006 USD	19,65 USD	10.241.763 USD	20,88 USD	32.787.558 USD	11,86 USD
31 de diciembre de 2023	1.388.066 USD	18,39 USD	10.479.115 USD	19,50 USD	31.008.928 USD	11,06 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	17.182.592 USD	22,84 USD
31 de diciembre de 2023	11.985.820 USD	21,28 USD

High Yield Bond

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) A AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación A AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) B AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) B AUD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	15.081.553 AUD	6,34 AUD	2.931.362 AUD	15,30 AUD	10.543.922 AUD	4,77 AUD
31 de diciembre de 2023	15.862.650 AUD	6,50 AUD	2.858.210 AUD	15,00 AUD	10.373.440 AUD	4,93 AUD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

High Yield Bond (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación B AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación B AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) C2 AUD* Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) C2 AUD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) E AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) E AUD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	946.155 AUD	9,45 AUD	–	–	2.913.386 AUD	4,81 AUD
31 de diciembre de 2023	1.011.221 AUD	9,33 AUD	3.241 AUD	4,94 AUD	1.845.729 AUD	4,97 AUD

Período finalizado el	Clase de acumulación E AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación E AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I AUD Valor liquidativo	Clase de reparto I AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) T AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) T AUD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	715.327 AUD	10,65 AUD	10.962.348 AUD	9,38 AUD	66.734.295 AUD	5,58 AUD
31 de diciembre de 2023	413.416 AUD	10,52 AUD	17.014.854 AUD	9,44 AUD	73.324.379 AUD	5,74 AUD

Período finalizado el	Clase de reparto (semanal) T AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (semanal) T AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación T AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación T AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A CAD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A CAD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	700.628 AUD	5,40 AUD	1.546.958 AUD	13,02 AUD	7.034.921 CAD	6,60 CAD
31 de diciembre de 2023	754.803 AUD	5,55 AUD	1.527.094 AUD	12,80 AUD	5.981.498 CAD	6,74 CAD

Período finalizado el	Clase de acumulación A CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación A CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación I CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 CHF Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	2.721.706 CHF	12,25 CHF	222.826 CHF	13,18 CHF	2.232.634 CHF	11,31 CHF
31 de diciembre de 2023	2.903.144 CHF	12,18 CHF	220.795 CHF	13,06 CHF	2.436.116 CHF	11,20 CHF

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
High Yield Bond (cont.)

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) A CNY Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A CNY Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) I CNY Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) I CNY Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A EUR Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	10.947.749 CNY	71,11 CNY	203.398 CNY	75,81 CNY	5.728.112 EUR	5,90 EUR
31 de diciembre de 2023	11.540.823 CNY	73,18 CNY	208.678 CNY	77,78 CNY	5.784.669 EUR	6,06 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto A EUR Valor liquidativo	Clase de reparto A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	5.090.758 EUR	20,31 EUR	2.331.516 EUR	7,13 EUR	18.456.085 EUR	18,15 EUR
31 de diciembre de 2023	5.575.031 EUR	19,94 EUR	2.533.501 EUR	7,19 EUR	18.413.969 EUR	17,76 EUR

Período finalizado el	Clase de reparto I EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I2 EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I2 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	4.374.860 EUR	6,86 EUR	60.422.063 EUR	12,75 EUR	56.528.423 EUR	6,77 EUR
31 de diciembre de 2023	4.310.197 EUR	6,92 EUR	51.114.447 EUR	12,47 EUR	56.865.932 EUR	6,82 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación Z EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A GBP Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	34.662 EUR	11,33 EUR	201.419 EUR	12,20 EUR	2.211.116 GBP	6,21 GBP
31 de diciembre de 2023	34.119 EUR	11,15 EUR	181.078 EUR	11,90 EUR	2.684.037 GBP	6,34 GBP

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

High Yield Bond (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación A GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación A GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto A GBP Valor liquidativo	Clase de reparto A GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.315.343 GBP	14,57 GBP	953.558 GBP	7,90 GBP	6.324.230 GBP	17,79 GBP
31 de diciembre de 2023	1.411.301 GBP	14,20 GBP	954.452 GBP	7,91 GBP	5.789.389 GBP	17,29 GBP

Período finalizado el	Clase de reparto I GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I2 GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I2 GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	916.689 GBP	8,55 GBP	1.466.962 GBP	14,24 GBP	169.905.427 GBP	7,57 GBP
31 de diciembre de 2023	3.395.941 GBP	8,55 GBP	1.512.133 GBP	13,84 GBP	168.547.845 GBP	7,57 GBP

Período finalizado el	Clase de acumulación Z GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación Z GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A HKD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A HKD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A SEK Valor liquidativo	Clase de acumulación A SEK Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	37.768 GBP	13,84 GBP	30.783.417 HKD	6,50 HKD	787.058.871 SEK	138,53 SEK
31 de diciembre de 2023	124.386 GBP	13,42 GBP	36.563.065 HKD	6,65 HKD	723.938.325 SEK	136,03 SEK

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) A SGD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A SGD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A SGD Valor liquidativo	Clase de acumulación A SGD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	22.114.903 SGD	13,46 SGD	4.288.976 SGD	29,54 SGD	70.195.334 USD	7,00 USD
31 de diciembre de 2023	19.027.580 SGD	13,83 SGD	4.897.409 SGD	29,01 SGD	77.008.320 USD	7,13 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
High Yield Bond (cont.)

Período finalizado el	Clase de reparto (semanal) A USD Valor liquidativo	Clase de reparto (semanal) A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto A USD Valor liquidativo	Clase de reparto A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	2.843.002 USD	6,72 USD	132.401.500 USD	18,56 USD	18.705.478 USD	8,60 USD
31 de diciembre de 2023	2.412.509 USD	6,84 USD	131.648.685 USD	18,07 USD	19.236.817 USD	8,60 USD

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) B USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) B USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación B USD Valor liquidativo	Clase de acumulación B USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación C USD Valor liquidativo	Clase de acumulación C USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	90.380.545 USD	5,30 USD	10.364.851 USD	12,08 USD	942.469 USD	13,60 USD
31 de diciembre de 2023	98.121.371 USD	5,45 USD	9.209.516 USD	11,85 USD	920.256 USD	13,28 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto C1 USD Valor liquidativo	Clase de reparto C1 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) C2 USD* Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) C2 USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.874.774 USD	11,03 USD	563.267 USD	8,69 USD	—	—
31 de diciembre de 2023	2.325.248 USD	10,80 USD	595.052 USD	8,69 USD	12.549 USD	5,44 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación C2 USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación C2 USD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) E USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) E USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación E USD Valor liquidativo	Clase de acumulación E USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	—	—	10.310.842 USD	5,38 USD	2.276.058 USD	10,89 USD
31 de diciembre de 2023	6.358 USD	11,86 USD	10.460.452 USD	5,53 USD	1.547.421 USD	10,69 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

High Yield Bond (cont.)

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) I USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I USD Valor liquidativo	Clase de reparto I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	34.167.533 USD	7,34 USD	305.978.377 USD	28,37 USD	18.775.495 USD	9,94 USD
31 de diciembre de 2023	39.896.230 USD	7,45 USD	301.321.511 USD	27,54 USD	16.191.311 USD	9,94 USD

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) I2 USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) I2 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I2 USD Valor liquidativo	Clase de reparto I2 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	54.593.094 USD	8,26 USD	210.255.183 USD	15,54 USD	220.795.573 USD	8,30 USD
31 de diciembre de 2023	55.183.017 USD	8,38 USD	224.394.250 USD	15,08 USD	220.847.493 USD	8,30 USD

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) I4 USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) I4 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto M USD Valor liquidativo	Clase de reparto M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	140.148.483 USD	9,41 USD	537.203 USD	13,66 USD	296.842 USD	7,93 USD
31 de diciembre de 2023	140.373.282 USD	9,42 USD	460.538 USD	13,34 USD	347.894 USD	8,01 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación P USD Valor liquidativo	Clase de acumulación P USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) T USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) T USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (semanal) T USD Valor liquidativo	Clase de reparto (semanal) T USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	370.965 USD	12,26 USD	127.579.083 USD	5,95 USD	1.385.014 USD	6,00 USD
31 de diciembre de 2023	1.839.803 USD	11,89 USD	133.819.218 USD	6,08 USD	1.777.914 USD	6,12 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

High Yield Bond (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación T USD Valor liquidativo	Clase de acumulación T USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) U USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) U USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación U USD Valor liquidativo	Clase de acumulación U USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	10.329.849 USD	13,55 USD	740.828 USD	6,87 USD	7.481.589 USD	15,10 USD
31 de diciembre de 2023	10.920.480 USD	13,23 USD	753.439 USD	6,98 USD	7.443.249 USD	14,68 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) B ZAR Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) B ZAR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) C2 ZAR* Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) C2 ZAR* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	16.548.899 USD	14,64 USD	248.668.075 ZAR	52,42 ZAR	—	—
31 de diciembre de 2023	44.696.204 USD	14,17 USD	299.231.482 ZAR	53,93 ZAR	444.980 ZAR	53,88 ZAR

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) E ZAR Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) E ZAR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación E ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación E ZAR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) T ZAR Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) T ZAR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	76.541.271 ZAR	51,83 ZAR	5.675.654 ZAR	172,30 ZAR	1.452.225.321 ZAR	58,88 ZAR
31 de diciembre de 2023	77.989.696 ZAR	53,32 ZAR	5.270.093 ZAR	166,67 ZAR	1.559.123.624 ZAR	60,27 ZAR

Período finalizado el	Clase de acumulación T ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación T ZAR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	15.778.363 ZAR	161,49 ZAR
31 de diciembre de 2023	18.144.180 ZAR	155,44 ZAR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

InnovAsia 5G

Período finalizado el	Clase de acumulación I4 CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I4 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	535.577 CHF	8,79 CHF	22.370 EUR	8,81 EUR	580.780 EUR	9,12 EUR
31 de diciembre de 2023	522.675 CHF	8,10 CHF	20.478 EUR	8,07 EUR	738.351 EUR	8,30 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación sin cobertura M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación X EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación X EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A SGD Valor liquidativo	Clase de acumulación A SGD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	27.774 EUR	10,75 EUR	4.397.729 EUR	8,87 EUR	341.881 SGD	18,20 SGD
31 de diciembre de 2023	36.614 EUR	9,50 EUR	4.020.738 EUR	8,11 EUR	33.870 SGD	16,68 SGD

Período finalizado el	Clase de acumulación I4 SGD Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 SGD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación X SGD Valor liquidativo	Clase de acumulación X SGD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	946.591 SGD	18,86 SGD	343.444 SGD	18,34 SGD	3.461.387 USD	9,43 USD
31 de diciembre de 2023	1.025.335 SGD	17,18 SGD	314.342 SGD	16,78 SGD	4.546.493 USD	8,57 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I4 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	5.334.671 USD	9,68 USD	3.910.701 USD	9,78 USD	8.919 USD	8,92 USD
31 de diciembre de 2023	6.636.583 USD	8,76 USD	3.983.343 USD	8,83 USD	8.129 USD	8,13 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
InnovAsia 5G (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.737.206 USD	9,52 USD
31 de diciembre de 2023	1.609.703 USD	8,63 USD

Japan Equity Engagement

Período finalizado el	Clase de reparto I5 EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I5 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I5 GBP* Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 GBP* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I5 GBP* Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I5 GBP* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	35.909 EUR	13,49 EUR	—	—	17.116.477 GBP	10,62 GBP
31 de diciembre de 2023	31.902 EUR	11,98 EUR	344.829 GBP	10,32 GBP	11.862.066 GBP	10,78 GBP

Período finalizado el	Clase de acumulación sin cobertura P GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura P GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A JPY* Valor liquidativo	Clase de acumulación A JPY* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I JPY Valor liquidativo	Clase de acumulación I JPY Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	10.535.883 GBP	8,25 GBP	4.887.729 JPY	1.044,76 JPY	125.480.338 JPY	1.938,32 JPY
31 de diciembre de 2023	11.065.396 GBP	8,39 GBP	—	—	154.103.501 JPY	1.742,53 JPY

Período finalizado el	Clase de reparto I JPY Valor liquidativo	Clase de reparto I JPY Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I5 JPY Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 JPY Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z JPY Valor liquidativo	Clase de acumulación Z JPY Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	26.016.073 JPY	1.909,71 JPY	8.680.709.989 JPY	12.619,22 JPY	3.661.796.347 JPY	1.248,78 JPY
31 de diciembre de 2023	23.557.609 JPY	1.729,24 JPY	8.526.499.141 JPY	11.320,64 JPY	3.284.885.177 JPY	1.117,91 JPY

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Japan Equity Engagement (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación A USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	31.539 USD	10,51 USD	32.464 USD	10,82 USD

Macro Opportunities FX**

Período finalizado el	Clase de acumulación I EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z GBP* Valor liquidativo	Clase de acumulación Z GBP* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I SEK* Valor liquidativo	Clase de acumulación I SEK* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	—	—	—	—	—	—
31 de diciembre de 2023	1.264.954 EUR	9,53 EUR	20.546 GBP	10,25 GBP	16.510.843 SEK	96,92 SEK

Período finalizado el	Clase de reparto I SEK* Valor liquidativo	Clase de reparto I SEK* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	—	—	—	—	—	—
31 de diciembre de 2023	37.342 SEK	100,20 SEK	11.032 USD	10,21 USD	83.264 USD	10,46 USD

**La Cartera se liquidó el 8 de febrero de 2024.

Next Generation Mobility

Período finalizado el	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	125.805 EUR	15,63 EUR	44.283 EUR	11,18 EUR	37.418.798 EUR	18,87 EUR
31 de diciembre de 2023	159.766 EUR	14,54 EUR	41.022 EUR	10,36 EUR	39.387.728 EUR	16,80 EUR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Next Generation Mobility (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación sin cobertura M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	34.082.926 EUR	21,54 EUR	31.175.124 USD	18,25 USD	1.432.782 USD	19,42 USD
31 de diciembre de 2023	34.429.616 EUR	19,34 EUR	32.890.078 USD	16,82 USD	1.572.905 USD	17,99 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I USD Valor liquidativo	Clase de reparto I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	12.462.999 USD	18,69 USD	5.000.319 USD	18,68 USD	5.278.742 USD	19,62 USD
31 de diciembre de 2023	8.977.632 USD	17,15 USD	6.463.904 USD	17,14 USD	7.433.399 USD	18,16 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	16.730.181 USD	21,61 USD
31 de diciembre de 2023	25.442.335 USD	19,90 USD

Next Generation Space Economy

Período finalizado el	Clase de acumulación sin cobertura I3 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I3 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	16.331.545 EUR	13,11 EUR	9.617.128 EUR	12,59 EUR	3.976.846 USD	13,26 USD
31 de diciembre de 2023	10.045.792 EUR	11,72 EUR	4.431.301 EUR	11,36 EUR	3.668.583 USD	12,23 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Responsible Asian Debt – Hard Currency

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	117.718 USD	7,67 USD	996.060 USD	11,86 USD	62.659 USD	9,23 USD
31 de diciembre de 2023	259.271 USD	7,78 USD	1.198.440 USD	11,63 USD	147.067 USD	9,09 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I USD Valor liquidativo	Clase de reparto I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) I4 USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) I4 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	362.942 USD	12,49 USD	74.905 USD	9,08 USD	10.039 USD	10,04 USD
31 de diciembre de 2023	354.813 USD	12,21 USD	75.939 USD	9,21 USD	10.140 USD	10,14 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I4 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) X USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) X USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	11.182 USD	11,18 USD	216.986 USD	9,48 USD	9.909 USD	9,91 USD
31 de diciembre de 2023	10.918 USD	10,92 USD	311.342 USD	9,32 USD	10.045 USD	10,05 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	20.250 USD	9,23 USD	63.131.212 USD	11,00 USD
31 de diciembre de 2023	19.846 USD	9,05 USD	61.533.403 USD	10,72 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Short Duration Emerging Market Debt

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) A AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A CAD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A CAD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación A CHF Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.627.646 AUD	7,80 AUD	416.185 CAD	8,18 CAD	2.686.006 CHF	9,69 CHF
31 de diciembre de 2023	1.587.360 AUD	7,87 AUD	418.704 CAD	8,23 CAD	3.242.251 CHF	9,54 CHF

Período finalizado el	Clase de reparto A CHF Valor liquidativo	Clase de reparto A CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación I CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I CHF Valor liquidativo	Clase de reparto I CHF Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	486.346 CHF	6,79 CHF	4.990.612 CHF	10,19 CHF	21.820 CHF	6,82 CHF
31 de diciembre de 2023	566.322 CHF	6,80 CHF	6.601.108 CHF	10,01 CHF	725.354 CHF	6,82 CHF

Período finalizado el	Clase de acumulación I2 CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I2 CHF Valor liquidativo	Clase de reparto I2 CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I5 CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 CHF Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	8.172.447 CHF	10,41 CHF	60.637 CHF	7,48 CHF	793.477 CHF	10,64 CHF
31 de diciembre de 2023	10.145.427 CHF	10,23 CHF	60.679 CHF	7,49 CHF	1.561.093 CHF	10,44 CHF

Período finalizado el	Clase de acumulación P CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación P CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto A EUR Valor liquidativo	Clase de reparto A EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	30.716.857 CHF	9,85 CHF	105.369.040 EUR	10,33 EUR	13.085.717 EUR	7,25 EUR
31 de diciembre de 2023	29.312.877 CHF	9,68 CHF	104.971.926 EUR	10,06 EUR	15.305.883 EUR	7,18 EUR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Short Duration Emerging Market Debt (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	865.167.795 EUR	10,87 EUR	141.868.880 EUR	7,26 EUR	223.508.233 EUR	10,98 EUR
31 de diciembre de 2023	685.080.531 EUR	10,56 EUR	154.181.903 EUR	7,18 EUR	181.322.110 EUR	10,65 EUR

Período finalizado el	Clase de reparto I2 EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I2 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I5 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	47.761.704 EUR	7,86 EUR	4.349.089 EUR	11,41 EUR	3.384.858 EUR	9,99 EUR
31 de diciembre de 2023	52.300.087 EUR	7,77 EUR	6.260.518 EUR	11,07 EUR	2.460.584 EUR	9,76 EUR

Período finalizado el	Clase de reparto M EUR Valor liquidativo	Clase de reparto M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación P EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación P EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación U EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación U EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.588.487 EUR	6,82 EUR	25.649.211 EUR	10,42 EUR	1.023.539 EUR	10,30 EUR
31 de diciembre de 2023	1.819.533 EUR	6,80 EUR	51.801.428 EUR	10,12 EUR	2.806.177 EUR	10,01 EUR

Período finalizado el	Clase de reparto X EUR* Valor liquidativo	Clase de reparto X EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación A GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	–	–	1.439.383 GBP	11,06 GBP	1.402.802 GBP	11,47 GBP
31 de diciembre de 2023	50.236.839 EUR	8,97 EUR	1.023.476 GBP	10,69 GBP	2.374.631 GBP	11,06 GBP

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Short Duration Emerging Market Debt (cont.)

Período finalizado el	Clase de reparto I GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I2 GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I2 GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.690.839 GBP	8,74 GBP	487.660 GBP	11,47 GBP	9.893.727 GBP	8,58 GBP
31 de diciembre de 2023	1.563.847 GBP	8,59 GBP	470.199 GBP	11,06 GBP	11.769.917 GBP	8,43 GBP

Período finalizado el	Clase de reparto I5 GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I5 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación P GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación P GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I JPY Valor liquidativo	Clase de acumulación I JPY Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	150.696.046 GBP	8,07 GBP	4.280.588 GBP	10,77 GBP	72.830.425.524 JPY	1.053,76 JPY
31 de diciembre de 2023	143.767.963 GBP	7,92 GBP	1.773.074 GBP	10,39 GBP	78.935.623.550 JPY	1.045,62 JPY

Período finalizado el	Clase de reparto I JPY Valor liquidativo	Clase de reparto I JPY Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A SEK Valor liquidativo	Clase de acumulación A SEK Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A SGD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A SGD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	5.195.893.554 JPY	700,16 JPY	8.957.679 SEK	100,94 SEK	60.686.119 SGD	15,85 SGD
31 de diciembre de 2023	3.877.798.381 JPY	707,66 JPY	10.553.645 SEK	98,35 SEK	60.789.842 SGD	16,04 SGD

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto A USD Valor liquidativo	Clase de reparto A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	30.450.091 USD	8,24 USD	361.089.284 USD	12,57 USD	70.444.337 USD	8,60 USD
31 de diciembre de 2023	28.236.679 USD	8,26 USD	359.043.792 USD	12,14 USD	89.729.509 USD	8,44 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Short Duration Emerging Market Debt (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto C1 USD Valor liquidativo	Clase de reparto C1 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	30.587.489 USD	10,66 USD	2.703.424 USD	9,09 USD	683.462.232 USD	13,22 USD
31 de diciembre de 2023	32.808.938 USD	10,35 USD	2.808.791 USD	8,92 USD	678.406.064 USD	12,74 USD

Período finalizado el	Clase de reparto I USD Valor liquidativo	Clase de reparto I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I2 USD Valor liquidativo	Clase de reparto I2 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	68.245.206 USD	9,14 USD	33.575.521 USD	13,00 USD	11.619.346 USD	9,13 USD
31 de diciembre de 2023	81.258.937 USD	8,97 USD	36.449.926 USD	12,52 USD	11.897.708 USD	8,96 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I5 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I5 USD Valor liquidativo	Clase de reparto I5 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	5.156.006 USD	13,48 USD	11.038.802 USD	8,75 USD	43.604.872 USD	10,97 USD
31 de diciembre de 2023	5.068.035 USD	12,98 USD	15.103.012 USD	8,58 USD	44.715.996 USD	10,62 USD

Período finalizado el	Clase de reparto M USD Valor liquidativo	Clase de reparto M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación P USD Valor liquidativo	Clase de acumulación P USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	6.538.475 USD	8,10 USD	51.722.399 USD	12,81 USD	25.058.851 USD	13,76 USD
31 de diciembre de 2023	8.351.328 USD	8,02 USD	184.482.252 USD	12,34 USD	24.595.101 USD	13,22 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Short Duration High Yield SDG Engagement

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) A AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación A CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación I CHF Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	481.034 AUD	6,96 AUD	443.289 CHF	11,31 CHF	241.002 CHF	12,36 CHF
31 de diciembre de 2023	1.140.803 AUD	7,10 AUD	441.932 CHF	11,27 CHF	239.547 CHF	12,28 CHF

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) A CNY Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A CNY Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto A EUR Valor liquidativo	Clase de reparto A EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	2.012.319 CNY	81,58 CNY	9.768.821 EUR	12,26 EUR	2.349.488 EUR	6,82 EUR
31 de diciembre de 2023	2.036.218 CNY	83,39 CNY	12.464.115 EUR	12,07 EUR	1.917.691 EUR	6,89 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	61.346.171 EUR	13,18 EUR	34.288.871 EUR	12,23 EUR	1.118.641 EUR	10,77 EUR
31 de diciembre de 2023	50.324.368 EUR	12,94 EUR	42.272.021 EUR	12,01 EUR	976.342 EUR	10,64 EUR

Período finalizado el	Clase de reparto M EUR Valor liquidativo	Clase de reparto M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	591.167 EUR	6,70 EUR	445.454 GBP	14,76 GBP	55.706.204 GBP	7,77 GBP
31 de diciembre de 2023	604.904 EUR	6,83 EUR	395.559 GBP	14,40 GBP	55.855.459 GBP	7,80 GBP

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Short Duration High Yield SDG Engagement (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación I2 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I2 GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I2 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A HKD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A HKD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.351.772 GBP	13,73 GBP	748.752 GBP	7,58 GBP	819.376 HKD	9,90 HKD
31 de diciembre de 2023	1.317.678 GBP	13,38 GBP	910.689 GBP	7,60 GBP	1.544.860 HKD	10,06 HKD

Período finalizado el	Clase de acumulación I JPY Valor liquidativo	Clase de acumulación I JPY Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I JPY* Valor liquidativo	Clase de reparto I JPY* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A SGD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A SGD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	16.646.524.176 JPY	1.246,95 JPY	—	—	4.372.113 SGD	14,62 SGD
31 de diciembre de 2023	16.995.177.792 JPY	1.250,95 JPY	1.498.004.233 JPY	998,67 JPY	3.611.052 SGD	14,92 SGD

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto A USD Valor liquidativo	Clase de reparto A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	6.982.677 USD	7,62 USD	35.617.093 USD	14,67 USD	7.835.682 USD	8,22 USD
31 de diciembre de 2023	4.053.791 USD	7,71 USD	34.032.810 USD	14,33 USD	8.347.581 USD	8,23 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I USD Valor liquidativo	Clase de reparto I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	2.493.490 USD	11,31 USD	134.656.440 USD	15,80 USD	175.534.295 USD	8,41 USD
31 de diciembre de 2023	2.836.248 USD	11,10 USD	130.562.204 USD	15,39 USD	190.980.125 USD	8,42 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Short Duration High Yield SDG Engagement (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I2 USD Valor liquidativo	Clase de reparto I2 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I4 USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.462.232 USD	14,83 USD	288.148 USD	8,21 USD	10.962 USD	10,96 USD
31 de diciembre de 2023	1.524.302 USD	14,44 USD	288.566 USD	8,22 USD	2.996.390 USD	10,66 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I5 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto M USD Valor liquidativo	Clase de reparto M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	22.607.791 USD	11,39 USD	2.760.103 USD	11,70 USD	1.098.744 USD	8,08 USD
31 de diciembre de 2023	27.842.101 USD	11,07 USD	3.127.020 USD	11,46 USD	1.580.196 USD	8,17 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	6.118.289 USD	14,39 USD
31 de diciembre de 2023	5.677.635 USD	13,98 USD

Strategic Income

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) A AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) E AUD* Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) E AUD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) Z AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) Z AUD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	162.038.996 AUD	7,80 AUD	7.239.068 AUD	9,93 AUD	149.904.419 AUD	8,55 AUD
31 de diciembre de 2023	63.940.605 AUD	8,07 AUD	—	—	136.796.522 AUD	8,80 AUD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Strategic Income (cont.)

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) A CNY* Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A CNY* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A EUR Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	584.882.756 CNY	96,43 CNY	61.787.901 EUR	7,24 EUR	602.429 EUR	10,61 EUR
31 de diciembre de 2023	95.409.993 CNY	100,06 CNY	37.619.121 EUR	7,50 EUR	389.376 EUR	10,64 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A GBP Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	8.084.425 EUR	11,37 EUR	1.026.473 EUR	10,31 EUR	51.621.858 GBP	7,78 GBP
31 de diciembre de 2023	8.449.161 EUR	11,37 EUR	1.081.589 EUR	10,37 EUR	24.369.502 GBP	8,01 GBP

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) I GBP* Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) I GBP* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A HKD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A HKD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A JPY* Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A JPY* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	6.470.127 GBP	9,97 GBP	2.273.958.254 HKD	8,09 HKD	4.876.183.601 JPY	977,19 JPY
31 de diciembre de 2023	6.640.582 GBP	10,23 GBP	722.673.278 HKD	8,35 HKD	—	—

Período finalizado el	Clase de acumulación I JPY Valor liquidativo	Clase de acumulación I JPY Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I JPY Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I JPY Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto CG I JPY Valor liquidativo	Clase de reparto CG I JPY Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	11.027.950.346 JPY	1.068,29 JPY	5.197.264.559 JPY	2.216,88 JPY	1.025.750.607 JPY	877,85 JPY
31 de diciembre de 2023	11.524.159.611 JPY	1.092,06 JPY	4.519.951.299 JPY	1.926,94 JPY	1.049.838.759 JPY	897,38 JPY

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Strategic Income (cont.)

Período finalizado el	Clase de reparto I JPY Valor liquidativo	Clase de reparto I JPY Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z JPY Valor liquidativo	Clase de acumulación Z JPY Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A SGD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A SGD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	4.092.101 JPY	772,12 JPY	5.510.124.670 JPY	924,66 JPY	251.464.319 SGD	15,34 SGD
31 de diciembre de 2023	4.233.937 JPY	798,89 JPY	5.618.707.917 JPY	942,88 JPY	57.886.443 SGD	15,90 SGD

Período finalizado el	Clase de acumulación A SGD Valor liquidativo	Clase de acumulación A SGD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) I SGD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) I SGD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	23.556.892 SGD	21,66 SGD	13.859.414 SGD	17,18 SGD	562.631.013 USD	8,01 USD
31 de diciembre de 2023	13.802.740 SGD	21,73 SGD	13.508.509 SGD	17,77 SGD	222.806.283 USD	8,23 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto A USD Valor liquidativo	Clase de reparto A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	594.753.018 USD	12,39 USD	23.916.692 USD	9,80 USD	32.632.325 USD	10,72 USD
31 de diciembre de 2023	483.593.209 USD	12,31 USD	23.776.739 USD	9,88 USD	38.055.662 USD	10,71 USD

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) E USD* Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) E USD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I USD Valor liquidativo	Clase de reparto I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	28.745.951 USD	9,95 USD	368.952.850 USD	13,47 USD	83.372.587 USD	9,84 USD
31 de diciembre de 2023	–	–	371.079.167 USD	13,36 USD	66.192.394 USD	9,93 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Strategic Income (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto M USD Valor liquidativo	Clase de reparto M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	122.224.371 USD	12,26 USD	11.006.958 USD	8,38 USD	44.398.407 USD	13,70 USD
31 de diciembre de 2023	111.584.156 USD	12,23 USD	10.651.057 USD	8,54 USD	46.701.595 USD	13,55 USD

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) A ZAR* Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A ZAR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) E ZAR* Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) E ZAR* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	318.723 ZAR	101,39 ZAR	43.800.010 ZAR	99,62 ZAR

Sustainable Asia High Yield

Período finalizado el	Clase de acumulación X EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación X EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación X GBP* Valor liquidativo	Clase de acumulación X GBP* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	—	—	—	—	10.283 USD	7,26 USD
31 de diciembre de 2023	363.946 EUR	8,52 EUR	37.849 GBP	9,47 GBP	19.024 USD	7,07 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	9.025 USD	9,03 USD	11.232 USD	9,17 USD	23.205.054 USD	9,65 USD
31 de diciembre de 2023	8.400 USD	8,40 USD	10.423 USD	8,51 USD	21.484.485 USD	8,93 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Sustainable Asia High Yield (cont.)

Período finalizado el	Clase de reparto Z USD Valor liquidativo	Clase de reparto Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	6.966.091 USD	9,66 USD
31 de diciembre de 2023	6.587.073 USD	9,13 USD

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

Período finalizado el	Clase de acumulación I CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación I CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	21.242.576 CHF	11,57 CHF	73.656 EUR	10,67 EUR	55.552 EUR	12,42 EUR
31 de diciembre de 2023	14.179.749 CHF	11,37 CHF	76.508 EUR	10,41 EUR	321.714 EUR	12,07 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación I3 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I3 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto M EUR Valor liquidativo	Clase de reparto M EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	233.786 EUR	10,65 EUR	554.717 EUR	10,09 EUR	492.088 EUR	6,53 EUR
31 de diciembre de 2023	234.610 EUR	10,33 EUR	544.903 EUR	9,88 EUR	447.000 EUR	6,56 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación X EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación X EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A SEK Valor liquidativo	Clase de acumulación A SEK Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	56.801.855 EUR	11,34 EUR	10.802 GBP	13,73 GBP	2.040.510 SEK	94,10 SEK
31 de diciembre de 2023	44.702.260 EUR	10,99 EUR	10.422 GBP	13,25 GBP	2.108.721 SEK	91,82 SEK

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (cont.)

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	789.418 USD	7,36 USD	5.232.744 USD	13,54 USD	589.946 USD	10,16 USD
31 de diciembre de 2023	689.907 USD	7,40 USD	5.070.217 USD	13,10 USD	667.644 USD	9,88 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I USD Valor liquidativo	Clase de reparto I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	20.328.431 USD	14,78 USD	2.347.570 USD	9,22 USD	535.648 USD	13,39 USD
31 de diciembre de 2023	18.637.882 USD	14,24 USD	2.390.542 USD	9,07 USD	515.679 USD	12,89 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto M USD Valor liquidativo	Clase de reparto M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.020.664 USD	10,25 USD	620.838 USD	7,26 USD
31 de diciembre de 2023	863.972 USD	9,95 USD	692.358 USD	7,24 USD

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency

Período finalizado el	Clase de acumulación I3 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I3 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I4 EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación X EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación X EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	9.078.524 EUR	12,24 EUR	322.242.992 EUR	11,09 EUR	125.734.830 EUR	9,50 EUR
31 de diciembre de 2023	9.353.104 EUR	11,95 EUR	252.654.242 EUR	10,83 EUR	77.767.491 EUR	9,27 EUR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I5 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	9.966 USD	9,97 USD	86.736.574 USD	10,03 USD
31 de diciembre de 2023	9.662 USD	9,66 USD	70.543.444 USD	9,71 USD

Tactical Macro¹

Período finalizado el	Clase de acumulación I5 EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I5 USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	3.065.518 EUR	10,13 EUR	10.406 USD	10,41 USD	733.529 USD	10,45 USD
31 de diciembre de 2023	—	—	10.217 USD	10,22 USD	336.955 USD	10,24 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación Z USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	29.340.798 USD	10,49 USD
31 de diciembre de 2023	26.721.857 USD	10,26 USD

Ultra Short Term Euro Bond

Período finalizado el	Clase de acumulación P CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación P CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación U CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación U CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	821.324 CHF	103,97 CHF	5.338.694 CHF	103,19 CHF	52.236.086 EUR	103,28 EUR
31 de diciembre de 2023	806.151 CHF	102,04 CHF	5.645.975 CHF	101,34 CHF	19.721.648 EUR	100,22 EUR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Ultra Short Term Euro Bond (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	788.358.651 EUR	109,21 EUR	7.471.576 EUR	101,83 EUR	86.906.543 EUR	107,97 EUR
31 de diciembre de 2023	611.815.516 EUR	105,88 EUR	5.218.533 EUR	99,85 EUR	84.236.821 EUR	104,65 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación I5 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación U EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación U EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	193.852.675 EUR	109,76 EUR	37.638.114 EUR	101,90 EUR	21.805.770 EUR	107,18 EUR
31 de diciembre de 2023	179.474.473 EUR	106,36 EUR	8.273.743 EUR	98,98 EUR	10.246.656 EUR	103,96 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación Z EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación Z EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.800.421 EUR	110,59 EUR	1.826.648 USD	109,11 USD	30.514 USD	121,99 USD
31 de diciembre de 2023	2.038.202 EUR	107,11 EUR	2.128.401 USD	104,93 USD	67.391.984 USD	117,20 USD

Uncorrelated Strategies

Período finalizado el	Clase de acumulación I CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación I CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	833.607 CHF	8,64 CHF	3.331.836 EUR	8,59 EUR	5.500.449 EUR	9,06 EUR
31 de diciembre de 2023	1.933.894 CHF	9,07 CHF	6.159.807 EUR	8,94 EUR	9.422.087 EUR	9,40 EUR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
Uncorrelated Strategies (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación I2 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación P EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación P EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	5.514.215 EUR	9,37 EUR	452.861 EUR	8,28 EUR	24.938 EUR	8,51 EUR
31 de diciembre de 2023	7.184.374 EUR	9,72 EUR	658.504 EUR	8,66 EUR	202.696 EUR	8,83 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I2 GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I2 GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	15.939.768 GBP	10,16 GBP	349.495.442 GBP	10,21 GBP	11.648 GBP	8,81 GBP
31 de diciembre de 2023	13.299.187 GBP	10,47 GBP	583.156.807 GBP	10,52 GBP	262.553 GBP	9,07 GBP

Período finalizado el	Clase de acumulación I5 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación P GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación P GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación Z GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	771.664 GBP	10,42 GBP	127.632.301 GBP	9,85 GBP	343.221 GBP	10,72 GBP
31 de diciembre de 2023	33.902.989 GBP	10,72 GBP	349.194.682 GBP	10,15 GBP	459.179 GBP	11,01 GBP

Período finalizado el	Clase de acumulación I JPY Valor liquidativo	Clase de acumulación I JPY Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A SGD* Valor liquidativo	Clase de acumulación A SGD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	3.516.261.754 JPY	838,09 JPY	3.819 SGD	18,58 SGD	23.644.460 USD	9,66 USD
31 de diciembre de 2023	3.729.880.338 JPY	887,86 JPY	8.864 SGD	19,35 SGD	36.187.195 USD	9,98 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Uncorrelated Strategies (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	3.232.425 USD	9,11 USD	157.130.152 USD	10,60 USD	26.475.672 USD	10,66 USD
31 de diciembre de 2023	3.919.547 USD	9,46 USD	190.714.139 USD	10,91 USD	46.326.710 USD	10,97 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I5 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación P USD Valor liquidativo	Clase de acumulación P USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	12.602.460 USD	10,88 USD	3.520.368 USD	9,42 USD	6.397.961 USD	10,32 USD
31 de diciembre de 2023	10.932.246 USD	11,18 USD	5.177.039 USD	9,77 USD	6.768.803 USD	10,62 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	225.881 USD	11,03 USD
31 de diciembre de 2023	10.835.712 USD	11,31 USD

US Equity

Período finalizado el	Clase de acumulación I5 EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I5 EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I5 EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto sin cobertura I5 EUR* Valor liquidativo	Clase de reparto sin cobertura I5 EUR* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	27.881 EUR	9,96 EUR	9.298 EUR	9,97 EUR	9.298 EUR	9,97 EUR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
US Equity (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación sin cobertura X EUR*	Clase de acumulación sin cobertura X EUR*	Clase de reparto sin cobertura I5 GBP*	Clase de reparto sin cobertura I5 GBP*	Clase de acumulación sin cobertura X GBP*	Clase de acumulación sin cobertura X GBP*
	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	110.123 EUR	10,82 EUR	7.879 GBP	10,00 GBP	8.440 GBP	10,74 GBP

Período finalizado el	Clase de acumulación I3 JPY	Clase de acumulación I3 JPY	Clase de acumulación A USD	Clase de acumulación A USD	Clase de acumulación I USD	Clase de acumulación I USD
	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	3.222.915.597 JPY	1.173,36 JPY	18.582.422 USD	21,24 USD	9.565.936 USD	31,75 USD
31 de diciembre de 2023	4.044.133.157 JPY	1.058,06 JPY	4.099.498 USD	18,69 USD	4.648.286 USD	27,83 USD

Período finalizado el	Clase de reparto I USD	Clase de reparto I USD	Clase de acumulación I5 USD*	Clase de acumulación I5 USD*	Clase de reparto I5 USD*	Clase de reparto I5 USD*
	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	7.217.751 USD	31,50 USD	13.848.381 USD	10,57 USD	29.902 USD	9,97 USD
31 de diciembre de 2023	6.328.003 USD	27,62 USD	—	—	—	—

Período finalizado el	Clase de acumulación M USD	Clase de acumulación M USD	Clase de acumulación X USD*	Clase de acumulación X USD*
	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	4.300.492 USD	11,80 USD	10.664 USD	10,66 USD
31 de diciembre de 2023	5.680.856 USD	10,43 USD	—	—

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

US Equity Index PutWrite

Período finalizado el	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I3 EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I3 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I4 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	4.406.236 EUR	14,06 EUR	3.308.635 EUR	10,52 EUR	581.641 EUR	14,07 EUR
31 de diciembre de 2023	4.043.345 EUR	13,19 EUR	5.017.909 EUR	9,95 EUR	583.657 EUR	13,18 EUR

Período finalizado el	Clase de reparto I4 EUR* Valor liquidativo	Clase de reparto I4 EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	29.324 EUR	10,67 EUR	207.993 EUR	12,68 EUR	14.935.079 GBP	16,03 GBP
31 de diciembre de 2023	27.686 EUR	10,07 EUR	307.642 EUR	11,98 EUR	15.677.985 GBP	14,79 GBP

Período finalizado el	Clase de acumulación I3 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I3 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I3 GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I3 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto sin cobertura I3 GBP* Valor liquidativo	Clase de reparto sin cobertura I3 GBP* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	129.474.047 GBP	13,71 GBP	126.089.688 GBP	11,45 GBP	8.840 GBP	11,26 GBP
31 de diciembre de 2023	112.770.545 GBP	12,63 GBP	243.278.811 GBP	10,76 GBP	8.228 GBP	10,48 GBP

Período finalizado el	Clase de acumulación sin cobertura I4 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I4 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I4 GBP* Valor liquidativo	Clase de reparto I4 GBP* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto sin cobertura P GBP Valor liquidativo	Clase de reparto sin cobertura P GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	71.470.236 GBP	16,64 GBP	106.988 GBP	10,91 GBP	5.094.059 GBP	11,18 GBP
31 de diciembre de 2023	56.296.882 GBP	15,33 GBP	443.810 GBP	10,24 GBP	3.959.945 GBP	10,53 GBP

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
US Equity Index PutWrite (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación sin cobertura X GBP* Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura X GBP* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A SGD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A SGD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	61.825.009 GBP	10,54 GBP	3.251.785 SGD	20,89 SGD	17.552.592 USD	16,06 USD
31 de diciembre de 2023	–	–	191.141 SGD	20,38 SGD	13.352.314 USD	14,98 USD

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) I USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I3 USD Valor liquidativo	Clase de reparto I3 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	10.759 USD	12,08 USD	87.667.828 USD	17,00 USD	17.224.628 USD	11,16 USD
31 de diciembre de 2023	10.367 USD	11,64 USD	69.249.366 USD	15,82 USD	24.031.846 USD	10,47 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I4 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	5.640.401 USD	16,54 USD	991.545 USD	14,96 USD	53.173.247 USD	17,35 USD
31 de diciembre de 2023	5.805.985 USD	15,37 USD	1.228.399 USD	14,02 USD	52.893.166 USD	16,10 USD

US Large Cap Value

Período finalizado el	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	573.207 EUR	10,74 EUR	164.764 EUR	10,84 EUR	19.055.902 EUR	9,20 EUR
31 de diciembre de 2023	584.267 EUR	10,25 EUR	234.125 EUR	9,96 EUR	25.517.697 EUR	8,75 EUR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

US Large Cap Value (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación sin cobertura I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto sin cobertura I4 EUR Valor liquidativo	Clase de reparto sin cobertura I4 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I5 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I5 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	183.750.607 EUR	9,69 EUR	313.913 EUR	9,96 EUR	113.341.850 EUR	10,77 EUR
31 de diciembre de 2023	146.699.614 EUR	8,86 EUR	11.657.942 EUR	9,26 EUR	104.079.203 EUR	9,84 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	25.225 GBP	9,98 GBP	498.283 GBP	9,49 GBP	390.673 GBP	9,84 GBP
31 de diciembre de 2023	23.832 GBP	9,43 GBP	462.887 GBP	8,88 GBP	299.756 GBP	9,42 GBP

Período finalizado el	Clase de reparto sin cobertura I GBP Valor liquidativo	Clase de reparto sin cobertura I GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto sin cobertura I4 GBP Valor liquidativo	Clase de reparto sin cobertura I4 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura P GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura P GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	4.704.806 GBP	9,35 GBP	38.103.101 GBP	10,49 GBP	2.067.776 GBP	10,10 GBP
31 de diciembre de 2023	5.459.927 GBP	8,86 GBP	713.712.896 GBP	9,96 GBP	1.510.453 GBP	9,44 GBP

Período finalizado el	Clase de reparto P GBP Valor liquidativo	Clase de reparto P GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura Y GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura Y GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto sin cobertura Y GBP Valor liquidativo	Clase de reparto sin cobertura Y GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	60.219 GBP	10,70 GBP	104.099.419 GBP	10,30 GBP	427.976 GBP	9,94 GBP
31 de diciembre de 2023	27.450 GBP	10,25 GBP	96.933.670 GBP	9,63 GBP	289.665 GBP	9,43 GBP

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
US Large Cap Value (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I4 USD Valor liquidativo	Clase de reparto I4 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	52.890.248 USD	9,69 USD	269.678.811 USD	10,61 USD	3.939.555 USD	9,72 USD
31 de diciembre de 2023	64.226.695 USD	9,18 USD	348.767.232 USD	10,01 USD	42.162.635 USD	9,31 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I5 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Y USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación Y USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	29.853 USD	10,02 USD	17.615.682 USD	9,42 USD	114.450.579 USD	10,49 USD
31 de diciembre de 2023	42.443 USD	9,43 USD	21.629.855 USD	8,95 USD	99.162.277 USD	9,89 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	213.799 USD	10,54 USD
31 de diciembre de 2023	200.943 USD	9,90 USD

US Long Short Equity

Período finalizado el	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I3 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I3 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	262.698 EUR	11,58 EUR	29.574.256 EUR	12,67 EUR	40.977.589 EUR	11,98 EUR
31 de diciembre de 2023	260.420 EUR	11,44 EUR	32.376.271 EUR	12,46 EUR	35.415.422 EUR	11,75 EUR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

US Long Short Equity (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación sin cobertura I3 EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I3 EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I3 GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I3 GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	9.338 EUR	10,00 EUR	2.439.838 EUR	11,23 EUR	2.236.024 GBP	11,52 GBP
31 de diciembre de 2023	—	—	2.749.134 EUR	11,14 EUR	1.560.470 GBP	11,34 GBP

Período finalizado el	Clase de acumulación A1 SGD Valor liquidativo	Clase de acumulación A1 SGD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A (PF) USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A (PF) USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	137.404 SGD	27,23 SGD	1.551.958 USD	13,42 USD	16.725.417 USD	13,60 USD
31 de diciembre de 2023	175.595 SGD	26,86 SGD	1.596.521 USD	13,16 USD	15.728.474 USD	13,33 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación A1 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A1 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I (PF) USD Valor liquidativo	Clase de reparto I (PF) USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	11.835.882 USD	14,57 USD	33.806.147 USD	14,13 USD	27.757.050 USD	15,68 USD
31 de diciembre de 2023	13.821.003 USD	14,24 USD	35.630.199 USD	13,83 USD	31.634.246 USD	15,29 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I3 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I3 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación U USD Valor liquidativo	Clase de acumulación U USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	15.324.632 USD	12,86 USD	1.099.067 USD	12,44 USD	1.267.486 USD	14,31 USD
31 de diciembre de 2023	11.481.908 USD	12,51 USD	951.613 USD	12,24 USD	1.239.097 USD	13,99 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
US Long Short Equity (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	6.101.479 USD	17,68 USD
31 de diciembre de 2023	3.442.847 USD	17,13 USD

US Multi Cap Opportunities

Período finalizado el	Clase de acumulación E AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación E AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación T AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación T AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I3 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I3 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.469.396 AUD	19,95 AUD	1.594.416 AUD	19,01 AUD	2.413.351 EUR	28,68 EUR
31 de diciembre de 2023	1.190.855 AUD	18,33 AUD	2.064.476 AUD	17,38 AUD	2.192.792 EUR	26,06 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A EUR1 Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR1 Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I EUR1 Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR1 Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	478.182 EUR	19,60 EUR	1.914.833 EUR	31,36 EUR	2.346.706 EUR	34,64 EUR
31 de diciembre de 2023	485.467 EUR	18,00 EUR	2.025.069 EUR	28,67 EUR	3.590.284 EUR	31,53 EUR

Período finalizado el	Clase de reparto I3 GBP* Valor liquidativo	Clase de reparto I3 GBP* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto sin cobertura I3 GBP Valor liquidativo	Clase de reparto sin cobertura I3 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A SGD Valor liquidativo	Clase de acumulación A SGD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	23.589 GBP	9,97 GBP	21.741 GBP	20,41 GBP	36.896.443 SGD	53,26 SGD
31 de diciembre de 2023	—	—	19.454 GBP	18,26 GBP	30.545.781 SGD	48,71 SGD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

US Multi Cap Opportunities (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación B USD Valor liquidativo	Clase de acumulación B USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación C2 USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación C2 USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	9.636.730 USD	22,62 USD	1.976.138 USD	17,34 USD	—	—
31 de diciembre de 2023	11.529.828 USD	20,61 USD	1.857.404 USD	15,79 USD	11.020 USD	20,62 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación E USD Valor liquidativo	Clase de acumulación E USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I2 USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 USD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I3 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I3 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	7.207.665 USD	21,29 USD	12.423 USD	12,42 USD	24.609.899 USD	34,38 USD
31 de diciembre de 2023	12.497.526 USD	19,40 USD	11.201 USD	11,20 USD	20.516.313 USD	30,97 USD

Período finalizado el	Clase de reparto I3 USD* Valor liquidativo	Clase de reparto I3 USD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación T USD Valor liquidativo	Clase de acumulación T USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	—	—	8.986.210 USD	24,12 USD	17.744.042 USD	25,16 USD
31 de diciembre de 2023	5.968.476 USD	27,71 USD	7.990.996 USD	21,97 USD	20.597.988 USD	22,81 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación U USD Valor liquidativo	Clase de acumulación U USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD1 Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD1 Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	53.053.029 USD	34,89 USD	351.101 USD	29,23 USD	62.205.196 USD	37,77 USD
31 de diciembre de 2023	51.624.971 USD	31,54 USD	315.494 USD	26,27 USD	61.309.908 USD	34,23 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
US Multi Cap Opportunities (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación I USD1 Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD1 Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I USD1 Valor liquidativo	Clase de reparto I USD1 Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación B ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación B ZAR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	107.698.269 USD	42,81 USD	6.745.699 USD	41,30 USD	21.433.274 ZAR	341,62 ZAR
31 de diciembre de 2023	157.972.113 USD	38,63 USD	6.535.567 USD	37,27 USD	33.968.071 ZAR	306,92 ZAR

Período finalizado el	Clase de acumulación C2 ZAR* Valor liquidativo	Clase de acumulación C2 ZAR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación E ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación E ZAR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación T ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación T ZAR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	–	–	26.716.535 ZAR	314,61 ZAR	55.729.705 ZAR	379,60 ZAR
31 de diciembre de 2023	52.951 ZAR	305,28 ZAR	40.553.464 ZAR	282,64 ZAR	62.068.144 ZAR	339,34 ZAR

US Real Estate Securities

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) A AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) B AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) B AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación B AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación B AUD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	2.923.619 AUD	7,77 AUD	2.269.310 AUD	7,06 AUD	1.068.819 AUD	11,18 AUD
31 de diciembre de 2023	3.363.584 AUD	8,36 AUD	2.517.096 AUD	7,64 AUD	1.491.037 AUD	11,86 AUD

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) E AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) E AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación E AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación E AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) T AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) T AUD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.538.969 AUD	7,05 AUD	1.474.577 AUD	12,09 AUD	3.604.482 AUD	8,32 AUD
31 de diciembre de 2023	1.664.244 AUD	7,63 AUD	684.626 AUD	12,83 AUD	4.085.229 AUD	8,96 AUD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

US Real Estate Securities (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación T AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación T AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación A CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	4.015.502 AUD	14,53 AUD	1.195.655 CHF	13,10 CHF	942.826 EUR	8,10 EUR
31 de diciembre de 2023	4.675.218 AUD	15,33 AUD	1.432.392 CHF	13,99 CHF	942.080 EUR	8,54 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A HKD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A HKD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	2.752.921 EUR	18,08 EUR	510.870 EUR	10,77 EUR	33.082.161 HKD	8,59 HKD
31 de diciembre de 2023	9.589.385 EUR	19,01 EUR	553.935 EUR	11,42 EUR	41.922.187 HKD	9,20 HKD

Período finalizado el	Clase de acumulación A SGD Valor liquidativo	Clase de acumulación A SGD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	588.324 SGD	28,63 SGD	22.175.240 USD	10,03 USD	142.768.954 USD	23,02 USD
31 de diciembre de 2023	841.397 SGD	30,21 SGD	26.897.176 USD	10,69 USD	184.962.493 USD	24,05 USD

Período finalizado el	Clase de reparto A USD Valor liquidativo	Clase de reparto A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) B USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) B USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación B USD Valor liquidativo	Clase de acumulación B USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	12.070.592 USD	16,31 USD	15.725.664 USD	8,19 USD	8.990.324 USD	13,88 USD
31 de diciembre de 2023	13.581.267 USD	17,15 USD	18.281.128 USD	8,79 USD	10.818.583 USD	14,60 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
US Real Estate Securities (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) E USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) E USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación E USD Valor liquidativo	Clase de acumulación E USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	9.650.576 USD	11,64 USD	6.484.409 USD	8,19 USD	6.424.914 USD	13,17 USD
31 de diciembre de 2023	11.437.427 USD	12,22 USD	7.924.348 USD	8,79 USD	7.630.425 USD	13,85 USD

Período finalizado el	Clase de reparto (mensual) I USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I USD Valor liquidativo	Clase de reparto I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	197.320 USD	8,69 USD	81.232.513 USD	26,28 USD	4.503.715 USD	14,98 USD
31 de diciembre de 2023	214.529 USD	9,22 USD	109.751.203 USD	27,36 USD	8.362.345 USD	15,75 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) T USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) T USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	17.043.342 USD	19,38 USD	31.428.338 USD	13,57 USD	11.174.245 USD	9,57 USD
31 de diciembre de 2023	17.723.091 USD	20,15 USD	35.815.499 USD	14,25 USD	11.734.470 USD	10,21 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación T USD Valor liquidativo	Clase de acumulación T USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) B ZAR Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) B ZAR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	15.615.858 USD	15,46 USD	1.611.101 USD	15,43 USD	69.339.296 ZAR	74,34 ZAR
31 de diciembre de 2023	17.063.493 USD	16,18 USD	1.163.860 USD	16,00 USD	80.144.798 ZAR	80,01 ZAR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

US Real Estate Securities (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación B ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación B ZAR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación C2 ZAR* Valor liquidativo	Clase de acumulación C2 ZAR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) E ZAR Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) E ZAR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	16.443.512 ZAR	173,09 ZAR	–	–	40.663.529 ZAR	74,34 ZAR
31 de diciembre de 2023	22.512.585 ZAR	179,65 ZAR	315.043 ZAR	177,41 ZAR	41.472.352 ZAR	80,02 ZAR

Período finalizado el	Clase de acumulación E ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación E ZAR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) T ZAR Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) T ZAR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación T ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación T ZAR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	16.132.062 ZAR	193,65 ZAR	114.581.706 ZAR	116,12 ZAR	37.424.752 ZAR	241,54 ZAR
31 de diciembre de 2023	27.239.513 ZAR	200,99 ZAR	97.954.018 ZAR	124,36 ZAR	40.917.501 ZAR	249,46 ZAR

US Small Cap

Período finalizado el	Clase de acumulación B AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación B AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación C2 AUD* Valor liquidativo	Clase de acumulación C2 AUD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación E AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación E AUD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.616.509 AUD	12,10 AUD	–	–	1.055.229 AUD	16,93 AUD
31 de diciembre de 2023	1.742.449 AUD	11,99 AUD	11.823 AUD	11,70 AUD	2.052.624 AUD	16,78 AUD

Período finalizado el	Clase de acumulación T AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación T AUD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura A EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	2.564.335 AUD	15,87 AUD	1.024.774 EUR	17,29 EUR	421.206 EUR	14,72 EUR
31 de diciembre de 2023	1.621.168 AUD	15,66 AUD	1.411.931 EUR	17,04 EUR	368.951 EUR	13,95 EUR

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024
9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)
US Small Cap (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I2 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I2 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.870.904 EUR	20,71 EUR	12.069.076 EUR	19,32 EUR	9.499.823 EUR	18,06 EUR
31 de diciembre de 2023	7.003.214 EUR	20,33 EUR	4.743.299 EUR	18,23 EUR	8.827.680 EUR	17,02 EUR

Período finalizado el	Clase de acumulación sin cobertura I4 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I4 EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación Z EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	33.430.473 EUR	11,70 EUR	456.250 EUR	17,26 EUR	496.954 EUR	19,84 EUR
31 de diciembre de 2023	49.451.043 EUR	11,02 EUR	359.461 EUR	17,10 EUR	373.669 EUR	19,39 EUR

Período finalizado el	Clase de reparto sin cobertura I JPY Valor liquidativo	Clase de reparto sin cobertura I JPY Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto A USD Valor liquidativo	Clase de reparto A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	4.117.289.217 JPY	6,97 JPY	113.843.453 USD	28,57 USD	11.906.187 USD	18,45 USD
31 de diciembre de 2023	4.420.253.539 JPY	5,94 JPY	102.356.393 USD	27,90 USD	11.394.615 USD	18,01 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación B USD Valor liquidativo	Clase de acumulación B USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación C2 USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación C2 USD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación E USD Valor liquidativo	Clase de acumulación E USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	5.697.017 USD	20,85 USD	–	–	5.532.624 USD	18,39 USD
31 de diciembre de 2023	9.816.052 USD	20,47 USD	3.134 USD	20,50 USD	4.842.626 USD	18,05 USD

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

US Small Cap (cont.)

Período finalizado el	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I USD Valor liquidativo	Clase de reparto I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I3 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I3 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	269.400.837 USD	32,05 USD	23.451.801 USD	23,32 USD	62.056.137 USD	16.112,27 USD
31 de diciembre de 2023	235.603.429 USD	31,17 USD	23.788.319 USD	22,68 USD	116.444.993 USD	15.647,89 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación T USD Valor liquidativo	Clase de acumulación T USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	9.492.094 USD	21,03 USD	7.017.572 USD	23,26 USD	1.838.464 USD	22,00 USD
31 de diciembre de 2023	4.726.621 USD	20,63 USD	7.744.749 USD	22,73 USD	1.801.567 USD	21,30 USD

Período finalizado el	Clase de acumulación E ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación E ZAR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación T ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación T ZAR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	6.080.334 ZAR	269,94 ZAR	16.805.002 ZAR	228,71 ZAR
31 de diciembre de 2023	8.580.171 ZAR	261,62 ZAR	16.439.253 ZAR	220,56 ZAR

US Small Cap Intrinsic Value

Período finalizado el	Clase de acumulación I3 EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación I3 EUR* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura I2 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I2 GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	1.012.855 EUR	10,45 EUR	89.236.435 GBP	11,12 GBP	19.510.918 GBP	10,33 GBP
31 de diciembre de 2023	-	-	76.995.502 GBP	10,82 GBP	18.429.244 GBP	10,05 GBP

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

US Small Cap Intrinsic Value (cont.)

	Clase de acumulación sin cobertura I3 JPY*	Clase de acumulación sin cobertura I3 JPY*	Clase de acumulación A USD	Clase de acumulación A USD	Clase de acumulación I USD	Clase de acumulación I USD
Período finalizado el	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	728.583.423 JPY	1.178,71 JPY	9.135.831 USD	21,95 USD	108.642.011 USD	19,54 USD
31 de diciembre de 2023	641.072.643 JPY	1.012,53 JPY	9.039.299 USD	21,63 USD	116.918.013 USD	19,18 USD

	Clase de acumulación I2 USD	Clase de acumulación I2 USD	Clase de acumulación M USD	Clase de acumulación M USD
Período finalizado el	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción	Valor liquidativo	Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2024	71.291.843 USD	9,85 USD	1.338.981 USD	17,96 USD
31 de diciembre de 2023	68.837.919 USD	9,66 USD	415.451 USD	17,79 USD

* Clase de Acciones lanzada y/o cerrada durante el actual ejercicio contable o el ejercicio anterior.

¹ Cartera lanzada durante el ejercicio contable anterior.

Todos los importes de Patrimonio neto y el Valor liquidativo por acción señalados son los utilizados en las operaciones de los accionistas.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS

Valor razonable de las inversiones

La norma de información financiera (FRS) 102, apartado 11.27 sobre «Valor razonable: Información» exige que se informe sobre la jerarquía de valor razonable en la que se clasifican las mediciones del valor razonable para el activo y el pasivo. La información se basa en una jerarquía de valor razonable de tres niveles para los datos empleados en técnicas de valoración para la medición del valor razonable.

La Sociedad ha clasificado las valoraciones al valor razonable utilizando una jerarquía que refleja la importancia de las variables utilizadas para realizar dichas valoraciones. A continuación se detallan los tres niveles de la jerarquía del valor razonable en virtud de la FRS 102:

Nivel 1 — Precios cotizados sin ajustar en mercados activos que se encuentren disponibles en la fecha de medición para activos o pasivos no restringidos idénticos.

Nivel 2 — Datos distintos de los precios cotizados incluidos en el Nivel 1 que sean observables para el activo o pasivo, ya sea de forma directa (como los precios) o indirecta (derivados de los precios);

Nivel 3 — Datos del activo o pasivo que no se basen en datos de mercado observables (datos no observables). Las variables de precios se califican como no observables para la inversión e incluyen situaciones en las que hay poca actividad de mercado, o ninguna, para el instrumento. Los datos utilizados en el cálculo del valor razonable obligan a la dirección de la Sociedad a aplicar de forma significativa sus propios criterios o estimaciones. Dado que para estos valores no están disponibles precios observables, las Carteras habrían utilizado, en su caso, técnicas de valoración para determinar el valor razonable.

El nivel en la jerarquía del valor razonable en el que clasifica la valoración del valor razonable en su conjunto viene determinado por los datos del nivel inferior que sean significativos para la valoración al valor razonable en su conjunto. A tal fin, el carácter significativo de un dato se valora comparándolo con la valoración al valor razonable en su totalidad. Por ejemplo, si una valoración al valor razonable utiliza datos observables que requieran ajustes significativos basados en datos no observables, dicha valoración será de Nivel 3.

Para evaluar la importancia de un dato en particular para la valoración del valor razonable en su totalidad, es necesario adoptar criterios que tengan en cuenta los factores específicos del activo o el pasivo.

El comité de valoración de la Gestora debe aplicar su criterio para determinar lo que se considera «observable».

El valor de las inversiones de las Carteras en valores de renta variable, fondos cotizados, y opciones cotizadas adquiridas y suscritas para los que existen cotizaciones de mercado disponibles de forma inmediata, por lo general se determina obteniendo las valoraciones de servicios independientes de fijación de precios basados en el último precio de venta cotizado en una bolsa o mercado principal para dicho valor (datos de Nivel 1). Los valores que se negocian principalmente en el NASDAQ suelen valorarse al precio oficial al cierre del NASDAQ («NOCP», por sus siglas en inglés), que este ofrece en cada día hábil. El NOCP es el primer precio notificado, a las 4:00:02 de la tarde, horario del este de América del Norte, salvo que ese precio esté fuera del rango de los precios de oferta y demanda «internos» (es decir, los precios de oferta y demanda que cotizan los intermediarios entre sí al operar con sus propias cuentas); en ese caso, el NASDAQ ajustará el precio para igualarlo con el precio de oferta o demanda interno (el que sea más próximo). Debido a los retrasos en la notificación de las operaciones, puede que el NOCP no se base en el precio de la última operación que se produzca antes del cierre del mercado. Si en un día concreto no se produce ninguna venta de un valor, los servicios independientes de fijación de precios podrán valorarlo con arreglo a las cotizaciones del mercado.

El valor de las *participatory notes* se determina obteniendo las valoraciones de servicios independientes de fijación de precios basadas en el título de renta variable subyacente y el tipo de cambio aplicable (datos de Nivel 1).

El valor de las inversiones de las Carteras en títulos de deuda se determina principalmente obteniendo valoraciones de servicios independientes de fijación de precios basadas en el precio comprador disponible de forma inmediata o, en caso de que los precios no estén disponibles de forma inmediata, por métodos que incluyen varias consideraciones basadas en el tipo de valor (por lo general datos de Nivel 2). Si existe más de una cotización disponible, el valor se clasifica como de Nivel 2. Además de considerar las rentabilidades o los precios de títulos con calidad, cupón, vencimiento y tipo similares, las indicaciones relativas a los valores de los intermediarios y las condiciones generales del mercado, la siguiente es una descripción de otros datos de Nivel 2 y técnicas de valoración asociadas que emplean los servicios independientes de fijación de precios para valorar determinados tipos de títulos de deuda incluidos en las Carteras:

Bonos de empresa. Por lo general los datos empleados para valorar los títulos de deuda corporativa incluyen información crediticia relevante, movimientos observados en el mercado, noticias del sector, la curva de tipos del Tesoro estadounidense o la correspondiente curva de tipos de referencia, así como otra información de mercado, que puede incluir curvas de tipos de referencia, operaciones registradas, cotizaciones de intermediarios y operadores, diferenciales de emisores, títulos similares y datos de referencia, como publicaciones de análisis de mercado, cuando estén disponibles («Otra información de mercado»).

Bonos convertibles. Los datos empleados para valorar los bonos convertibles (incluyendo CoCos) suelen incluir datos de valores subyacentes, primas de conversión, precios de bonos cotizados y acciones preferentes y Otra información de mercado cuando esté disponible, como por ejemplo, curvas de tipos de referencia, datos de ejecución de operaciones y análisis de sensibilidad.

Obligaciones del Tesoro de EE. UU. Los datos empleados para valorar los títulos del Tesoro de EE. UU. suelen incluir cotizaciones de diversos *inter-dealer brokers* y Otra información de mercado.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Valores de agencias gubernamentales de EE. UU. Los datos empleados para valorar los valores de agencias gubernamentales de EE. UU. suelen incluir cotizaciones de referencia y Otra información de mercado.

Valores respaldados por activos y valores respaldados por hipotecas. Los datos utilizados para valorar valores respaldados por activos y valores respaldados por hipotecas por lo general incluyen modelos que tienen en cuenta una serie de factores, entre los que pueden incluirse: rapidez de pago anticipado, flujos de efectivo, ajustes de diferenciales y otra información de mercado.

Obligaciones de préstamos garantizados (CLO): El valor de las obligaciones de préstamos garantizados se determina principalmente a partir de los datos de flujos de caja, los datos de precios de los préstamos en cuestión e información que no está a disposición del público en general, así como del análisis de los participantes del mercado y las mesas de negociación (datos de Nivel 2 o 3).

Valores de alta rentabilidad. Los datos empleados para valorar los títulos de alta rentabilidad por lo general incluyen una serie de observaciones sobre la renta variable y las curvas de permutas de riesgo de crédito relacionadas con el emisor y Otra información de mercado.

Deuda de mercados emergentes y títulos de deuda pública extranjera. Los datos empleados para valorar la deuda de mercados emergentes y los títulos de deuda pública extranjera por lo general incluyen cotizaciones de operadores, actividad de los mercados de renta fija, modelos de flujos de caja descontados y otra información relevante, como los diferenciales de crédito, curvas de tipos de referencia y Otra información de mercado.

El valor de los préstamos a plazo se determina principalmente obteniendo valoraciones de servicios independientes de fijación de precios basados en las cotizaciones de los intermediarios (generalmente datos de Nivel 2 o Nivel 3, en función del número de cotizaciones disponibles).

El valor de los contratos de futuros se determina obteniendo las valoraciones de servicios independientes de fijación de precios al precio de liquidación al cierre del mercado (datos de Nivel 1).

El valor de los contratos de divisas a plazo se determina obteniendo valoraciones de servicios independientes de fijación de precios basados en tipos de cambio reales negociados en redes de servicios independientes de fijación de precios, además de otros tipos de cambio negociados y cotizados ofrecidos por participantes destacados del mercado a los servicios de fijación de precios (datos de Nivel 2).

El valor de los *credit default swaps* se determina obteniendo las valoraciones de servicios independientes de fijación de precios empleando un modelo que tiene en cuenta una serie de factores, como por ejemplo, las probabilidades de impago, las curvas del mercado de crédito, las tasas de recuperación y los flujos de caja (datos de Nivel 2 o 3).

El valor de los *swaps* de inflación se determina principalmente obteniendo valoraciones de servicios independientes de fijación de precios basados en referencias a los tipos de inflación subyacentes, que incluyen la tasa de inflación futura prevista y el correspondiente tipo de oferta interbancaria a plazo para obtener el precio diario. El valor actual se calcula a partir de los flujos de caja previstos basados en los parámetros del *swap*, además de la referencia a la curva de inflación futura subyacente y el tipo de referencia (datos de Nivel 2).

El valor de los *swaps* de tipos de interés se determina principalmente obteniendo valoraciones de servicios independientes de fijación de precios basados en referencias a los tipos subyacentes que incluyen el tipo de las permutas de índices a un día locales y el correspondiente tipo de oferta interbancaria a plazo para obtener el precio diario. El valor actual se calcula a partir de los flujos de caja previstos basados en los parámetros del *swap*, además de la referencia a la curva de tipos subyacentes y el tipo de referencia (datos de Nivel 2).

El valor de los *swaps* de rentabilidad total se determina obteniendo las valoraciones de servicios independientes de fijación de precios que emplean el activo subyacente y el tipo de interés de referencia indicado (datos de Nivel 2).

El valor actual de los *swaps* multidivisas se determina obteniendo las valoraciones de servicios independientes de fijación de precios basadas en el valor actual de los flujos de caja previstos en función de parámetros del *swap*, junto con una referencia a la curva de tipos subyacentes y el tipo de referencia (datos de Nivel 2).

El valor de los *swaps* de volatilidad se determina principalmente obteniendo las valoraciones de servicios independientes de fijación de precios y se basa en un nivel de volatilidad predeterminado comparado con el nivel de volatilidad real materializado del activo de referencia durante el período (datos de Nivel 2 o 3).

El valor de los *swaps* de varianza se determina principalmente obteniendo las valoraciones de servicios independientes de fijación de precios y se basa en los datos de varianza tanto históricos materializados como futuros previstos (o varianza razonable) del activo de referencia (datos de Nivel 2 o 3).

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

El valor de los *swaps* de correlación se determina principalmente obteniendo las valoraciones de servicios independientes de fijación de precios y se basa en la diferencia entre la correlación materializada y un valor de correlación preestablecido (datos de Nivel 2 o 3).

El valor de los *swaptions* se determina obteniendo las valoraciones de servicios independientes de fijación de precios o fuentes de precios de la contraparte (datos de Nivel 2).

Los contratos de opciones que se negocian en mercados OTC generalmente se valoran a partir de cotizaciones facilitados por *broker dealers* o precios suministrados por servicios independientes de fijación de precios que utilizan una serie de técnicas, entre ellas, modelos de fijación de precios simulados y/o ajuste de curva (*bootstrapping*), que ayuda a determinar el valor actual de los contratos. Los modelos de precios utilizan los datos observados de mercados cuyas cotizaciones se determinan de forma activa, como datos de emisor, índices, diferenciales, tipos de interés, curvas de tipos, curvas del mercado de crédito, superficies de volatilidad y tipos de cambio (datos de Nivel 2).

Los certificados de depósito se valoran al coste amortizado (datos de Nivel 2).

Los acuerdos de recompra son valorados por servicios de fijación de precios al valor nominal (datos de Nivel 2).

La Gestora ha designado un comité de valoración que supervisa a los proveedores de servicios independientes de fijación de precios para todos los tipos de valores pertinentes.

Las inversiones en fondos de inversión no cotizados se valoran empleando el valor liquidativo de la acción (el «Valor liquidativo») diario del fondo respectivo (datos de Nivel 2 o 3).

Si no hubiese una valoración disponible de un servicio independiente de fijación de precios o si la Gestora tuviese motivos para pensar que la valoración obtenida no representa el importe que podría esperar recibir una Cartera de forma razonable de una venta actual en una transacción ordenada, la Gestora tratará de obtener cotizaciones de los intermediarios o agentes (en general se consideran datos de Nivel 2 o de Nivel 3 en función del número de cotizaciones disponibles). Si estas cotizaciones no están disponibles, el título se valorará empleando los métodos que haya aprobado el Consejo de Administración considerando de buena fe que la valoración resultante reflejará el valor razonable del título.

Los datos y los supuestos considerados para determinar el valor razonable de un título con arreglo a los datos de Nivel 2 o Nivel 3 pueden incluir, entre otros, el tipo de título; el coste inicial de este; la existencia de cualesquiera restricciones contractuales relativas a la disposición del título; el precio y el alcance de la negociación pública de títulos similares del emisor o de empresas comparables; las cotizaciones o precios evaluados de intermediarios y operadores o servicios de fijación de precios; información obtenida del emisor o de analistas; un análisis de las cuentas de la empresa o el emisor; una evaluación de los datos que influyen en el emisor y el mercado o mercados en los que se compra y vende el título.

El valor de las inversiones de las Carteras en divisas por lo general se determina mediante los mismos datos y métodos de valoración que otras inversiones de la Cartera, como se ha indicado previamente. Los precios de títulos extranjeros expresados en valores en la moneda local por lo general se convierten de esta moneda al dólar estadounidense empleando los tipos de cambio de las 4:00 de la tarde, horario del este de América del Norte en los días en los que la bolsa de Nueva York («NYSE») abra para el desarrollo de su actividad habitual. El Consejo de Administración ha aprobado el uso de ICE Data Pricing & Reference Data LLC («ICE») para ayudar a determinar el valor razonable de los valores de renta variable extranjeros cuando los cambios en el valor de determinado índice sugieran que puede que los precios al cierre en los mercados extranjeros ya no representen el importe que podría esperar recibir una Cartera por esos valores, o bien durante días en los que los mercados extranjeros estén cerrados y los mercados norteamericanos estén abiertos. En cada uno de estos supuestos, ICE aportará precios ajustados para determinados valores de renta variable extranjeros haciendo un análisis estadístico de correlaciones históricas de múltiples factores (datos de Nivel 2). El Consejo de Administración ha aprobado recurrir a ICE para evaluar los precios de los títulos de deuda extranjeros en el momento en el que se calcula el precio de las acciones de una Cartera. ICE emplea curvas de tipos y diferenciales de referencia y evalúa la actividad del mercado disponible desde el cierre local hasta la hora en la que se calcula el precio de las acciones de una Cartera (datos de Nivel 2) para ayudar a determinar los precios de determinados títulos de deuda extranjera.

En el caso de la renta variable extranjera y los títulos de deuda extranjeros, cuando no se disponga de información precisa sobre los valores de mercado de estos títulos extranjeros en el momento en el que se calcula el precio de las acciones de una Cartera, con arreglo a los datos disponibles, el Consejo de Administración ha decidido que es probable que los precios ajustados o evaluados de este modo se aproximen más a los precios que podría obtener una Cartera de una venta actual que los precios de dichos valores determinados al cierre de los mercados extranjeros en los que se negocian principalmente estos valores.

Los precios al valor razonable constituyen necesariamente estimaciones, y no existen garantías de que dicho precio será el siguiente al que cotice o se negocie el valor, ni de que se aproxime a él.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

En los cuadros siguientes se muestran las inversiones financieras conforme a los niveles de la jerarquía del valor razonable.

5G Connectivity

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	760.063.158	372.929.608	—	1.132.992.766
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	1.388.296	—	1.388.296
Activos totales	760.063.158	374.317.904	—	1.134.381.062
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	(607.196)	—	(607.196)
Pasivos totales	—	(607.196)	—	(607.196)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	963.698.691	26.816.617	—	990.515.308
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	6.342.222	—	6.342.222
Activos totales	963.698.691	33.158.839	—	996.857.530
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	(1.033.321)	—	(1.033.321)
Pasivos totales	—	(1.033.321)	—	(1.033.321)

Absolute Return Multi Strategy*

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	—	—	0	0
Activos totales	—	—	0	0

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Absolute Return Multi Strategy* (cont.)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	–	–	6.311	6.311
Activos totales	–	–	6.311	6.311

* La Cartera se liquidó el 20 de diciembre de 2021.

China A-Share Equity

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 CNY	Nivel 2 CNY	Nivel 3 CNY	Total CNY
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	14.032.190	–	–	14.032.190
Activos totales	14.032.190	–	–	14.032.190

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 CNY	Nivel 2 CNY	Nivel 3 CNY	Total CNY
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	13.480.937	–	–	13.480.937
Activos totales	13.480.937	–	–	13.480.937

China Bond

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 CNY	Nivel 2 CNY	Nivel 3 CNY	Total CNY
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	87.906.550	–	87.906.550
Bonos del Estado	–	85.105.784	–	85.105.784
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	977.052	–	977.052
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	103.182	–	–	103.182
Activos totales	103.182	173.989.386	–	174.092.568
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.118.018)	–	(1.118.018)
Pasivos totales	–	(1.118.018)	–	(1.118.018)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)**Valor razonable de las inversiones (cont.)****China Bond (cont.)**

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 CNY	Nivel 2 CNY	Nivel 3 CNY	Total CNY
Activos financieros mantenidos para negociación				
Certificado de depósito	–	58.557.000	–	58.557.000
Bonos de empresa	–	290.154.114	–	290.154.114
Bonos del Estado	–	95.858.682	–	95.858.682
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.943.751	–	1.943.751
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	603.582	–	–	603.582
Activos totales	603.582	446.513.547	–	447.117.129
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(2.361.945)	–	(2.361.945)
Pasivos totales	–	(2.361.945)	–	(2.361.945)

China Equity

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	9.676.901	124.349.625	–	134.026.526
<i>Participatory notes</i>	251.043	–	–	251.043
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	29.163	–	29.163
Activos totales	9.927.944	124.378.788	–	134.306.732
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(23.531)	–	(23.531)
Pasivos totales	–	(23.531)	–	(23.531)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	171.916.351	–	–	171.916.351
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	547.220	–	547.220
Activos totales	171.916.351	547.220	–	172.463.571

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

China Equity (cont.)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(423.344)	–	(423.344)
Pasivos totales	–	(423.344)	–	(423.344)

Climate Innovation¹

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	1.835.616	1.203.363	–	3.038.979
Activos totales	1.835.616	1.203.363	–	3.038.979

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	2.603.137	228.261	–	2.831.398
Activos totales	2.603.137	228.261	–	2.831.398

CLO Income

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Tesoro	–	19.970.852	–	19.970.852
Valores respaldados por activos	–	412.812.366	–	412.812.366
Acuerdos de recompra	–	34.500.000	–	34.500.000
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.424.925	–	1.424.925
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de rentabilidad total	–	60.784	–	60.784
Activos totales	–	468.768.927	–	468.768.927
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(378.552)	–	(378.552)
Pasivos totales	–	(378.552)	–	(378.552)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

CLO Income (cont.)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Tesoro	–	4.994.906	–	4.994.906
Valores respaldados por activos	–	159.687.075	–	159.687.075
Fondos de inversión	12.221.060	–	–	12.221.060
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	2.345.289	–	2.345.289
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de rentabilidad total	–	48.732	–	48.732
Activos totales	12.221.060	167.076.002	–	179.297.062
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(2.570.754)	–	(2.570.754)
Pasivos totales	–	(2.570.754)	–	(2.570.754)

Commodities

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Tesoro	–	50.576.735	–	50.576.735
Bonos de empresa	–	93.020.604	–	93.020.604
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	631.569	–	631.569
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de rentabilidad total	–	68	–	68
Activos totales	–	144.228.976	–	144.228.976
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(66.805)	–	(66.805)
Pasivos totales	–	(66.805)	–	(66.805)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)**Valor razonable de las inversiones (cont.)****Commodities (cont.)**

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Tesoro	–	43.941.161	–	43.941.161
Bonos de empresa	–	77.031.796	–	77.031.796
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.573.388	–	1.573.388
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de rentabilidad total	–	0	–	0
Activos totales	–	122.546.345	–	122.546.345
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(210.126)	–	(210.126)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de rentabilidad total	–	(0)	–	(0)
Pasivos totales	–	(210.126)	–	(210.126)

Corporate Hybrid Bond

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	1.922.526.236	–	1.922.526.236
Fondos de inversión	–	11.426.172	–	11.426.172
Acuerdos de recompra	–	29.391.183	–	29.391.183
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.823.370	–	1.823.370
Activos totales	–	1.965.166.961	–	1.965.166.961
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(5.662.368)	–	(5.662.368)
Pasivos totales	–	(5.662.368)	–	(5.662.368)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)**Valor razonable de las inversiones (cont.)****Corporate Hybrid Bond (cont.)**

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	1.743.583.625	–	1.743.583.625
Fondos de inversión	–	10.956.412	–	10.956.412
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	12.101.176	–	12.101.176
Activos totales	–	1.766.641.213	–	1.766.641.213
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(7.732.130)	–	(7.732.130)
Pasivos totales	–	(7.732.130)	–	(7.732.130)

Developed Market FMP – 2027¹

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	125.996.491	–	125.996.491
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	2.848	–	2.848
Activos totales	–	125.999.339	–	125.999.339
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(172)	–	(172)
Pasivos totales	–	(172)	–	(172)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	135.777.186	–	135.777.186
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	39.869	–	39.869
Activos totales	–	135.817.055	–	135.817.055
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(393)	–	(393)
Pasivos totales	–	(393)	–	(393)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Emerging Market Debt - Hard Currency

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	698.370.729	–	698.370.729
Bonos del Estado	–	1.749.284.941	–	1.749.284.941
Acuerdos de recompra	–	117.000.000	–	117.000.000
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	6.810.542	–	6.810.542
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	5.401.518	–	–	5.401.518
Valor razonable en contratos de credit default swap	–	2.547.536	–	2.547.536
Activos totales	5.401.518	2.574.013.748	–	2.579.415.266
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(8.098.913)	–	(8.098.913)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(2.634.983)	–	–	(2.634.983)
Pasivos totales	(2.634.983)	(8.098.913)	–	(10.733.896)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	732.442.764	–	732.442.764
Bonos del Estado	–	1.794.182.602	–	1.794.182.602
Fondos de inversión	–	17.580.000	–	17.580.000
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	24.839.124	–	24.839.124
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	19.568.314	–	–	19.568.314
Activos totales	19.568.314	2.569.044.490	–	2.588.612.804
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(5.652.118)	–	(5.652.118)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(10.222.785)	–	–	(10.222.785)
Pasivos totales	(10.222.785)	(5.652.118)	–	(15.874.903)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Emerging Market Debt - Local Currency

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Tesoro	—	22.476.501	—	22.476.501
Bonos de empresa	—	39.316.269	—	39.316.269
Bonos del Estado	—	1.013.737.767	—	1.013.737.767
Fondos de inversión	—	5.847.140	—	5.847.140
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	10.385.515	—	10.385.515
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	424.243	—	—	424.243
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	—	4.714.297	—	4.714.297
Activos totales	424.243	1.096.477.489	—	1.096.901.732
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	(16.570.902)	—	(16.570.902)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(217.044)	—	—	(217.044)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	—	(13.429.120)	—	(13.429.120)
Pasivos totales	(217.044)	(30.000.022)	—	(30.217.066)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Tesoro	—	33.341.150	—	33.341.150
Bonos de empresa	—	41.825.600	—	41.825.600
Bonos del Estado	—	1.124.421.834	—	1.124.421.834
Fondos de inversión	—	16.173.300	—	16.173.300
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	17.116.276	—	17.116.276
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	313.668	—	—	313.668
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	—	11.479.756	—	11.479.756
Activos totales	313.668	1.244.357.916	—	1.244.671.584
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	(12.281.584)	—	(12.281.584)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(716.676)	—	—	(716.676)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	—	(14.977.755)	—	(14.977.755)
Pasivos totales	(716.676)	(27.259.339)	—	(27.976.015)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Emerging Market Debt Blend

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Tesoro	—	4.528.096	—	4.528.096
Bonos de empresa	—	149.204.084	—	149.204.084
Bonos del Estado	—	308.768.663	—	308.768.663
Fondos de inversión	—	5.809.975	—	5.809.975
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	2.412.130	—	2.412.130
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	366.162	—	—	366.162
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	—	1.629.252	—	1.629.252
Valor razonable en contratos de credit default <i>swap</i>	—	518.443	—	518.443
Activos totales	366.162	472.870.643	—	473.236.805
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	(5.530.578)	—	(5.530.578)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(152.516)	—	—	(152.516)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	—	(4.221.060)	—	(4.221.060)
Pasivos totales	(152.516)	(9.751.638)	—	(9.904.154)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Tesoro	—	1.006.392	—	1.006.392
Bonos de empresa	—	148.077.852	—	148.077.852
Bonos del Estado	—	330.568.106	—	330.568.106
Fondos de inversión	—	14.297.035	—	14.297.035
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	6.637.946	—	6.637.946
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	1.199.361	—	—	1.199.361
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	—	2.641.912	—	2.641.912
Activos totales	1.199.361	503.229.243	—	504.428.604
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	(2.075.226)	—	(2.075.226)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(969.525)	—	—	(969.525)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	—	(5.804.925)	—	(5.804.925)
Pasivos totales	(969.525)	(7.880.151)	—	(8.849.676)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	—	11.069.077	—	11.069.077
Bonos del Estado	—	49.308.427	—	49.308.427
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	463.359	—	463.359
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	154.598	—	—	154.598
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	—	3.463	—	3.463
Activos totales	154.598	60.844.326	—	60.998.924
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	(64.991)	—	(64.991)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(105.380)	—	—	(105.380)
Valor razonable en contratos de credit default <i>swap</i>	—	(7.485)	—	(7.485)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	—	(30.893)	—	(30.893)
Pasivos totales	(105.380)	(103.369)	—	(208.749)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Tesoro	—	821.151	—	821.151
Bonos de empresa	—	9.239.606	—	9.239.606
Bonos del Estado	—	48.266.565	—	48.266.565
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	2.325.031	—	2.325.031
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	832.110	—	—	832.110
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	—	19.138	—	19.138
Activos totales	832.110	60.671.491	—	61.503.601
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	(284.238)	—	(284.238)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(356.901)	—	—	(356.901)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	—	(38.443)	—	(38.443)
Pasivos totales	(356.901)	(322.681)	—	(679.582)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)**Valor razonable de las inversiones (cont.)****Emerging Markets Equity**

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	39.526.165	71.923.058	–	111.449.223
Fondos de inversión inmobiliaria	1.178.792	–	–	1.178.792
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	427.616	–	427.616
Activos totales	40.704.957	72.350.674	–	113.055.631
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(260.167)	–	(260.167)
Pasivos totales	–	(260.167)	–	(260.167)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	67.541.404	19.761.296	–	87.302.700
Fondos de inversión inmobiliaria	481.105	–	–	481.105
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.272.409	–	1.272.409
Activos totales	68.022.509	21.033.705	–	89.056.214
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(787.152)	–	(787.152)
Pasivos totales	–	(787.152)	–	(787.152)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Euro Bond

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	7.432.607	–	7.432.607
Bonos del Estado	–	6.817.817	–	6.817.817
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	48.940	–	–	48.940
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> sobre inflación	–	5.042	–	5.042
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	2.639	–	2.639
Activos totales	48.940	14.258.105	–	14.307.045
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(2.405)	–	–	(2.405)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> sobre inflación	–	(4.780)	–	(4.780)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	(8.682)	–	(8.682)
Valor razonable en contratos de credit default <i>swap</i>	–	(51.833)	–	(51.833)
Pasivos totales	(2.405)	(65.295)	–	(67.700)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	4.100	–	4.100
Bonos de empresa	–	4.770.071	–	4.770.071
Bonos del Estado	–	5.399.389	–	5.399.389
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	32.300	–	–	32.300
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> sobre inflación	–	6.642	–	6.642
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	7.001	–	7.001
Activos totales	32.300	10.187.203	–	10.219.503
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(19.007)	–	–	(19.007)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> sobre inflación	–	(3.665)	–	(3.665)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	(3.982)	–	(3.982)
Valor razonable en contratos de credit default <i>swap</i>	–	(54.486)	–	(54.486)
Pasivos totales	(19.007)	(62.133)	–	(81.140)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Euro Bond Absolute Return

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	633.424	–	633.424
Bonos de empresa	–	28.095.694	–	28.095.694
Bonos del Estado	–	23.172.726	–	23.172.726
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	37.193	–	37.193
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	74.631	–	–	74.631
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> sobre inflación	–	20.168	–	20.168
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	34.948	–	34.948
Activos totales	74.631	51.994.153	–	52.068.784
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(110.796)	–	(110.796)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(123.150)	–	–	(123.150)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> sobre inflación	–	(17.352)	–	(17.352)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	(14.505)	–	(14.505)
Valor razonable en contratos de credit default <i>swap</i>	–	(196.966)	–	(196.966)
Pasivos totales	(123.150)	(339.619)	–	(462.769)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	158.727	–	158.727
Bonos de empresa	–	18.558.164	–	18.558.164
Bonos del Estado	–	14.456.150	–	14.456.150
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	25.383	–	25.383
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	47.035	–	–	47.035
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> sobre inflación	–	26.569	–	26.569
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	113.881	–	113.881
Activos totales	47.035	33.338.874	–	33.385.909
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.117.757)	–	(1.117.757)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(301.831)	–	–	(301.831)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> sobre inflación	–	(14.661)	–	(14.661)
Valor razonable en contratos de credit default <i>swap</i>	–	(181.087)	–	(181.087)
Pasivos totales	(301.831)	(1.313.505)	–	(1.615.336)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

European High Yield Bond

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	5.059.708	–	5.059.708
Bonos de empresa	–	500.604.010	–	500.604.010
Préstamos a plazo	–	117.955	–	117.955
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	69.712	–	69.712
Activos totales	–	505.851.385	–	505.851.385
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.030.935)	–	(1.030.935)
Pasivos totales	–	(1.030.935)	–	(1.030.935)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	2.425.341	–	2.425.341
Bonos de empresa	–	384.433.736	–	384.433.736
Préstamos a plazo	–	114.727	–	114.727
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	643.091	–	643.091
Plusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	18.355	–	18.355
Activos totales	–	387.635.250	–	387.635.250
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.281.452)	–	(1.281.452)
Pasivos totales	–	(1.281.452)	–	(1.281.452)

European Sustainable Equity

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	147.657.183	–	–	147.657.183
Activos totales	147.657.183	–	–	147.657.183

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)**Valor razonable de las inversiones (cont.)****European Sustainable Equity (cont.)****Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados****A 31 de diciembre de 2023**

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	171.225.790	–	–	171.225.790
Activos totales	171.225.790	–	–	171.225.790

Event Driven**Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados****A 30 de junio de 2024**

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	820.190	–	–	820.190
Bonos del Tesoro	–	59.597.754	–	59.597.754
Bonos de empresa	–	69.754.368	–	69.754.368
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.406.810	–	1.406.810
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de rentabilidad total	–	454.074	–	454.074
Activos totales	820.190	131.213.006	–	132.033.196

Pasivos financieros mantenidos para negociación

Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(166.820)	–	(166.820)
Pasivos totales	–	(166.820)	–	(166.820)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados**A 31 de diciembre de 2023**

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Tesoro	–	115.039.719	–	115.039.719
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	4.057.943	–	4.057.943
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de rentabilidad total	–	959.529	–	959.529
Activos totales	–	120.057.191	–	120.057.191

Pasivos financieros mantenidos para negociación

Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(155.365)	–	(155.365)
Pasivos totales	–	(155.365)	–	(155.365)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Global Bond

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de agencias	–	1.113.905	–	1.113.905
Valores respaldados por activos	–	12.559.841	–	12.559.841
Bonos de empresa	–	35.042.017	–	35.042.017
Bonos del Estado	–	35.827.759	–	35.827.759
Valores con respaldo hipotecario	–	22.273.767	–	22.273.767
Bonos emitidos por organismos municipales	–	1.219.873	–	1.219.873
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.214.438	–	1.214.438
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	126.719	–	–	126.719
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	64.971	–	64.971
Activos totales	126.719	109.316.571	–	109.443.290
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.314.460)	–	(1.314.460)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(120.611)	–	–	(120.611)
Pasivos totales	(120.611)	(1.314.460)	–	(1.435.071)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de agencias	–	1.146.538	–	1.146.538
Valores respaldados por activos	–	10.864.506	–	10.864.506
Bonos de empresa	–	28.855.602	–	28.855.602
Bonos del Estado	–	42.481.574	–	42.481.574
Valores con respaldo hipotecario	–	22.645.649	–	22.645.649
Bonos emitidos por organismos municipales	–	1.278.776	–	1.278.776
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	3.337.129	–	3.337.129
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	440.690	–	–	440.690
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	124.708	–	124.708
Activos totales	440.690	110.734.482	–	111.175.172
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(3.195.228)	–	(3.195.228)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(622.972)	–	–	(622.972)
Valor razonable en contratos de credit default <i>swap</i>	–	(72.291)	–	(72.291)
Pasivos totales	(622.972)	(3.267.519)	–	(3.890.491)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Global Diversified Income FMP – 2024*

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	39.188	–	39.188
Activos totales	–	39.188	–	39.188
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.221)	–	(1.221)
Pasivos totales	–	(1.221)	–	(1.221)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Tesoro	–	18.765.889	–	18.765.889
Bonos de empresa	–	123.463.985	–	123.463.985
Bonos del Estado	–	1.727.993	–	1.727.993
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	281.732	–	281.732
Activos totales	–	144.239.599	–	144.239.599

Global Equity Megatrends

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	228.301.884	–	–	228.301.884
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	888	–	888
Activos totales	228.301.884	888	–	228.302.772
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(2.045)	–	(2.045)
Pasivos totales	–	(2.045)	–	(2.045)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	141.492.601	–	–	141.492.601
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	444	–	444
Activos totales	141.492.601	444	–	141.493.045

* La Cartera se liquidó el 28 de junio de 2024.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Global Flexible Credit Income

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	—	—	6.300.139	6.300.139
Valores respaldados por activos	—	66.219.832	—	66.219.832
Bonos de empresa	—	299.940.432	—	299.940.432
Bonos del Estado	—	10.604.146	—	10.604.146
Préstamos a plazo	—	22.205.622	894.720	23.100.342
Fondos de inversión	6.826	—	—	6.826
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	2.653.752	—	2.653.752
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	957.229	—	—	957.229
Activos totales	964.055	401.623.784	7.194.859	409.782.698
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	(529.546)	—	(529.546)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(631.966)	—	—	(631.966)
Pasivos totales	(631.966)	(529.546)	—	(1.161.512)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	—	—	6.022.083	6.022.083
Valores respaldados por activos	—	23.118.219	—	23.118.219
Bonos de empresa	—	295.514.545	758.917	296.273.462
Bonos del Estado	—	15.379.748	—	15.379.748
Préstamos a plazo	—	14.359.621	746.253	15.105.874
Fondos de inversión	66.832	—	—	66.832
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	8.130.820	—	8.130.820
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	3.733.739	—	—	3.733.739
Plusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	—	268.263	—	268.263
Activos totales	3.800.571	356.771.216	7.527.253	368.099.040
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	(3.447.658)	—	(3.447.658)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(5.173.223)	—	—	(5.173.223)
Pasivos totales	(5.173.223)	(3.447.658)	—	(8.620.881)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)**Valor razonable de las inversiones (cont.)****Global High Yield SDG Engagement**

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	598.637.465	–	598.637.465
Préstamos a plazo	–	5.337.114	–	5.337.114
Acuerdos de recompra	–	7.500.000	–	7.500.000
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	2.198.229	–	2.198.229
Activos totales	–	613.672.808	–	613.672.808
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(494.907)	–	(494.907)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(37.813)	–	–	(37.813)
Pasivos totales	(37.813)	(494.907)	–	(532.720)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	530.465.171	2.034.310	532.499.481
Préstamos a plazo	–	4.933	–	4.933
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	11.935.674	–	11.935.674
Activos totales	–	542.405.778	2.034.310	544.440.088
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(6.738.234)	–	(6.738.234)
Pasivos totales	–	(6.738.234)	–	(6.738.234)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Global Investment Grade Credit

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	83.895.429	–	83.895.429
Bonos del Estado	–	610.897	–	610.897
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	6.795	–	6.795
Activos totales	–	84.513.121	–	84.513.121
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(155.977)	–	(155.977)
Pasivos totales	–	(155.977)	–	(155.977)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	81.376.321	–	81.376.321
Bonos del Estado	–	2.082.454	–	2.082.454
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.115	–	1.115
Activos totales	–	83.459.890	–	83.459.890
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.107.450)	–	(1.107.450)
Pasivos totales	–	(1.107.450)	–	(1.107.450)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Global Opportunistic Bond

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	1.452.058	–	1.452.058
Bonos de empresa	–	27.609.953	–	27.609.953
Bonos del Estado	–	20.044.700	–	20.044.700
Valores con respaldo hipotecario	–	13.190.281	–	13.190.281
Fondos de inversión	2.162	–	–	2.162
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	2.293.505	–	2.293.505
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	293.984	–	–	293.984
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	35.683	–	35.683
Valor razonable en contratos de credit default <i>swap</i>	–	213.655	–	213.655
Activos totales	296.146	64.839.835	–	65.135.981
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.762.771)	–	(1.762.771)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(72.179)	–	–	(72.179)
Valor razonable en contratos de credit default <i>swap</i>	–	(736.621)	–	(736.621)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	(36.346)	–	(36.346)
Pasivos totales	(72.179)	(2.535.738)	–	(2.607.917)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	1.817.743	–	1.817.743
Bonos de empresa	–	27.412.055	–	27.412.055
Bonos del Estado	–	21.133.383	–	21.133.383
Valores con respaldo hipotecario	–	14.565.802	–	14.565.802
Fondos de inversión	21.165	–	–	21.165
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	4.673.609	–	4.673.609
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	839.044	–	–	839.044
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	76	–	76
Valor razonable en contratos de credit default <i>swap</i>	–	193.716	–	193.716
Activos totales	860.209	69.796.384	–	70.656.593
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(6.577.836)	–	(6.577.836)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(356.573)	–	–	(356.573)
Valor razonable en contratos de credit default <i>swap</i>	–	(821.571)	–	(821.571)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	(27)	–	(27)
Pasivos totales	(356.573)	(7.399.434)	–	(7.756.007)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)**Valor razonable de las inversiones (cont.)****Global Real Estate Securities****Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados****A 30 de junio de 2024**

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	366.096	2.653.448	–	3.019.544
Fondos de inversión inmobiliaria	12.671.407	4.054.720	–	16.726.127
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	5.312	–	5.312
Activos totales	13.037.503	6.713.480	–	19.750.983
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.869)	–	(1.869)
Pasivos totales	–	(1.869)	–	(1.869)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados**A 31 de diciembre de 2023**

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	3.015.990	–	–	3.015.990
Fondos de inversión inmobiliaria	17.071.668	–	–	17.071.668
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	422.478	–	422.478
Activos totales	20.087.658	422.478	–	20.510.136
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(250.684)	–	(250.684)
Pasivos totales	–	(250.684)	–	(250.684)

Global Sustainable Equity**Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados****A 30 de junio de 2024**

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	115.451.627	41.276.549	–	156.728.176
Activos totales	115.451.627	41.276.549	–	156.728.176

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados**A 31 de diciembre de 2023**

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	153.603.419	–	–	153.603.419
Activos totales	153.603.419	–	–	153.603.419

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)**Valor razonable de las inversiones (cont.)****Global Sustainable Value**

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	51.795.830	23.947.207	–	75.743.037
Fondos de inversión inmobiliaria	1.281.133	151.597	–	1.432.730
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	5.358	–	5.358
Activos totales	53.076.963	24.104.162	–	77.181.125
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(3.747)	–	(3.747)
Pasivos totales	–	(3.747)	–	(3.747)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	52.447.814	1.361.257	–	53.809.071
Fondos de inversión inmobiliaria	1.116.404	–	–	1.116.404
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	66.448	–	66.448
Activos totales	53.564.218	1.427.705	–	54.991.923
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(46.897)	–	(46.897)
Pasivos totales	–	(46.897)	–	(46.897)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

High Yield Bond

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	—	55.958.462	—	55.958.462
Bonos de empresa	—	1.839.528.478	—	1.839.528.478
Préstamos a plazo	—	73.361.700	2.228.482	75.590.182
Fondos de inversión	368.773	—	—	368.773
Acuerdos de recompra	—	147.000.000	—	147.000.000
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	14.485.123	—	14.485.123
Activos totales	368.773	2.130.333.763	2.228.482	2.132.931.018
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	(3.376.508)	—	(3.376.508)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de rentabilidad total	—	(215.188)	—	(215.188)
Pasivos totales	—	(3.591.696)	—	(3.591.696)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	—	10.897.982	—	10.897.982
Bonos de empresa	—	1.984.515.926	14.661.425	1.999.177.351
Bonos del Estado	—	36.225.768	—	36.225.768
Préstamos a plazo	—	43.084.058	—	43.084.058
Fondos de inversión	3.611.285	—	—	3.611.285
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	40.709.223	—	40.709.223
Activos totales	3.611.285	2.115.432.957	14.661.425	2.133.705.667
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	(15.391.406)	—	(15.391.406)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de rentabilidad total	—	(51.928)	—	(51.928)
Pasivos totales	—	(15.443.334)	—	(15.443.334)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

InnovAsia 5G

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	20.887.717	–	–	20.887.717
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	27.125	–	27.125
Activos totales	20.887.717	27.125	–	20.914.842
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(16.298)	–	(16.298)
Pasivos totales	–	(16.298)	–	(16.298)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	22.524.887	–	–	22.524.887
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	299.135	–	299.135
Activos totales	22.524.887	299.135	–	22.824.022
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(60.136)	–	(60.136)
Pasivos totales	–	(60.136)	–	(60.136)

Japan Equity Engagement

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 JPY	Nivel 2 JPY	Nivel 3 JPY	Total JPY
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	17.687.135.800	–	–	17.687.135.800
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	893.937	–	893.937
Activos totales	17.687.135.800	893.937	–	17.688.029.737
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(93.694)	–	(93.694)
Pasivos totales	–	(93.694)	–	(93.694)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Japan Equity Engagement (cont.)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 JPY	Nivel 2 JPY	Nivel 3 JPY	Total JPY
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	15.961.893.000	—	—	15.961.893.000
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	128.484.079	—	128.484.079
Activos totales	15.961.893.000	128.484.079	—	16.090.377.079
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	(42.002.252)	—	(42.002.252)
Pasivos totales	—	(42.002.252)	—	(42.002.252)

Macro Opportunities FX*

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Tesoro	—	2.407.376	—	2.407.376
Bonos de empresa	—	347.166	—	347.166
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	4.627.295	—	4.627.295
Activos totales	—	7.381.837	—	7.381.837
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	(4.613.695)	—	(4.613.695)
Pasivos totales	—	(4.613.695)	—	(4.613.695)

Next Generation Mobility

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	105.910.136	40.012.809	—	145.922.945
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	781	—	781
Activos totales	105.910.136	40.013.590	—	145.923.726
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	(616)	—	(616)
Pasivos totales	—	(616)	—	(616)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)**Valor razonable de las inversiones (cont.)****Next Generation Mobility (cont.)**

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	149.804.841	1.389.795	–	151.194.636
Fondos de inversión inmobiliaria	1.619.728	–	–	1.619.728
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	20.789	–	20.789
Activos totales	151.424.569	1.410.584	–	152.835.153
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(10.365)	–	(10.365)
Pasivos totales	–	(10.365)	–	(10.365)

*La Cartera se liquidó el 8 de febrero de 2024.

Next Generation Space Economy

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	19.994.485	10.064.785	–	30.059.270
Activos totales	19.994.485	10.064.785	–	30.059.270

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	17.658.423	1.016.293	–	18.674.716
Activos totales	17.658.423	1.016.293	–	18.674.716

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Responsible Asian Debt - Hard Currency

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	—	48.683.297	—	48.683.297
Bonos del Estado	—	12.484.417	—	12.484.417
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	18.585	—	18.585
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	47.296	—	—	47.296
Activos totales	47.296	61.186.299	—	61.233.595
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	(14.080)	—	(14.080)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(40.872)	—	—	(40.872)
Pasivos totales	(40.872)	(14.080)	—	(54.952)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Tesoro	—	2.496.736	—	2.496.736
Bonos de empresa	—	45.692.223	—	45.692.223
Bonos del Estado	—	12.025.196	—	12.025.196
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	127.055	—	127.055
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	255.858	—	—	255.858
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	—	575	—	575
Activos totales	255.858	60.341.785	—	60.597.643
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	(135.330)	—	(135.330)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(128.113)	—	—	(128.113)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	—	(21)	—	(21)
Pasivos totales	(128.113)	(135.351)	—	(263.464)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)**Valor razonable de las inversiones (cont.)****Short Duration Emerging Market Debt**

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	2.309.479.368	500.000	2.309.979.368
Bonos del Estado	–	1.422.540.438	–	1.422.540.438
Acuerdos de recompra	–	12.000.000	–	12.000.000
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	7.279.484	–	7.279.484
Activos totales	–	3.751.299.290	500.000	3.751.799.290
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(32.012.576)	–	(32.012.576)
Pasivos totales	–	(32.012.576)	–	(32.012.576)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Tesoro	–	53.894.704	–	53.894.704
Bonos de empresa	–	2.405.987.373	500.000	2.406.487.373
Bonos del Estado	–	1.307.631.941	–	1.307.631.941
Fondos de inversión	–	49.810.000	–	49.810.000
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	64.552.046	–	64.552.046
Activos totales	–	3.881.876.064	500.000	3.882.376.064
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(9.131.675)	–	(9.131.675)
Pasivos totales	–	(9.131.675)	–	(9.131.675)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Short Duration High Yield SDG Engagement

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	—	626.519.656	—	626.519.656
Préstamos a plazo	—	45.227.117	—	45.227.117
Fondos de inversión	24.613	—	—	24.613
Acuerdos de recompra	—	13.000.000	—	13.000.000
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	1.646.934	—	1.646.934
Activos totales	24.613	686.393.707	—	686.418.320
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	(6.439.402)	—	(6.439.402)
Pasivos totales	—	(6.439.402)	—	(6.439.402)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	—	659.326.845	4.686.892	664.013.737
Préstamos a plazo	—	12.793.556	626.491	13.420.047
Fondos de inversión	241.028	—	—	241.028
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	15.254.920	—	15.254.920
Activos totales	241.028	687.375.321	5.313.383	692.929.732
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	(3.114.085)	—	(3.114.085)
Pasivos totales	—	(3.114.085)	—	(3.114.085)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)**Valor razonable de las inversiones (cont.)****Strategic Income****Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados****A 30 de junio de 2024**

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Tesoro	–	132.950.816	–	132.950.816
Bonos de agencias	–	757.407	–	757.407
Valores respaldados por activos	–	690.390.495	–	690.390.495
Bonos de empresa	–	718.658.683	–	718.658.683
Bonos del Estado	–	237.399.857	–	237.399.857
Valores con respaldo hipotecario	–	1.431.213.971	–	1.431.213.971
Bonos emitidos por organismos municipales	–	12.612.180	–	12.612.180
Préstamos a plazo	–	80.465.100	4.810.764	85.275.864
Fondos de inversión	14.891	55.838.984	–	55.853.875
Acuerdos de recompra	–	16.500.000	–	16.500.000
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	9.940.128	–	9.940.128
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	5.735.673	–	–	5.735.673
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	151.451	–	151.451
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de rentabilidad total	–	328.310	–	328.310
Activos totales	5.750.564	3.387.207.382	4.810.764	3.397.768.710
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(10.615.127)	–	(10.615.127)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(2.863.421)	–	–	(2.863.421)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	(978.135)	–	(978.135)
Pasivos totales	(2.863.421)	(11.593.262)	–	(14.456.683)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Strategic Income (cont.)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	–	22.512	–	22.512
Bonos del Tesoro	–	221.166.130	–	221.166.130
Bonos de agencias	–	781.434	–	781.434
Valores respaldados por activos	–	211.031.917	–	211.031.917
Bonos de empresa	–	534.569.806	1.274.504	535.844.310
Bonos del Estado	–	175.669.880	–	175.669.880
Valores con respaldo hipotecario	–	918.338.562	–	918.338.562
Bonos emitidos por organismos municipales	–	12.918.823	–	12.918.823
Préstamos a plazo	–	429.819	–	429.819
Fondos de inversión	145.814	60.620.640	–	60.766.454
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	20.251.351	–	20.251.351
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	3.637.375	–	–	3.637.375
Valor razonable en <i>swaptions</i> adquiridos	–	15.122	–	15.122
Valor razonable en contratos de credit default <i>swap</i>	–	905.422	–	905.422
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	834.927	–	834.927
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de rentabilidad total	–	461.585	–	461.585
Activos totales	3.783.189	2.158.017.930	1.274.504	2.163.075.623
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(5.513.615)	–	(5.513.615)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(18.576.468)	–	–	(18.576.468)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	(1.085.681)	–	(1.085.681)
Pasivos totales	(18.576.468)	(6.599.296)	–	(25.175.764)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Sustainable Asia High Yield

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	27.402.423	–	27.402.423
Bonos del Estado	–	2.243.513	–	2.243.513
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.970	–	1.970
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	8.399	–	–	8.399
Activos totales	8.399	29.647.906	–	29.656.305
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.898)	–	(1.898)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(3.297)	–	–	(3.297)
Pasivos totales	(3.297)	(1.898)	–	(5.195)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	24.364.117	–	24.364.117
Bonos del Estado	–	2.505.094	–	2.505.094
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	16.926	–	16.926
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	23.897	–	–	23.897
Activos totales	23.897	26.886.137	–	26.910.034
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(496)	–	(496)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(58.271)	–	–	(58.271)
Pasivos totales	(58.271)	(496)	–	(58.767)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	106.392.923	–	106.392.923
Bonos del Estado	–	8.111.515	–	8.111.515
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	123.194	–	123.194
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	7.109	–	–	7.109
Valor razonable en contratos de credit default swap	–	159.754	–	159.754
Activos totales	7.109	114.787.386	–	114.794.495
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(738.428)	–	(738.428)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(78.515)	–	–	(78.515)
Pasivos totales	(78.515)	(738.428)	–	(816.943)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	83.464.415	–	83.464.415
Bonos del Estado	–	7.168.384	–	7.168.384
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.906.675	–	1.906.675
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	27.031	–	–	27.031
Activos totales	27.031	92.539.474	–	92.566.505
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(235.957)	–	(235.957)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(236.161)	–	–	(236.161)
Pasivos totales	(236.161)	(235.957)	–	(472.118)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	46.883.354	–	46.883.354
Bonos del Estado	–	502.548.426	–	502.548.426
Acuerdos de recompra	–	1.000.000	–	1.000.000
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	2.500.849	–	2.500.849
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	1.934.382	–	–	1.934.382
Valor razonable en contratos de credit default swap	–	498.689	–	498.689
Activos totales	1.934.382	553.431.318	–	555.365.700
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(5.289.407)	–	(5.289.407)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(1.361.004)	–	–	(1.361.004)
Pasivos totales	(1.361.004)	(5.289.407)	–	(6.650.411)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	28.120.429	–	28.120.429
Bonos del Estado	–	387.681.779	–	387.681.779
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	8.781.301	–	8.781.301
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	7.590.987	–	–	7.590.987
Activos totales	7.590.987	424.583.509	–	432.174.496
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(2.051.066)	–	(2.051.066)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(3.655.629)	–	–	(3.655.629)
Pasivos totales	(3.655.629)	(2.051.066)	–	(5.706.695)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Tactical Macro¹

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Tesoro	–	24.068.733	–	24.068.733
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	40.006	–	40.006
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	11.998	–	–	11.998
Contratos de opciones adquiridas	12.297	226.809	–	239.106
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de rentabilidad total	–	12.304	–	12.304
Activos totales	24.295	24.347.852	–	24.372.147
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(19.327)	–	(19.327)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(7.259)	–	–	(7.259)
Contratos de opciones suscritos	(1.525)	(179.288)	–	(180.813)
Pasivos totales	(8.784)	(198.615)	–	(207.399)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Tesoro	–	22.994.103	–	22.994.103
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	67.331	–	67.331
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	8.973	–	–	8.973
Contratos de opciones adquiridas	267.084	92.215	–	359.299
Activos totales	276.057	23.153.649	–	23.429.706
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(36.811)	–	(36.811)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(28.337)	–	–	(28.337)
Contratos de opciones suscritos	(115.463)	(81.790)	–	(197.253)
Pasivos totales	(143.800)	(118.601)	–	(262.401)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Ultra Short Term Euro Bond

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	133.321.969	–	133.321.969
Bonos de empresa	–	893.017.935	–	893.017.935
Bonos del Estado	–	88.753.537	–	88.753.537
Fondos de inversión	–	14.183.500	–	14.183.500
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	97.790	–	97.790
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	1.063.882	–	–	1.063.882
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> sobre inflación	–	403.358	–	403.358
Activos totales	1.063.882	1.129.778.089	–	1.130.841.971
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(73.683)	–	(73.683)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(894.750)	–	–	(894.750)
Valor razonable en contratos de credit default <i>swap</i>	–	(2.014.086)	–	(2.014.086)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> sobre inflación	–	(347.049)	–	(347.049)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	(541.636)	–	(541.636)
Pasivos totales	(894.750)	(2.976.454)	–	(3.871.204)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Tesoro	–	8.960.964	–	8.960.964
Valores respaldados por activos	–	90.687.160	–	90.687.160
Bonos de empresa	–	789.167.617	–	789.167.617
Bonos del Estado	–	75.386.047	–	75.386.047
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	235.719	–	235.719
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	509.420	–	–	509.420
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> sobre inflación	–	531.378	–	531.378
Activos totales	509.420	964.968.885	–	965.478.305
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(2.512.078)	–	(2.512.078)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(2.783.686)	–	–	(2.783.686)
Valor razonable en contratos de credit default <i>swap</i>	–	(2.179.454)	–	(2.179.454)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> sobre inflación	–	(293.227)	–	(293.227)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	(248.422)	–	(248.422)
Pasivos totales	(2.783.686)	(5.233.181)	–	(8.016.867)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Uncorrelated Strategies

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	26.029.523	—	—	26.029.523
Fondos de inversión inmobiliaria	1.406.961	—	—	1.406.961
<i>Participatory notes</i>	145.624	—	—	145.624
Bonos del Tesoro	—	404.936.028	—	404.936.028
Bonos de empresa	—	66.105.781	—	66.105.781
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	21.375.358	—	21.375.358
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	7.178.380	271.305	—	7.449.685
Contratos de opciones adquiridas	48.928.913	115.082.798	343.852	164.355.563
Plusvalía latente sobre contratos por diferencias	—	22.180.191	617	22.180.808
Valor razonable en <i>swaptions</i> adquiridos	—	136.767	—	136.767
Valor razonable en contratos de credit default <i>swap</i>	—	17.301	—	17.301
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	—	82.287	—	82.287
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de rentabilidad total	—	1.286.521	—	1.286.521
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de correlación	—	399.351	—	399.351
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de varianza	—	138.009	4.323.035	4.461.044
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de volatilidad	—	7.743.950	2.086.785	9.830.735
Activos totales	83.689.401	639.755.647	6.754.289	730.199.337
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	—	(12.493.555)	—	(12.493.555)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(6.619.884)	(22.822)	—	(6.642.706)
Contratos de opciones suscritos	(8.810.300)	(148.697.210)	(10)	(157.507.520)
Minusvalía latente sobre contratos por diferencias	—	(9.346.279)	(405.053)	(9.751.332)
Valor razonable en <i>swaptions</i> vendidos	—	(63.318)	—	(63.318)
Valor razonable en contratos de credit default <i>swap</i>	—	(353.633)	—	(353.633)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	—	(169.631)	—	(169.631)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de rentabilidad total	—	(1.625.161)	—	(1.625.161)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de varianza	—	—	(430.729)	(430.729)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de volatilidad	—	(6.200.131)	(24.705)	(6.224.836)
Pasivos totales	(15.430.184)	(178.971.740)	(860.497)	(195.262.421)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)**Valor razonable de las inversiones (cont.)****Uncorrelated Strategies (cont.)**

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	120.618.827	–	120.618.827
Valores de renta variable	77.292.452	–	–	77.292.452
Bonos del Estado	–	38.964.571	–	38.964.571
<i>Participatory notes</i>	16.551	20.494	–	37.045
Fondos de inversión inmobiliaria	1.217.656	–	–	1.217.656
Bonos del Tesoro	–	707.195.701	–	707.195.701
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	91.871.867	–	91.871.867
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	18.420.818	–	–	18.420.818
Contratos de opciones adquiridas	76.813.301	205.683.748	739.333	283.236.382
Plusvalía latente sobre contratos por diferencias	–	106.922.939	622	106.923.561
<i>Swaptions</i> comprados	–	40.202	–	40.202
Valor razonable en contratos de <i>credit default swap</i>	–	686.246	–	686.246
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	3.727.082	–	3.727.082
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de rentabilidad total	–	3.395.463	–	3.395.463
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de correlación	–	379.911	–	379.911
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de varianza	–	85.377	3.742.835	3.828.212
Plusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de volatilidad	–	15.951.941	2.474.234	18.426.175
Activos totales	173.760.778	1.295.544.369	6.957.024	1.476.262.171
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(53.084.382)	–	(53.084.382)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(24.576.840)	(16.558)	–	(24.593.398)
Contratos de opciones suscritos	(24.217.092)	(354.499.520)	(612)	(378.717.224)
Minusvalía latente sobre contratos por diferencias	–	(20.286.524)	(404.714)	(20.691.238)
<i>Swaptions</i> suscritos	–	(29.043)	–	(29.043)
Valor razonable en contratos de <i>credit default swap</i>	–	(1.305.860)	–	(1.305.860)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de tipos de interés	–	(9.089.737)	–	(9.089.737)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de rentabilidad total	–	(3.021.166)	–	(3.021.166)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de varianza	–	(418.672)	(96.004)	(514.676)
Minusvalía latente sobre contratos de <i>swap</i> de volatilidad	–	(8.805.597)	(105.892)	(8.911.489)
Pasivos totales	(48.793.932)	(450.557.059)	(607.222)	(499.958.213)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

US Equity

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	74.722.739	–	–	74.722.739
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	406.947	–	406.947
Activos totales	74.722.739	406.947	–	75.129.686
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.731.159)	–	(1.731.159)
Pasivos totales	–	(1.731.159)	–	(1.731.159)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	45.872.647	–	–	45.872.647
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.253.492	–	1.253.492
Activos totales	45.872.647	1.253.492	–	47.126.139
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(118.963)	–	(118.963)
Pasivos totales	–	(118.963)	–	(118.963)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

US Equity Index PutWrite

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Estado	–	673.716.341	–	673.716.341
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	5.541.028	–	5.541.028
Activos totales	–	679.257.369	–	679.257.369
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(316.637)	–	(316.637)
Contratos de opciones suscritos	(5.328.845)	–	–	(5.328.845)
Pasivos totales	(5.328.845)	(316.637)	–	(5.645.482)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Estado	–	663.357.136	–	663.357.136
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	12.128.805	–	12.128.805
Activos totales	–	675.485.941	–	675.485.941
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(538.104)	–	(538.104)
Contratos de opciones suscritos	(5.184.365)	(67.430)	–	(5.251.795)
Pasivos totales	(5.184.365)	(605.534)	–	(5.789.899)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

US Large Cap Value

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	968.466.730	–	–	968.466.730
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	96.180	–	96.180
Activos totales	968.466.730	96.180	–	968.562.910
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(33.677)	–	(33.677)
Pasivos totales	–	(33.677)	–	(33.677)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	1.847.675.317	–	–	1.847.675.317
Fondos de inversión inmobiliaria	3.901.309	–	–	3.901.309
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.119.012	–	1.119.012
Activos totales	1.851.576.626	1.119.012	–	1.852.695.638
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(115.827)	–	(115.827)
Pasivos totales	–	(115.827)	–	(115.827)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

US Long Short Equity

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	172.165.082	1.466.752	1.538.670	175.170.504
Fondos de inversión inmobiliaria	3.015.257	–	–	3.015.257
Bonos de empresa	–	414.009	–	414.009
Préstamos a plazo	–	–	487.831	487.831
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	282.783	–	282.783
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	10.919	–	–	10.919
Plusvalía latente sobre contratos por diferencias	–	500.040	–	500.040
Plusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	3.638	–	3.638
Activos totales	175.191.258	2.667.222	2.026.501	179.884.981
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(118.965)	–	(118.965)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(154.275)	–	–	(154.275)
Contratos de opciones suscritos	(4.650)	–	–	(4.650)
Minusvalía latente sobre contratos por diferencias	–	(535.067)	–	(535.067)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	(1.759.315)	–	(1.759.315)
Pasivos totales	(158.925)	(2.413.347)	–	(2.572.272)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	165.044.733	–	1.538.670	166.583.403
Fondos de inversión inmobiliaria	3.534.047	–	–	3.534.047
Bonos de empresa	–	7.670.535	–	7.670.535
Préstamos a plazo	–	–	487.831	487.831
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	3.283.704	–	3.283.704
Plusvalía latente sobre contratos por diferencias	–	624.429	–	624.429
Activos totales	168.578.780	11.578.668	2.026.501	182.183.949
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(342.870)	–	(342.870)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(1.003.428)	–	–	(1.003.428)
Contratos de opciones suscritos	(15.714)	–	–	(15.714)
Minusvalía latente sobre contratos por diferencias	–	(2.740.096)	–	(2.740.096)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	(4.635.993)	–	(4.635.993)
Pasivos totales	(1.019.142)	(7.718.959)	–	(8.738.101)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

US Multi Cap Opportunities

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	342.502.357	–	–	342.502.357
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	530.914	–	530.914
Activos totales	342.502.357	530.914	–	343.033.271
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(142.424)	–	(142.424)
Pasivos totales	–	(142.424)	–	(142.424)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	396.982.739	–	–	396.982.739
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.843.892	–	1.843.892
Activos totales	396.982.739	1.843.892	–	398.826.631
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(325.170)	–	(325.170)
Pasivos totales	–	(325.170)	–	(325.170)

US Real Estate Securities

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	4.837.748	–	–	4.837.748
Fondos de inversión inmobiliaria	414.310.341	–	–	414.310.341
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.223.951	–	1.223.951
Activos totales	419.148.089	1.223.951	–	420.372.040
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(194.797)	–	(194.797)
Pasivos totales	–	(194.797)	–	(194.797)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

US Real Estate Securities (cont.)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Fondos de inversión inmobiliaria	519.992.632	–	–	519.992.632
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	2.358.847	–	2.358.847
Activos totales	519.992.632	2.358.847	–	522.351.479
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(441.683)	–	(441.683)
Pasivos totales	–	(441.683)	–	(441.683)

US Small Cap

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	591.461.906	2.936.836	–	594.398.742
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	209.651	–	209.651
Activos totales	591.461.906	3.146.487	–	594.608.393
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(44.887)	–	(44.887)
Pasivos totales	–	(44.887)	–	(44.887)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	618.452.600	3.839.310	–	622.291.910
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	747.370	–	747.370
Activos totales	618.452.600	4.586.680	–	623.039.280
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(137.144)	–	(137.144)
Pasivos totales	–	(137.144)	–	(137.144)

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

US Small Cap Intrinsic Value

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2024

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	316.632.123	–	–	316.632.123
Bonos de empresa	–	–	0	0
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	4.139	–	4.139
Activos totales	316.632.123	4.139	–	316.636.262
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.893)	–	(1.893)
Pasivos totales	–	(1.893)	–	(1.893)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2023

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	299.826.372	–	–	299.826.372
Fondos de inversión inmobiliaria	1.910.421	–	–	1.910.421
Activos totales	301.736.793	–	–	301.736.793
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(398)	–	(398)
Pasivos totales	–	(398)	–	(398)

¹ Cartera lanzada durante el período analizado previo.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

11. TIPOS DE CAMBIO

Para convertir los activos y pasivos en divisas se utilizaron los tipos de cambio de cierre del período que se indican a continuación, a 30 de junio de 2024:

1 USD = 3,67300 AED	1 USD = 522,50000 CRC	1 USD = 3,76720 ILS	1 USD = 3,83075 PEN	1 USD = 32,78350 TRY
1 USD = 1.354,61000 ARS	1 USD = 23,36880 CZK	1 USD = 83,38750 INR	1 USD = 58,60900 PHP	1 USD = 32,44150 TWD
1 USD = 1,49734 AUD	1 USD = 6,95820 DKK	1 USD = 160,86000 JPY	1 USD = 4,02005 PLN	1 USD = 3.710,00000 UGX
1 USD = 5,55445 BRL	1 USD = 59,10000 DOP	1 USD = 129,25000 KES	1 USD = 3,64100 QAR	1 USD = 39,43500 UYU
1 USD = 1,36835 CAD	1 USD = 48,03000 EGP	1 USD = 1.376,50000 KRW	1 USD = 4,64400 RON	1 USD = 25.455,00000 VND
1 USD = 0,89860 CHF	1 USD = 0,93305 EUR	1 USD = 305,95000 LKR	1 USD = 109,17500 RSD	1 USD = 18,26000 ZAR
1 USD = 943,92500 CLP	1 USD = 0,79108 GBP	1 USD = 18,28550 MXN	1 USD = 86,25000 RUB	1 USD = 23,97500 ZMW
1 USD = 7,30085 CNH	1 USD = 15,30000 GHS	1 USD = 4,71750 MYR	1 USD = 3,75160 SAR	
1 USD = 7,26605 CNY	1 USD = 7,80740 HKD	1 USD = 1.515,00000 NGN	1 USD = 10,59020 SEK	
1 USD = 7,30085 CNY	1 USD = 368,48615 HUF	1 USD = 10,64750 NOK	1 USD = 1,35525 SGD	
1 USD = 4.144,15000 COP	1 USD = 16.375,00000 IDR	1 USD = 1,64109 NZD	1 USD = 36,69750 THB	
1 EUR = 1,60478 AUD	1 EUR = 25,04551 CZK	1 EUR = 8,36758 HKD	1 EUR = 4,30849 PLN	1 EUR = 1,45249 SGD
1 EUR = 1,46653 CAD	1 EUR = 7,45745 DKK	1 EUR = 172,40171 JPY	1 EUR = 11,35005 SEK	1 EUR = 1,07175 USD
1 EUR = 0,96307 CHF	1 EUR = 0,84784 GBP	1 EUR = 11,41146 NOK		
1 CNH = 1,00000 CNY	1 CNH = 0,10835 GBP	1 CNH = 0,18563 SGD		
1 CNH = 0,12780 EUR	1 CNH = 1,06938 HKD	1 CNH = 0,13697 USD		
1 JPY = 0,00580 EUR	1 JPY = 0,00492 GBP	1 JPY = 0,00622 USD		

Para convertir los activos y pasivos en divisas se utilizaron los tipos de cambio de cierre del ejercicio que se indican a continuación, a 31 de diciembre de 2023:

1 USD = 3,67275 AED	1 USD = 22,34960 CZK	1 USD = 3,60090 ILS	1 USD = 1,57940 NZD	1 USD = 1,31910 SGD
1 USD = 975,38000 ARS	1 USD = 6,74835 DKK	1 USD = 83,21375 INR	1 USD = 3,70260 PEN	1 USD = 34,13250 THB
1 USD = 1,46552 AUD	1 USD = 58,06000 DOP	1 USD = 140,98000 JPY	1 USD = 55,37500 PHP	1 USD = 29,53400 TRY
1 USD = 4,85760 BRL	1 USD = 30,92500 EGP	1 USD = 157,00000 KES	1 USD = 3,93225 PLN	1 USD = 30,69050 TWD
1 USD = 1,31860 CAD	1 USD = 0,90526 EUR	1 USD = 1.287,90000 KRW	1 USD = 3,64100 QAR	1 USD = 3.780,00000 UGX
1 USD = 0,84165 CHF	1 USD = 0,78444 GBP	1 USD = 455,89000 KZT	1 USD = 4,50360 RON	1 USD = 39,04000 UYU
1 USD = 873,28500 CLP	1 USD = 11,91500 GHS	1 USD = 16,93450 MXN	1 USD = 106,13000 RSD	1 USD = 24.262,00000 VND
1 USD = 7,12060 CNH	1 USD = 7,80855 HKD	1 USD = 4,59500 MYR	1 USD = 89,40000 RUB	1 USD = 18,28750 ZAR
1 USD = 7,09220 CNY	1 USD = 346,00555 HUF	1 USD = 897,50000 NGN	1 USD = 3,75000 SAR	1 USD = 25,71030 ZMW
1 USD = 3.874,00000 COP	1 USD = 15.397,00000 IDR	1 USD = 10,15570 NOK	1 USD = 10,07785 SEK	
1 EUR = 1,61889 AUD	1 EUR = 24,68849 CZK	1 EUR = 8,62571 HKD	1 EUR = 4,34376 PLN	1 EUR = 1,45714 SGD
1 EUR = 1,45659 CAD	1 EUR = 7,45456 DKK	1 EUR = 155,73356 JPY	1 EUR = 11,13250 SEK	1 EUR = 1,10465 USD
1 EUR = 0,92973 CHF	1 EUR = 0,86653 GBP	1 EUR = 11,21849 NOK		
1 CNH = 1,00000 CNY	1 CNH = 0,11016 GBP	1 CNH = 0,18525 SGD		
1 CNH = 0,12713 EUR	1 CNH = 1,09661 HKD	1 CNH = 0,14044 USD		
1 JPY = 0,00642 EUR	1 JPY = 0,00556 GBP	1 JPY = 0,00709 USD		

Para el semestre finalizado el 30 de junio de 2024

11. Tipos de Cambio (Cont.)

AED	Dirham de Emiratos Árabes Unidos	HKD	Dólar de Hong Kong	QAR	Riyal catari
ARS	Peso argentino	HUF	Forint húngaro	RON	Nuevo leu rumano
AUD	Dólar australiano	IDR	Rupia indonesia	RSD	Dinar serbio
BRL	Real brasileño	ILS	Shekel israelí	RUB	Rublo ruso
CAD	Dólar canadiense	INR	Rupia india	SAR	Riyal saudí
CHF	Franco suizo	JPY	Yen japonés (JPY)	SEK	Corona sueca
CLP	Peso chileno	KES	Chelín keniano	SGD	Dólar de Singapur
*CNH	Yuan renminbi chino	KRW	Won de Corea del Sur	THB	Baht tailandés
*CNY	Yuan renminbi chino	KZT	Tenge kazajo	TRY	Lira turca
COP	Peso colombiano	LKR	Rupia de Sri Lanka	TWD	Nuevo dólar taiwanés
CRC	Colón costarricense	MXN	Peso mexicano	UGX	Chelín ugandés
CZK	Corona checa	MYR	Ringgit malayo	USD	Dólar estadounidense (\$)
DKK	Corona danesa	NGN	Naira nigeriana	UYU	Peso uruguayo
DOP	Peso dominicano	NOK	Corona noruega	VND	Dong vietnamita
EGP	Libra egipcia	NZD	Dólar de Nueva Zelanda	ZAR	Rand sudafricano
EUR	Euro (EUR)	PEN	Sol peruano	ZMW	Kwacha zambiano
GBP	Libra esterlina (GBP)	PHP	Peso filipino		
GHS	Cedi ghanés	PLN	Zloty polaco		

*En China hay una moneda de curso legal, el yuan renminbi chino. El CNY cotiza en la China continental, mientras que el CNH cotiza *offshore*, principalmente en el mercado de Hong Kong, cada uno a un tipo de cambio diferente.

12. Ajuste de Conversión de Divisas

Las Cuentas consolidadas de la Sociedad están denominadas en dólares estadounidenses (USD). A efectos de comunicar los resultados agregados de la Sociedad, los resultados de determinadas Carteras se han convertido a dólares estadounidenses conforme a los tipos de cambio que figuran a continuación.

Cartera	Balance		Cuenta de pérdidas y ganancias y Estado de variaciones del patrimonio neto atribuible a los titulares de acciones de participación reembolsables	
	Tipo al cierre		Tipo medio	
	30 de junio de 2024	31 de diciembre de 2023	30 de junio de 2024	30 de junio de 2023
China A-Share Equity	1 USD = 7,26605 CNY	1 USD = 7,09220 CNY	1 USD = 7,20629 CNY	1 USD = 6,97407 CNY
China Bond	1 USD = 7,26605 CNY	1 USD = 7,09220 CNY	1 USD = 7,20629 CNY	1 USD = 6,97407 CNY
Corporate Hybrid Bond	1 USD = 0,93305 EUR	1 USD = 0,90526 EUR	1 USD = 0,92362 EUR	1 USD = 0,92593 EUR
Euro Bond	1 USD = 0,93305 EUR	1 USD = 0,90526 EUR	1 USD = 0,92362 EUR	1 USD = 0,92593 EUR
Euro Bond Absolute Return	1 USD = 0,93305 EUR	1 USD = 0,90526 EUR	1 USD = 0,92362 EUR	1 USD = 0,92593 EUR
European High Yield Bond	1 USD = 0,93305 EUR	1 USD = 0,90526 EUR	1 USD = 0,92362 EUR	1 USD = 0,92593 EUR
European Sustainable Equity	1 USD = 0,93305 EUR	1 USD = 0,90526 EUR	1 USD = 0,92362 EUR	1 USD = 0,92593 EUR
Japan Equity Engagement	1 USD = 160,8600 JPY	1 USD = 140,9800 JPY	1 USD = 151,9343 JPY	1 USD = 135,9586 JPY
Macro Opportunities FX	1 USD = 0,93305 EUR	1 USD = 0,90526 EUR	1 USD = 0,92362 EUR	1 USD = 0,92593 EUR
Ultra Short Term Euro Bond	1 USD = 0,93305 EUR	1 USD = 0,90526 EUR	1 USD = 0,92362 EUR	1 USD = 0,92593 EUR

Se deriva un ajuste cambiario teórico de USD (136.473.532) (30 de junio de 2023: 51.504.327 USD) de la conversión del Patrimonio neto inicial, la Cuenta de pérdidas y ganancias y el Estado de variaciones del Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables. El método de conversión no afecta al valor del Patrimonio neto atribuible a cada Cartera.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024**13. ACUERDOS DE COMISIONES EN ESPECIE**

La Gestora y otras personas vinculadas han celebrado acuerdos de comisiones en especie con intermediarios financieros en relación con productos de análisis en casos muy limitados, sin perjuicio del principio de mejor ejecución, para apoyar el proceso de toma de decisiones de inversión.

Los tipos de servicios de análisis recibidos incluyen todas las modalidades habituales de análisis, incluida la relativa a los datos históricos y actuales de determinadas empresas, sectores y la economía en su conjunto, así como información y oportunidades, riesgos y tendencias, y análisis en relación con situaciones especiales. La Gestora considera que dichos acuerdos benefician a las Carteras y tiene el convencimiento de haber recibido la mejor ejecución en nombre de estas.

14. SEPARACIÓN DE PASIVOS

La Sociedad cuenta con numerosas Carteras y puede crear más en el futuro. Con la autorización de los Accionistas de la Sociedad, mediante acuerdo especial aprobado el 3 de noviembre de 2006, la Sociedad decidió adoptar el régimen de separación de pasivos entre sus Carteras. Desde dicha fecha, cada Cartera soporta sus propios pasivos y ni la Sociedad ni ningún proveedor de servicios designados por esta, ni los Consejeros, ni ningún síndico, inspector, liquidador u otra persona tendrán acceso a los activos de una Cartera para atender pasivos de otra Cartera.

15. GESTIÓN EFICIENTE DE LA CARTERA

La Sociedad puede utilizar técnicas e instrumentos de inversión relacionados con valores mobiliarios u otros instrumentos financieros, incluidos instrumentos financieros derivados, de conformidad con las condiciones y dentro de los límites fijados por el Banco Central, siempre que dichos instrumentos se utilicen para una gestión eficiente de la cartera (es decir, con fines de cobertura, para reducir riesgos o costes, para incrementar el capital o para lograr ingresos) o con fines de inversión. Las técnicas y los instrumentos utilizados solo pueden usarse de conformidad con los objetivos de inversión de la Cartera de que se trate.

A discreción de la Gestora o del Gestor delegado de inversiones, cada Cartera podrá participar en operaciones de préstamo de valores («Contratos de préstamo de valores»), con sujeción a las condiciones y límites establecidos en el Reglamento sobre OICVM del Banco Central, en relación con cada tipo de activos en los que puede invertir la Cartera, según se detalla en el apartado «Instrumentos y clases de activos» del Folleto. Las operaciones de préstamo de valores podrán utilizarse para una gestión eficiente de la Cartera.

Los Contratos de préstamo de valores son operaciones en las que una Cartera presta sus valores a otra parte, el prestatario, que está obligado contractualmente a devolver los valores equivalentes al cierre del período acordado. Durante el período del préstamo de valores, el prestatario abona a la Cartera (i) una comisión por préstamo de valores y (ii) todo ingreso derivado de los valores.

A 30 de junio de 2024 y 31 de diciembre de 2023, la Sociedad no participó en operaciones de préstamo de valores.

Durante el semestre finalizado el 30 de junio de 2024, las carteras CLO Income, Corporate Hybrid Bond, Emerging Market Debt - Hard Currency, Emerging Market Debt - Local Currency, Global High Yield SDG Engagement, High Yield Bond, Short Duration Emerging Market Debt, Short Duration High Yield SDG Engagement, Strategic Income, Sustainable Emerging Market Corporate Debt y Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency participaron en operaciones de recompra y recompra inversa. Los ingresos totales por intereses derivados de los acuerdos de recompra durante el período finalizado a 30 de junio de 2024 fueron de 4.175.822 USD. Los gastos totales por intereses derivados de los acuerdos de recompra inversa durante el período finalizado a 30 de junio de 2024 fueron de 53.795 USD. Los costes directos e indirectos derivados de las técnicas de gestión eficiente de la cartera no se pueden identificar de manera inmediata.

Durante el semestre finalizado el 30 de junio de 2023, los fondos Corporate Hybrid Bond, Emerging Market Debt Blend y Short Duration Emerging Market Debt participaron en operaciones de recompra inversa. Los ingresos totales por intereses derivados de los acuerdos de recompra inversa durante el período finalizado a 30 de junio de 2023 fueron de 2.377 USD. Los gastos totales por intereses derivados de los acuerdos de recompra inversa durante el período finalizado a 30 de junio de 2023 fueron de 210.116 USD. Los costes directos e indirectos derivados de las técnicas de gestión eficiente de la cartera no se pueden identificar de manera inmediata.

16. LÍNEA DE CRÉDITO

Según la reunión del Consejo de 20 de junio de 2016, se han formalizado acuerdos con The Bank of Tokyo Mitsubishi UFJ Ltd y con un sindicato formado por otros bancos (conjuntamente los «Prestamistas»), a fin de facilitar un servicio de liquidez comprometido por un importe máximo de 500.000.000 USD (el «Servicio») para la Sociedad con respecto a las Carteras. Este es efectivo desde la fecha de la ejecución del acuerdo de crédito con el Banco y los fondos del Servicio solo se pueden emplear para necesidades temporales o emergencias de liquidez de las Carteras. El Mecanismo de financiación, por importe de 850.000.000 USD, se renovó el 28 de septiembre de 2023 por un período de 364 días para todas las Carteras. El coste de la comisión de compromiso se ha modificado en consonancia.

A 30 de junio de 2024 y a 31 de diciembre de 2023 no existían préstamos pendientes de amortización en virtud del Servicio. Durante el semestre finalizado el 30 de junio de 2024 y el ejercicio cerrado el 31 de diciembre de 2023, ninguna de las Carteras recurrió a la línea de crédito.

PARA EL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2024

17. COMPROMISOS DE PRÉSTAMO NO FINANCIADOS

A 30 de junio de 2024, la Sociedad mantenía los siguientes compromisos de préstamos no financiados:

Denominación del Fondo	Nombre del valor	Compromiso no financiado USD	Valor razonable USD
High Yield Bond	Groundworks LLC	283.821	285.425

A 31 de diciembre de 2023, la Sociedad no mantenía compromisos de préstamos no financiados.

18. CIFRAS COMPARATIVAS

Las cifras utilizadas a efectos comparativos en las cuentas son las del semestre finalizado el 30 de junio de 2023 en el caso de la Cuenta de pérdidas y ganancias y el Estado de variaciones del Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables, y las cifras a 31 de diciembre de 2023 en el caso del Balance.

19. ACONTECIMIENTOS SIGNIFICATIVOS DURANTE EL PERÍODO

Con efecto desde el 1 de febrero de 2024, la comisión de gestión del Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund se redujo del 0,85% al 0,80% en la Clase de acumulación I EUR y la Clase de acumulación I USD; del 1,70% al 1,60% en la Clase de acumulación sin cobertura M EUR, la Clase de acumulación A SGD, la Clase de acumulación A USD, la Clase de acumulación C1 USD y la Clase de acumulación M USD; y del 0,81% al 0,76% en la Clase de acumulación sin cobertura P GBP.

Macro Opportunities FX se liquidó el 8 de febrero de 2024.

Con efecto a partir del 25 de abril de 2024, Soloda Investment Advisors LLP cesó en sus funciones de Subasesor no afiliado de la Sociedad.

Con efecto a partir del 3 de mayo de 2024, Cipher Capital LP cesó en sus funciones de Subasesor no afiliado de la Sociedad.

Global Diversified Income FMP – 2024 se liquidó el 28 de junio de 2024.

Salvo lo anteriormente indicado, no se ha producido ningún acontecimiento significativo que afecte a la Sociedad durante el periodo.

20. ACONTECIMIENTOS SIGNIFICATIVOS OCURRIDOS DESDE EL CIERRE DEL PERÍODO

El 1 de julio de 2024 el Banco Central registró una nueva versión del Folleto de la Sociedad y nuevos Suplementos al Folleto, que incluyen modificaciones en la denominación de las carteras y la actualización del nombre del índice de referencia con relación al Neuberger Berman Tactical Macro Fund. El Neuberger Berman 5G Connectivity Fund pasó a denominarse Neuberger Berman Next Generation Connectivity Fund, el Neuberger Berman InnovAsia 5G Fund pasó a denominarse Neuberger Berman InnovAsia Fund, el Neuberger Berman Global Sustainable Value Fund pasó a denominarse Neuberger Berman Global Value Fund y el Neuberger Berman US Equity Index Putwrite Fund pasó a denominarse Neuberger Berman US Equity Premium Fund. El valor de referencia para el Neuberger Berman Tactical Macro Fund actualizó su denominación, que pasó a ser ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity (rentabilidad total en USD).

Salvo por lo anteriormente indicado, no se ha producido ningún otro acontecimiento significativo que afecte a la Sociedad desde el cierre del periodo.

21. APROBACIÓN DE LAS CUENTAS

El Consejo de Administración aprobó el informe semestral y las cuentas abreviadas no auditadas el 23 de agosto de 2024.

Anexo I

RATIOS DE GASTOS TOTALES

Los ratios de gastos totales («TER») correspondientes al semestre finalizado el 30 de junio de 2024 se basan en los 12 meses anteriores a las fechas señaladas a continuación:

30 de junio de 2024

5G Connectivity

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación A AUD	1,82%	1,82%
Clase de acumulación E AUD	2,81%	2,81%
Clase de acumulación I2 AUD	0,79%	0,79%
Clase de acumulación A CHF	1,81%	1,81%
Clase de acumulación I CHF	0,96%	0,96%
Clase de acumulación I2 CHF	0,79%	0,79%
Clase de acumulación A CNY	1,82%	1,82%
Clase de acumulación I2 CNY	0,79%	0,79%
Clase de acumulación A EUR	1,82%	1,82%
Clase de acumulación sin cobertura A EUR	1,81%	1,81%
Clase de acumulación I EUR	0,97%	0,97%
Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,97%	0,97%
Clase de acumulación I2 EUR	0,79%	0,79%
Clase de acumulación I5 EUR	0,53%	0,53%
Clase de acumulación sin cobertura M EUR	2,62%	2,62%
Clase de acumulación A GBP	1,82%	1,82%
Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,96%	0,96%
Clase de acumulación I2 GBP	0,79%	0,79%
Clase de acumulación A HKD	1,82%	1,82%
Clase de acumulación I2 HKD	0,79%	0,79%
Clase de acumulación A SGD	1,82%	1,82%
Clase de acumulación I2 SGD	0,79%	0,79%
Clase de acumulación A USD	1,82%	1,82%
Clase de acumulación E USD	2,91%	2,91%
Clase de acumulación I USD	0,97%	0,97%
Clase de reparto I USD	0,97%	0,97%
Clase de acumulación I2 USD	0,81%	0,81%
Clase de acumulación I3 USD	0,71%	0,71%
Clase de acumulación I5 USD	0,54%	0,54%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

5G Connectivity (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación M USD	2,62%	2,62%
Clase de acumulación Z USD	0,11%	0,11%
Clase de acumulación A ZAR	1,81%	1,81%
Clase de acumulación E ZAR	2,91%	2,91%

China A-Share Equity

Clase de acumulación I CNY	9,74%	1,20%
Clase de acumulación sin cobertura I USD	9,74%	1,20%
Clase de reparto sin cobertura I USD	9,74%	1,20%

China Bond

Clase de reparto (mensual) A CNY	1,77%	1,50%
Clase de reparto I CNY	1,12%	0,85%
Clase de acumulación Z CNY	0,47%	0,20%
Clase de acumulación I2 GBP	0,99%	0,72%
Clase de reparto sin cobertura (mensual) A SGD	1,78%	1,50%
Clase de acumulación sin cobertura I USD	1,07%	0,85%
Clase de acumulación Z USD	0,42%	0,20%
Clase de acumulación sin cobertura Z USD	0,43%	0,20%

China Equity

Clase de acumulación I CHF	1,31%	1,31%
Clase de acumulación A EUR	2,06%	2,06%
Clase de acumulación I EUR	1,31%	1,31%
Clase de acumulación Z EUR	0,20%	0,20%
Clase de acumulación A SGD	2,06%	2,06%
Clase de acumulación A USD	2,06%	2,06%
Clase de reparto A USD	2,06%	2,06%
Clase de acumulación I USD	1,31%	1,31%
Clase de acumulación I2 USD	1,10%	1,10%
Clase de acumulación M USD	3,05%	3,05%
Clase de acumulación U USD	1,66%	1,66%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

China Equity (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación Z USD	0,21%	0,21%

Climate Innovation¹

Clase de acumulación A USD	5,89%	1,90%
Clase de acumulación I USD	5,04%	1,05%
Clase de acumulación I5 USD	4,61%	0,62%
Clase de acumulación Z USD	4,20%	0,20%

CLO Income

Clase de acumulación A EUR	1,63%	1,63%
Clase de acumulación I EUR	0,89%	0,89%
Clase de reparto I2 EUR	0,74%	0,74%
Clase de acumulación X EUR	0,48%	0,48%
Clase de acumulación Z GBP	0,15%	0,15%
Clase de acumulación I SEK	0,90%	0,90%
Clase de acumulación A USD	1,59%	1,59%
Clase de acumulación I USD	0,88%	0,88%
Clase de reparto I USD	0,86%	0,86%
Clase de reparto I2 USD	0,74%	0,74%
Clase de acumulación I4 USD	0,53%	0,53%
Clase de reparto I5 USD	0,51%	0,51%
Clase de acumulación Z USD	0,14%	0,14%

Commodities

Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,85%	0,82%
Clase de acumulación I5 GBP	0,53%	0,51%
Clase de acumulación A USD	1,63%	1,60%
Clase de acumulación I USD	0,86%	0,84%
Clase de acumulación I5 USD	0,54%	0,51%
Clase de acumulación M USD	2,20%	2,18%
Clase de acumulación Z USD	0,21%	0,18%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

Corporate Hybrid Bond

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de reparto (mensual) A AUD	1,28%	1,28%
Clase de reparto A CHF	1,27%	1,27%
Clase de acumulación I3 CHF	0,47%	0,47%
Clase de acumulación P CHF	0,65%	0,65%
Clase de reparto P CHF	0,64%	0,64%
Clase de reparto (mensual) A EUR	1,28%	1,28%
Clase de acumulación A EUR	1,28%	1,28%
Clase de acumulación I EUR	0,68%	0,68%
Clase de reparto I EUR	0,68%	0,68%
Clase de acumulación I2 EUR	0,56%	0,56%
Clase de reparto I2 EUR	0,56%	0,56%
Clase de acumulación I3 EUR	0,49%	0,49%
Clase de acumulación I5 EUR	0,38%	0,38%
Clase de acumulación M EUR	1,88%	1,88%
Clase de reparto M EUR	1,88%	1,88%
Clase de acumulación P EUR	0,65%	0,65%
Clase de reparto P EUR	0,65%	0,65%
Clase de acumulación I GBP	0,68%	0,68%
Clase de acumulación I2 GBP	0,56%	0,56%
Clase de reparto I2 GBP	0,55%	0,55%
Clase de acumulación P GBP	0,65%	0,65%
Clase de reparto P GBP	0,65%	0,65%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,28%	1,28%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,28%	1,28%
Clase de acumulación A USD	1,28%	1,28%
Clase de reparto A USD	1,27%	1,27%
Clase de acumulación C1 USD	2,28%	2,28%
Clase de acumulación I USD	0,68%	0,68%
Clase de reparto I USD	0,68%	0,68%
Clase de acumulación I2 USD	0,56%	0,56%
Clase de reparto I2 USD	0,56%	0,56%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

Corporate Hybrid Bond (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación M USD	1,88%	1,88%
Clase de reparto M USD	1,88%	1,88%
Clase de acumulación P USD	0,65%	0,65%
Clase de acumulación Z USD	0,08%	0,08%

Developed Market FMP – 2027¹

Clase de acumulación A EUR	0,79%	0,79%
Clase de reparto I EUR	0,42%	0,42%
Clase de acumulación A USD	0,78%	0,78%
Clase de reparto A USD	0,79%	0,79%
Clase de acumulación I USD	0,44%	0,44%
Clase de reparto I USD	0,42%	0,42%
Clase de acumulación X USD	0,53%	0,53%

Emerging Market Debt - Hard Currency

Clase de reparto (mensual) A AUD	1,50%	1,50%
Clase de reparto I AUD	0,80%	0,80%
Clase de acumulación sin cobertura I3 CAD	0,58%	0,58%
Clase de acumulación I2 CHF	0,66%	0,66%
Clase de acumulación P CHF	0,76%	0,76%
Clase de reparto (mensual) A EUR	1,50%	1,50%
Clase de acumulación A EUR	1,50%	1,50%
Clase de acumulación I EUR	0,79%	0,79%
Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,80%	0,80%
Clase de reparto I EUR	0,79%	0,79%
Clase de acumulación I2 EUR	0,66%	0,66%
Clase de reparto I2 EUR	0,65%	0,65%
Clase de acumulación I3 EUR	0,58%	0,58%
Clase de acumulación I4 EUR	0,51%	0,51%
Clase de acumulación sin cobertura I5 EUR	0,45%	0,45%
Clase de acumulación M EUR	2,30%	2,30%
Clase de reparto M EUR	2,30%	2,30%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

Emerging Market Debt - Hard Currency (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación P EUR	0,76%	0,76%
Clase de acumulación Z EUR	0,09%	0,09%
Clase de acumulación I GBP	0,80%	0,80%
Clase de reparto I GBP	0,79%	0,79%
Clase de acumulación I2 GBP	0,66%	0,66%
Clase de reparto I2 GBP	0,65%	0,65%
Clase de acumulación P GBP	0,76%	0,76%
Clase de reparto (mensual) A HKD	1,49%	1,49%
Clase de acumulación I JPY	0,79%	0,79%
Clase de acumulación A SEK	1,50%	1,50%
Clase de acumulación I2 SEK	0,66%	0,66%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,49%	1,49%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,50%	1,50%
Clase de acumulación A USD	1,50%	1,50%
Clase de reparto A USD	1,49%	1,49%
Clase de acumulación C1 USD	2,50%	2,50%
Clase de acumulación I USD	0,79%	0,79%
Clase de reparto I USD	0,79%	0,79%
Clase de acumulación I2 USD	0,65%	0,65%
Clase de reparto I2 USD	0,65%	0,65%
Clase de reparto I3 USD	0,58%	0,58%
Clase de acumulación M USD	2,30%	2,30%
Clase de reparto M USD	2,30%	2,30%
Clase de acumulación P USD	0,76%	0,76%
Clase de acumulación X USD	0,48%	0,48%
Clase de acumulación Z USD	0,09%	0,09%

Emerging Market Debt - Local Currency

Clase de reparto (mensual) B AUD	2,98%	2,98%
Clase de acumulación B AUD	2,98%	2,98%
Clase de reparto (mensual) E AUD	2,98%	2,98%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

Emerging Market Debt - Local Currency (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación E AUD	2,98%	2,98%
Clase de reparto (mensual) T AUD	1,98%	1,98%
Clase de acumulación T AUD	1,98%	1,98%
Clase de acumulación A EUR	1,67%	1,67%
Clase de acumulación I EUR	0,93%	0,93%
Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,93%	0,93%
Clase de acumulación sin cobertura I2 EUR	0,77%	0,77%
Clase de reparto sin cobertura I4 EUR	0,62%	0,62%
Clase de acumulación sin cobertura Y EUR	0,53%	0,53%
Clase de acumulación I GBP	0,93%	0,93%
Clase de acumulación sin cobertura I4 GBP	0,62%	0,62%
Clase de reparto sin cobertura I4 GBP	0,62%	0,62%
Clase de acumulación sin cobertura Y GBP	0,53%	0,53%
Clase de acumulación A SEK	1,68%	1,68%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,68%	1,68%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,68%	1,68%
Clase de acumulación A USD	1,68%	1,68%
Clase de reparto (mensual) B USD	2,98%	2,98%
Clase de acumulación B USD	2,98%	2,98%
Clase de reparto (mensual) E USD	2,98%	2,98%
Clase de acumulación E USD	2,98%	2,98%
Clase de reparto (mensual) I USD	0,93%	0,93%
Clase de acumulación I USD	0,92%	0,92%
Clase de reparto I USD	0,93%	0,93%
Clase de acumulación I2 USD	0,77%	0,77%
Clase de acumulación I5 USD	0,54%	0,54%
Clase de reparto (mensual) T USD	1,98%	1,98%
Clase de acumulación T USD	1,98%	1,98%
Clase de acumulación X USD	0,55%	0,48%
Clase de acumulación Y USD	0,53%	0,53%
Clase de reparto (mensual) B ZAR	2,98%	2,98%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

Emerging Market Debt - Local Currency (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación B ZAR	2,98%	2,98%
Clase de reparto (mensual) E ZAR	2,98%	2,98%
Clase de acumulación E ZAR	2,98%	2,98%
Clase de reparto (mensual) T ZAR	1,98%	1,98%
Clase de acumulación T ZAR	1,98%	1,98%

Emerging Market Debt Blend

Clase de reparto I3 AUD	0,68%	0,68%
Clase de acumulación A EUR	1,60%	1,59%
Clase de acumulación I EUR	0,89%	0,89%
Clase de reparto I EUR	0,89%	0,89%
Clase de acumulación I2 EUR	0,75%	0,75%
Clase de reparto I2 EUR	0,75%	0,75%
Clase de reparto I3 EUR	0,68%	0,68%
Clase de acumulación sin cobertura I4 EUR	0,61%	0,61%
Clase de acumulación I5 EUR	0,54%	0,54%
Clase de acumulación M EUR	2,39%	2,39%
Clase de reparto M EUR	2,39%	2,39%
Clase de acumulación Z EUR	0,19%	0,19%
Clase de acumulación I GBP	0,89%	0,89%
Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,85%	0,85%
Clase de reparto I GBP	0,89%	0,89%
Clase de reparto sin cobertura I GBP	0,88%	0,88%
Clase de acumulación P GBP	0,86%	0,86%
Clase de acumulación sin cobertura P GBP	0,86%	0,86%
Clase de acumulación Z GBP	0,19%	0,19%
Clase de acumulación U NOK	1,24%	1,24%
Clase de acumulación A SEK	1,59%	1,59%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,59%	1,59%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,59%	1,59%
Clase de acumulación A USD	1,59%	1,59%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

Emerging Market Debt Blend (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación C1 USD	2,60%	2,59%
Clase de acumulación I USD	0,89%	0,89%
Clase de reparto I USD	0,89%	0,89%
Clase de reparto I2 USD	0,75%	0,75%
Clase de acumulación I5 USD	0,54%	0,54%
Clase de acumulación M USD	2,40%	2,40%
Clase de reparto M USD	2,40%	2,40%
Clase de acumulación Z USD	0,19%	0,19%

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

Clase de acumulación I2 AUD	0,93%	0,68%
Clase de acumulación I NOK	1,07%	0,80%
Clase de acumulación I3 NOK	0,86%	0,62%
Clase de acumulación I USD	1,06%	0,80%
Clase de acumulación I2 USD	0,93%	0,68%
Clase de acumulación Z USD	0,46%	0,20%

Emerging Markets Equity

Clase de acumulación B AUD	3,55%	3,30%
Clase de acumulación E AUD	3,57%	3,30%
Clase de acumulación T AUD	2,55%	2,30%
Clase de reparto sin cobertura I CAD	1,55%	1,30%
Clase de reparto I2 CAD	1,35%	1,10%
Clase de acumulación I EUR	1,52%	1,30%
Clase de acumulación M EUR	3,55%	3,30%
Clase de acumulación Z EUR	0,54%	0,30%
Clase de acumulación I GBP	1,56%	1,30%
Clase de acumulación Z GBP	0,54%	0,30%
Clase de acumulación A USD	2,56%	2,30%
Clase de acumulación B USD	3,53%	3,30%
Clase de acumulación E USD	3,52%	3,31%
Clase de acumulación I USD	1,54%	1,30%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

Emerging Markets Equity (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación M USD	3,49%	3,30%
Clase de acumulación T USD	2,54%	2,30%
Clase de acumulación Z USD	0,54%	0,30%
Clase de acumulación B ZAR	3,53%	3,30%
Clase de acumulación E ZAR	3,56%	3,31%
Clase de acumulación T ZAR	2,55%	2,30%

Euro Bond

Clase de acumulación I EUR	1,61%	0,55%
Clase de reparto I EUR	1,65%	0,55%
Clase de acumulación Z EUR	0,98%	0,20%

Euro Bond Absolute Return

Clase de acumulación I EUR	0,82%	0,65%
Clase de reparto I EUR	0,87%	0,65%
Clase de acumulación I5 EUR	0,64%	0,43%
Clase de acumulación Z EUR	0,29%	0,20%
Clase de acumulación Z USD	0,42%	0,20%

European High Yield Bond

Clase de acumulación I CHF	0,74%	0,73%
Clase de acumulación I EUR	0,73%	0,72%
Clase de acumulación I2 EUR	0,58%	0,58%
Clase de acumulación M EUR	1,95%	1,94%
Clase de acumulación X EUR	0,33%	0,32%
Clase de acumulación Y EUR	0,22%	0,22%
Clase de reparto Y EUR	0,24%	0,23%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,34%	1,33%
Clase de acumulación I USD	0,76%	0,75%
Clase de acumulación X USD	0,36%	0,35%
Clase de acumulación Z USD	0,16%	0,14%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

European Sustainable Equity

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de reparto A EUR	1,62%	1,62%
Clase de acumulación I EUR	0,73%	0,73%
Clase de reparto I EUR	0,71%	0,71%
Clase de reparto I3 EUR	0,55%	0,55%
Clase de acumulación I5 EUR	0,43%	0,43%
Clase de acumulación M EUR	2,44%	2,44%
Clase de acumulación Z EUR	0,13%	0,13%
Clase de acumulación sin cobertura A USD	1,61%	1,61%
Clase de acumulación sin cobertura I USD	0,71%	0,71%
Clase de acumulación sin cobertura M USD	2,41%	2,41%

Event Driven

Clase de acumulación I EUR	1,24%	1,20%
Clase de reparto I5 EUR	0,68%	0,68%
Clase de acumulación I5 GBP	0,75%	0,70%
Clase de reparto I5 GBP	0,76%	0,70%
Clase de acumulación P GBP	1,20%	1,15%
Clase de acumulación I USD	1,22%	1,18%
Clase de acumulación I5 USD	0,75%	0,70%

Global Bond

Clase de reparto (mensual) T AUD	1,07%	0,96%
Clase de acumulación I EUR - Índice con Cobertura	0,50%	0,40%
Clase de acumulación C1 USD	1,74%	1,60%
Clase de acumulación I USD - Índice con Cobertura	0,42%	0,29%
Clase de acumulación I USD	0,55%	0,40%
Clase de acumulación M USD	1,13%	1,00%
Clase de reparto (mensual) T USD	1,09%	0,95%
Clase de acumulación Z USD	0,33%	0,20%
Clase de reparto (mensual) T ZAR	1,07%	0,96%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

Global Diversified Income FMP – 2024

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación A EUR	0,90%	0,90%
Clase de reparto A EUR	0,90%	0,90%
Clase de reparto I EUR	0,50%	0,50%
Clase de reparto I GBP	0,50%	0,50%
Clase de reparto A HKD	0,90%	0,90%
Clase de reparto A SGD	0,90%	0,90%
Clase de acumulación A USD	0,90%	0,90%
Clase de reparto A USD	0,90%	0,90%
Clase de acumulación I USD	0,51%	0,51%
Clase de reparto I USD	0,51%	0,51%
Clase de acumulación X USD	0,56%	0,56%
Clase de reparto X USD	0,55%	0,55%

Global Equity Megatrends

Clase de acumulación I EUR	0,97%	0,97%
Clase de acumulación sin cobertura M EUR	2,64%	2,64%
Clase de acumulación sin cobertura I4 GBP	0,64%	0,64%
Clase de reparto sin cobertura I4 GBP	0,61%	0,61%
Clase de acumulación sin cobertura P GBP	0,95%	0,95%
Clase de acumulación A SGD	1,76%	1,76%
Clase de acumulación A USD	1,84%	1,84%
Clase de acumulación C1 USD	2,86%	2,86%
Clase de acumulación I USD	1,01%	1,01%
Clase de acumulación I4 USD	0,64%	0,64%
Clase de acumulación M USD	2,65%	2,65%
Clase de acumulación Z USD	0,19%	0,19%

Global Flexible Credit Income

Clase de acumulación I5 CAD	0,41%	0,41%
Clase de acumulación I EUR	0,71%	0,71%
Clase de acumulación M EUR	2,11%	2,11%
Clase de acumulación I5 GBP	0,41%	0,41%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

Global Flexible Credit Income (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de reparto (mensual) A USD	1,30%	1,30%
Clase de acumulación A USD	1,31%	1,31%
Clase de acumulación I USD	0,71%	0,71%
Clase de reparto I USD	0,71%	0,71%
Clase de acumulación M USD	2,11%	2,11%
Clase de acumulación Z USD	0,11%	0,11%

Global High Yield SDG Engagement

Clase de reparto I AUD	0,72%	0,70%
Clase de acumulación I4 AUD	0,47%	0,47%
Clase de acumulación I4 CHF	0,50%	0,47%
Clase de reparto I4 CHF	0,50%	0,47%
Clase de acumulación X CHF	1,22%	1,20%
Clase de acumulación I4 EUR	0,50%	0,47%
Clase de reparto I4 EUR	0,50%	0,47%
Clase de acumulación X EUR	1,22%	1,20%
Clase de acumulación Z (PF) EUR	0,23%	0,20%
Clase de acumulación I4 GBP	0,50%	0,47%
Clase de acumulación X GBP	1,22%	1,20%
Clase de acumulación A USD	1,32%	1,30%
Clase de acumulación I USD	0,73%	0,70%
Clase de acumulación I4 USD	0,50%	0,47%
Clase de reparto M USD	1,93%	1,90%
Clase de acumulación X USD	1,20%	1,20%
Clase de acumulación Z USD	0,13%	0,10%

Global Investment Grade Credit

Clase de acumulación I EUR	0,49%	0,45%
Clase de acumulación I USD	0,50%	0,45%
Clase de acumulación X USD	0,30%	0,25%
Clase de acumulación Z USD	0,18%	0,15%

Global Opportunistic Bond

Clase de acumulación I EUR	0,79%	0,50%
----------------------------	-------	-------

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

Global Opportunistic Bond (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación P GBP	0,79%	0,48%
Clase de acumulación A USD	1,06%	0,80%
Clase de acumulación I USD	0,80%	0,50%
Clase de reparto I USD	0,80%	0,50%
Clase de acumulación I2 USD	0,74%	0,44%
Clase de acumulación Z USD	0,50%	0,20%

Global Real Estate Securities

Clase de acumulación M EUR	3,52%	2,80%
Clase de acumulación sin cobertura Z EUR	1,03%	0,30%
Clase de acumulación Z GBP	1,02%	0,30%
Clase de acumulación A USD	2,53%	1,80%
Clase de acumulación CI USD	3,52%	2,80%
Clase de acumulación I USD	1,77%	1,05%
Clase de reparto I5 USD	1,21%	0,68%
Clase de acumulación M USD	3,53%	2,80%
Clase de acumulación Z USD	1,04%	0,30%

Global Sustainable Equity

Clase de acumulación sin cobertura I5 EUR	0,45%	0,45%
Clase de acumulación sin cobertura M EUR	2,45%	2,45%
Clase de acumulación sin cobertura Z EUR	0,15%	0,15%
Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,74%	0,74%
Clase de acumulación sin cobertura I5 GBP	0,45%	0,45%
Clase de acumulación A USD	1,66%	1,66%
Clase de acumulación I USD	0,75%	0,75%
Clase de reparto I USD	0,73%	0,73%
Clase de acumulación M USD	2,45%	2,45%
Clase de acumulación Z USD	0,15%	0,15%

Global Sustainable Value

Clase de acumulación M EUR	2,12%	1,99%
----------------------------	-------	-------

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

Global Sustainable Value (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación sin cobertura I5 GBP	0,56%	0,45%
Clase de acumulación sin cobertura P GBP	0,77%	0,66%
Clase de acumulación A USD	1,31%	1,18%
Clase de acumulación I USD	0,85%	0,73%
Clase de acumulación I3 USD	0,73%	0,60%
Clase de acumulación Z USD	0,41%	0,28%

High Yield Bond

Clase de reparto (mensual) A AUD	1,31%	1,31%
Clase de acumulación A AUD	1,31%	1,31%
Clase de reparto (mensual) B AUD	2,91%	2,91%
Clase de acumulación B AUD	2,91%	2,91%
Clase de reparto (mensual) E AUD	2,91%	2,91%
Clase de acumulación E AUD	2,91%	2,91%
Clase de reparto I AUD	0,71%	0,71%
Clase de reparto (mensual) T AUD	1,91%	1,91%
Clase de reparto (semanal) T AUD	1,91%	1,91%
Clase de acumulación T AUD	1,91%	1,91%
Clase de reparto (mensual) A CAD	1,31%	1,31%
Clase de acumulación A CHF	1,31%	1,31%
Clase de acumulación I CHF	0,71%	0,71%
Clase de acumulación I2 CHF	0,61%	0,61%
Clase de reparto (mensual) A CNY	1,31%	1,31%
Clase de reparto (mensual) I CNY	0,71%	0,71%
Clase de reparto (mensual) A EUR	1,31%	1,31%
Clase de acumulación A EUR	1,32%	1,32%
Clase de reparto A EUR	1,31%	1,31%
Clase de acumulación I EUR	0,71%	0,71%
Clase de reparto I EUR	0,71%	0,71%
Clase de acumulación I2 EUR	0,61%	0,61%
Clase de reparto I2 EUR	0,61%	0,61%
Clase de acumulación M EUR	1,91%	1,91%
Clase de acumulación Z EUR	0,11%	0,11%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

High Yield Bond (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de reparto (mensual) A GBP	1,31%	1,31%
Clase de acumulación A GBP	1,31%	1,31%
Clase de reparto A GBP	1,31%	1,31%
Clase de acumulación I GBP	0,71%	0,71%
Clase de reparto I GBP	0,71%	0,71%
Clase de acumulación I2 GBP	0,61%	0,61%
Clase de reparto I2 GBP	0,61%	0,61%
Clase de acumulación Z GBP	0,11%	0,11%
Clase de reparto (mensual) A HKD	1,31%	1,31%
Clase de acumulación A SEK	1,30%	1,30%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,31%	1,31%
Clase de acumulación A SGD	1,31%	1,31%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,31%	1,31%
Clase de reparto (semanal) A USD	1,31%	1,31%
Clase de acumulación A USD	1,31%	1,31%
Clase de reparto A USD	1,31%	1,31%
Clase de reparto (mensual) B USD	2,91%	2,91%
Clase de acumulación B USD	2,91%	2,91%
Clase de acumulación C USD	1,91%	1,91%
Clase de acumulación C1 USD	2,31%	2,31%
Clase de reparto C1 USD	2,31%	2,31%
Clase de reparto (mensual) E USD	2,91%	2,91%
Clase de acumulación E USD	2,91%	2,91%
Clase de reparto (mensual) I USD	0,71%	0,71%
Clase de acumulación I USD	0,71%	0,71%
Clase de reparto I USD	0,71%	0,71%
Clase de reparto (mensual) I2 USD	0,61%	0,61%
Clase de acumulación I2 USD	0,61%	0,61%
Clase de reparto I2 USD	0,61%	0,61%
Clase de reparto (mensual) I4 USD	0,47%	0,47%
Clase de acumulación M USD	1,91%	1,91%
Clase de reparto M USD	1,91%	1,91%
Clase de acumulación P USD	0,69%	0,69%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

High Yield Bond (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de reparto (mensual) T USD	1,91%	1,91%
Clase de reparto (semanal) T USD	1,91%	1,91%
Clase de acumulación T USD	1,91%	1,91%
Clase de reparto (mensual) U USD	1,01%	1,01%
Clase de acumulación U USD	1,01%	1,01%
Clase de acumulación Z USD	0,11%	0,11%
Clase de reparto (mensual) B ZAR	2,91%	2,91%
Clase de reparto (mensual) E ZAR	2,91%	2,91%
Clase de acumulación E ZAR	2,91%	2,91%
Clase de reparto (mensual) T ZAR	1,91%	1,91%
Clase de acumulación T ZAR	1,91%	1,91%

InnovAsia 5G

Clase de acumulación I4 CHF	1,30%	0,71%
Clase de acumulación A EUR	2,83%	1,90%
Clase de acumulación I4 EUR	1,29%	0,71%
Clase de acumulación sin cobertura M EUR	3,30%	2,70%
Clase de acumulación X EUR	2,24%	1,65%
Clase de acumulación A SGD	2,53%	1,90%
Clase de acumulación I4 SGD	1,31%	0,71%
Clase de acumulación X SGD	2,24%	1,65%
Clase de acumulación A USD	2,46%	1,90%
Clase de acumulación I USD	1,65%	1,05%
Clase de acumulación I4 USD	1,31%	0,71%
Clase de acumulación M USD	3,30%	2,70%
Clase de acumulación X USD	2,28%	1,65%

Japan Equity Engagement

Clase de reparto I5 EUR	0,58%	0,58%
Clase de acumulación sin cobertura I5 GBP	0,64%	0,64%
Clase de acumulación sin cobertura P GBP	1,03%	1,03%
Clase de acumulación A JPY	1,90%	1,90%
Clase de acumulación I JPY	1,07%	1,07%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

Japan Equity Engagement (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de reparto I JPY	1,06%	1,06%
Clase de acumulación I5 JPY	0,64%	0,64%
Clase de acumulación Z JPY	0,20%	0,20%
Clase de acumulación A USD	1,90%	1,90%
Clase de acumulación I USD	1,05%	1,05%

Next Generation Mobility

Clase de acumulación A EUR	1,90%	1,90%
Clase de acumulación I EUR	1,04%	1,04%
Clase de acumulación sin cobertura I EUR	1,04%	1,04%
Clase de acumulación sin cobertura M EUR	2,70%	2,70%
Clase de acumulación A USD	1,90%	1,90%
Clase de acumulación C1 USD	2,90%	2,90%
Clase de acumulación I USD	1,04%	1,04%
Clase de reparto I USD	1,04%	1,04%
Clase de acumulación M USD	2,70%	2,70%
Clase de acumulación X USD	1,75%	1,75%

Next Generation Space Economy

Clase de acumulación sin cobertura I3 EUR	1,28%	0,80%
Clase de acumulación sin cobertura M EUR	3,19%	2,70%
Clase de acumulación I USD	1,53%	1,05%

Responsible Asian Debt – Hard Currency

Clase de reparto (mensual) A USD	1,77%	1,35%
Clase de acumulación A USD	1,73%	1,35%
Clase de acumulación C1 USD	2,74%	2,35%
Clase de acumulación I USD	1,13%	0,75%
Clase de reparto I USD	1,13%	0,75%
Clase de reparto (mensual) I4 USD	0,89%	0,52%
Clase de acumulación I4 USD	0,88%	0,51%
Clase de acumulación M USD	2,32%	1,95%
Clase de reparto (mensual) X USD	1,63%	1,25%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

Responsible Asian Debt – Hard Currency (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación X USD	1,62%	1,25%
Clase de acumulación Z USD	0,51%	0,15%

Short Duration Emerging Market Debt

Clase de reparto (mensual) A AUD	1,08%	1,08%
Clase de reparto (mensual) A CAD	1,09%	1,09%
Clase de acumulación A CHF	1,08%	1,08%
Clase de reparto A CHF	1,08%	1,08%
Clase de acumulación I CHF	0,58%	0,58%
Clase de reparto I CHF	0,58%	0,58%
Clase de acumulación I2 CHF	0,48%	0,48%
Clase de reparto I2 CHF	0,48%	0,48%
Clase de acumulación I5 CHF	0,33%	0,33%
Clase de acumulación P CHF	0,55%	0,55%
Clase de acumulación A EUR	1,08%	1,08%
Clase de reparto A EUR	1,08%	1,08%
Clase de acumulación I EUR	0,58%	0,58%
Clase de reparto I EUR	0,58%	0,58%
Clase de acumulación I2 EUR	0,48%	0,48%
Clase de reparto I2 EUR	0,48%	0,48%
Clase de acumulación I5 EUR	0,33%	0,33%
Clase de acumulación M EUR	1,68%	1,68%
Clase de reparto M EUR	1,68%	1,68%
Clase de acumulación P EUR	0,56%	0,56%
Clase de acumulación U EUR	0,83%	0,83%
Clase de acumulación A GBP	1,08%	1,08%
Clase de acumulación I GBP	0,58%	0,58%
Clase de reparto I GBP	0,58%	0,58%
Clase de acumulación I2 GBP	0,48%	0,48%
Clase de reparto I2 GBP	0,48%	0,48%
Clase de reparto I5 GBP	0,33%	0,33%
Clase de acumulación P GBP	0,56%	0,56%
Clase de acumulación I JPY	0,58%	0,58%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

Short Duration Emerging Market Debt (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de reparto I JPY	0,58%	0,58%
Clase de acumulación A SEK	1,08%	1,08%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,08%	1,08%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,08%	1,08%
Clase de acumulación A USD	1,08%	1,08%
Clase de reparto A USD	1,08%	1,08%
Clase de acumulación C1 USD	2,08%	2,08%
Clase de reparto C1 USD	2,08%	2,08%
Clase de acumulación I USD	0,58%	0,58%
Clase de reparto I USD	0,58%	0,58%
Clase de acumulación I2 USD	0,48%	0,48%
Clase de reparto I2 USD	0,48%	0,48%
Clase de acumulación I5 USD	0,33%	0,33%
Clase de reparto I5 USD	0,33%	0,33%
Clase de acumulación M USD	1,68%	1,68%
Clase de reparto M USD	1,68%	1,68%
Clase de acumulación P USD	0,56%	0,56%
Clase de acumulación Z USD	0,08%	0,08%

Short Duration High Yield SDG Engagement

Clase de reparto (mensual) A AUD	1,32%	1,32%
Clase de acumulación A CHF	1,32%	1,32%
Clase de acumulación I CHF	0,72%	0,72%
Clase de reparto (mensual) A CNY	1,32%	1,32%
Clase de acumulación A EUR	1,32%	1,32%
Clase de reparto A EUR	1,32%	1,32%
Clase de acumulación I EUR	0,72%	0,72%
Clase de acumulación I2 EUR	0,62%	0,62%
Clase de acumulación M EUR	1,92%	1,92%
Clase de reparto M EUR	1,92%	1,92%
Clase de acumulación I GBP	0,72%	0,72%
Clase de reparto I GBP	0,72%	0,72%
Clase de acumulación I2 GBP	0,62%	0,62%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

Short Duration High Yield SDG Engagement (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de reparto I2 GBP	0,62%	0,62%
Clase de reparto (mensual) A HKD	1,33%	1,33%
Clase de acumulación I JPY	0,72%	0,72%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,32%	1,32%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,32%	1,32%
Clase de acumulación A USD	1,32%	1,32%
Clase de reparto A USD	1,32%	1,32%
Clase de acumulación C1 USD	2,33%	2,33%
Clase de acumulación I USD	0,72%	0,72%
Clase de reparto I USD	0,72%	0,72%
Clase de acumulación I2 USD	0,63%	0,63%
Clase de reparto I2 USD	0,62%	0,62%
Clase de acumulación I4 USD	0,48%	0,48%
Clase de acumulación I5 USD	0,42%	0,42%
Clase de acumulación M USD	1,92%	1,92%
Clase de reparto M USD	1,93%	1,93%
Clase de acumulación Z USD	0,12%	0,12%

Strategic Income

Clase de reparto (mensual) A AUD	1,09%	1,09%
Clase de reparto (mensual) E AUD	2,09%	2,09%
Clase de reparto (mensual) Z AUD	0,10%	0,10%
Clase de reparto (mensual) A CNY	1,09%	1,09%
Clase de reparto (mensual) A EUR	1,10%	1,10%
Clase de acumulación A EUR	1,10%	1,10%
Clase de acumulación I EUR	0,60%	0,60%
Clase de acumulación M EUR	1,70%	1,70%
Clase de reparto (mensual) A GBP	1,09%	1,09%
Clase de reparto (mensual) I GBP	0,59%	0,59%
Clase de reparto (mensual) A HKD	1,09%	1,09%
Clase de reparto (mensual) A JPY	1,09%	1,09%
Clase de acumulación I JPY	0,60%	0,60%
Clase de acumulación sin cobertura I JPY	0,60%	0,60%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

Strategic Income (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de reparto CG I JPY	0,61%	0,61%
Clase de reparto I JPY	0,60%	0,60%
Clase de acumulación Z JPY	0,10%	0,10%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,09%	1,09%
Clase de acumulación A SGD	1,10%	1,10%
Clase de reparto (mensual) I SGD	0,60%	0,60%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,09%	1,09%
Clase de acumulación A USD	1,10%	1,10%
Clase de reparto A USD	1,10%	1,10%
Clase de acumulación C1 USD	2,10%	2,10%
Clase de reparto (mensual) E USD	2,09%	2,09%
Clase de acumulación I USD	0,60%	0,60%
Clase de reparto I USD	0,60%	0,60%
Clase de acumulación M USD	1,70%	1,70%
Clase de reparto M USD	1,70%	1,70%
Clase de acumulación Z USD	0,10%	0,10%
Clase de reparto (mensual) A ZAR	1,06%	1,06%
Clase de reparto (mensual) E ZAR	2,09%	2,09%

Sustainable Asia High Yield

Clase de reparto (mensual) A USD	1,85%	1,40%
Clase de acumulación A USD	1,86%	1,40%
Clase de acumulación I USD	1,24%	0,80%
Clase de acumulación Z USD	0,65%	0,20%
Clase de reparto Z USD	0,65%	0,20%

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

Clase de acumulación I CHF	1,11%	1,00%
Clase de acumulación A EUR	1,93%	1,80%
Clase de acumulación I EUR	1,15%	1,00%
Clase de acumulación I3 EUR	0,80%	0,68%
Clase de acumulación M EUR	2,72%	2,60%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de reparto M EUR	2,72%	2,60%
Clase de acumulación X EUR	0,74%	0,53%
Clase de acumulación I GBP	1,10%	1,00%
Clase de acumulación A SEK	1,92%	1,80%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,92%	1,80%
Clase de acumulación A USD	1,92%	1,80%
Clase de acumulación C1 USD	2,93%	2,80%
Clase de acumulación I USD	1,12%	1,00%
Clase de reparto I USD	1,12%	1,00%
Clase de acumulación I2 USD	0,96%	0,84%
Clase de acumulación M USD	2,73%	2,60%
Clase de reparto M USD	2,72%	2,60%

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency

Clase de acumulación I3 EUR	0,57%	0,57%
Clase de acumulación I4 EUR	0,50%	0,50%
Clase de acumulación X EUR	0,43%	0,44%
Clase de acumulación I USD	0,76%	0,76%
Clase de acumulación I5 USD	0,43%	0,43%

Tactical Macro¹

Clase de acumulación I5 EUR	0,80%	0,60%
Clase de acumulación I USD	1,29%	1,00%
Clase de acumulación I5 USD	0,82%	0,60%
Clase de acumulación Z USD	0,47%	0,20%

Ultra Short Term Euro Bond

Clase de acumulación P CHF	0,26%	0,26%
Clase de acumulación U CHF	0,37%	0,37%
Clase de acumulación A EUR	0,45%	0,45%
Clase de acumulación I EUR	0,27%	0,27%
Clase de reparto I EUR	0,27%	0,27%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

Ultra Short Term Euro Bond (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación I2 EUR	0,23%	0,23%
Clase de acumulación I5 EUR	0,17%	0,17%
Clase de acumulación M EUR	0,65%	0,65%
Clase de acumulación U EUR	0,37%	0,37%
Clase de acumulación Z EUR	0,08%	0,08%
Clase de acumulación I USD	0,27%	0,27%
Clase de acumulación Z USD	0,08%	0,08%

Uncorrelated Strategies

Clase de acumulación I CHF	1,76%	1,75%
Clase de acumulación A EUR	2,51%	2,50%
Clase de acumulación I EUR	1,75%	1,74%
Clase de acumulación I2 EUR	1,60%	1,59%
Clase de acumulación M EUR	3,31%	3,30%
Clase de acumulación P EUR	1,72%	1,71%
Clase de acumulación I GBP	1,75%	1,74%
Clase de acumulación I2 GBP	1,60%	1,59%
Clase de reparto I2 GBP	1,60%	1,56%
Clase de acumulación I5 GBP	1,39%	1,38%
Clase de acumulación P GBP	1,71%	1,70%
Clase de acumulación Z GBP	1,00%	0,98%
Clase de acumulación I JPY	1,75%	1,73%
Clase de acumulación A SGD	1,90%	1,81%
Clase de acumulación A USD	2,51%	2,49%
Clase de acumulación C1 USD	3,51%	3,50%
Clase de acumulación I USD	1,75%	1,74%
Clase de acumulación I2 USD	1,60%	1,58%
Clase de acumulación I5 USD	1,37%	1,36%
Clase de acumulación M USD	3,31%	3,30%
Clase de acumulación P USD	1,71%	1,70%
Clase de acumulación Z USD	1,01%	1,00%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

US Equity

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación I5 EUR	0,63%	0,58%
Clase de acumulación sin cobertura I5 EUR	0,60%	0,57%
Clase de reparto sin cobertura I5 EUR	0,60%	0,57%
Clase de acumulación sin cobertura X EUR	0,38%	0,25%
Clase de reparto sin cobertura I5 GBP	0,60%	0,57%
Clase de acumulación sin cobertura X GBP	0,33%	0,24%
Clase de acumulación I3 JPY	0,85%	0,73%
Clase de acumulación A USD	1,79%	1,70%
Clase de acumulación I USD	1,04%	0,95%
Clase de reparto I USD	1,08%	0,95%
Clase de acumulación I5 USD	0,61%	0,58%
Clase de reparto I5 USD	0,63%	0,58%
Clase de acumulación M USD	2,62%	2,50%
Clase de acumulación X USD	0,33%	0,24%

US Equity Index PutWrite

Clase de acumulación I EUR	0,69%	0,69%
Clase de reparto I3 EUR	0,52%	0,52%
Clase de acumulación I4 EUR	0,46%	0,46%
Clase de reparto I4 EUR	0,44%	0,44%
Clase de acumulación M EUR	2,10%	2,10%
Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,70%	0,70%
Clase de acumulación I3 GBP	0,52%	0,52%
Clase de reparto I3 GBP	0,52%	0,52%
Clase de reparto sin cobertura I3 GBP	0,49%	0,49%
Clase de acumulación sin cobertura I4 GBP	0,46%	0,46%
Clase de reparto I4 GBP	0,45%	0,45%
Clase de reparto sin cobertura P GBP	0,67%	0,67%
Clase de acumulación sin cobertura X GBP	0,42%	0,42%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,29%	1,29%
Clase de acumulación A USD	1,30%	1,30%
Clase de reparto (mensual) I USD	0,70%	0,70%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

US Equity Index PutWrite (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación I USD	0,70%	0,70%
Clase de reparto I3 USD	0,52%	0,52%
Clase de acumulación I4 USD	0,46%	0,46%
Clase de acumulación M USD	2,10%	2,10%
Clase de acumulación Z USD	0,10%	0,10%

US Large Cap Value

Clase de acumulación A EUR	1,59%	1,59%
Clase de acumulación sin cobertura A EUR	1,59%	1,59%
Clase de acumulación I EUR	0,79%	0,79%
Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,79%	0,79%
Clase de reparto sin cobertura I4 EUR	0,51%	0,51%
Clase de acumulación sin cobertura I5 EUR	0,44%	0,44%
Clase de acumulación I GBP	0,78%	0,78%
Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,79%	0,79%
Clase de reparto I GBP	0,79%	0,79%
Clase de reparto sin cobertura I GBP	0,79%	0,79%
Clase de reparto sin cobertura I4 GBP	0,51%	0,51%
Clase de acumulación sin cobertura P GBP	0,76%	0,76%
Clase de reparto P GBP	0,75%	0,75%
Clase de acumulación sin cobertura Y GBP	0,72%	0,72%
Clase de reparto sin cobertura Y GBP	0,72%	0,72%
Clase de acumulación A USD	1,59%	1,59%
Clase de acumulación I USD	0,79%	0,79%
Clase de reparto I4 USD	0,51%	0,51%
Clase de acumulación I5 USD	0,43%	0,43%
Clase de acumulación M USD	2,39%	2,39%
Clase de acumulación Y USD	0,71%	0,71%
Clase de acumulación Z USD	0,10%	0,10%

US Long Short Equity

Clase de acumulación A EUR	2,46%	2,46%
----------------------------	-------	-------

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

US Long Short Equity (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación I EUR	1,54%	1,54%
Clase de acumulación I3 EUR	1,15%	1,15%
Clase de acumulación sin cobertura I3 EUR	1,08%	1,08%
Clase de acumulación M EUR	3,26%	3,26%
Clase de reparto I3 GBP	1,15%	1,15%
Clase de acumulación A1 SGD	2,01%	2,01%
Clase de acumulación A (PF) USD	1,91%	1,91%
Clase de acumulación A USD	2,46%	2,46%
Clase de acumulación A1 USD	2,01%	2,01%
Clase de reparto I (PF) USD	1,21%	1,21%
Clase de acumulación I USD	1,56%	1,56%
Clase de acumulación I3 USD	1,15%	1,15%
Clase de acumulación M USD	3,26%	3,26%
Clase de acumulación U USD	2,00%	2,00%
Clase de acumulación Z USD	0,20%	0,20%

US Multi Cap Opportunities

Clase de acumulación E AUD	3,00%	3,00%
Clase de acumulación T AUD	2,00%	2,00%
Clase de acumulación I3 EUR	0,69%	0,69%
Clase de acumulación M EUR	2,90%	2,90%
Clase de acumulación A EUR1	1,90%	1,90%
Clase de acumulación I EUR1	1,05%	1,05%
Clase de reparto I3 GBP	0,66%	0,66%
Clase de reparto sin cobertura I3 GBP	0,68%	0,68%
Clase de acumulación A SGD	1,90%	1,90%
Clase de acumulación B USD	3,00%	3,00%
Clase de acumulación C1 USD	2,90%	2,90%
Clase de acumulación E USD	3,00%	3,00%
Clase de acumulación I2 USD	0,86%	0,86%
Clase de acumulación I3 USD	0,69%	0,69%
Clase de acumulación M USD	2,90%	2,90%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

US Multi Cap Opportunities (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación T USD	2,00%	2,00%
Clase de acumulación U USD	1,45%	1,45%
Clase de acumulación Z USD	0,19%	0,19%
Clase de acumulación A USD1	1,90%	1,90%
Clase de acumulación I USD1	1,05%	1,05%
Clase de reparto I USD1	1,04%	1,04%
Clase de acumulación B ZAR	3,00%	3,00%
Clase de acumulación E ZAR	3,00%	3,00%
Clase de acumulación T ZAR	2,00%	2,00%

US Real Estate Securities

Clase de reparto (mensual) A AUD	1,70%	1,70%
Clase de reparto (mensual) B AUD	3,00%	3,00%
Clase de acumulación B AUD	3,00%	3,00%
Clase de reparto (mensual) E AUD	3,00%	3,00%
Clase de acumulación E AUD	3,01%	3,01%
Clase de reparto (mensual) T AUD	2,00%	2,00%
Clase de acumulación T AUD	2,00%	2,00%
Clase de acumulación A CHF	1,70%	1,70%
Clase de acumulación A EUR	1,70%	1,70%
Clase de acumulación I EUR	0,94%	0,94%
Clase de acumulación M EUR	2,70%	2,70%
Clase de reparto (mensual) A HKD	1,70%	1,70%
Clase de acumulación A SGD	1,70%	1,70%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,70%	1,70%
Clase de acumulación A USD	1,70%	1,70%
Clase de reparto A USD	1,70%	1,70%
Clase de reparto (mensual) B USD	3,00%	3,00%
Clase de acumulación B USD	3,00%	3,00%
Clase de acumulación C1 USD	2,70%	2,70%
Clase de reparto (mensual) E USD	3,00%	3,00%
Clase de acumulación E USD	3,00%	3,00%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

US Real Estate Securities (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de reparto (mensual) I USD	0,95%	0,95%
Clase de acumulación I USD	0,95%	0,95%
Clase de reparto I USD	0,95%	0,95%
Clase de acumulación I2 USD	0,74%	0,74%
Clase de acumulación M USD	2,70%	2,70%
Clase de reparto (mensual) T USD	2,00%	2,00%
Clase de acumulación T USD	2,00%	2,00%
Clase de acumulación Z USD	0,20%	0,20%
Clase de reparto (mensual) B ZAR	3,00%	3,00%
Clase de acumulación B ZAR	3,00%	3,00%
Clase de reparto (mensual) E ZAR	3,00%	3,00%
Clase de acumulación E ZAR	3,00%	3,00%
Clase de reparto (mensual) T ZAR	2,00%	2,00%
Clase de acumulación T ZAR	2,00%	2,00%

US Small Cap

Clase de acumulación B AUD	2,93%	2,93%
Clase de acumulación E AUD	2,93%	2,93%
Clase de acumulación T AUD	1,93%	1,93%
Clase de acumulación A EUR	1,83%	1,83%
Clase de acumulación sin cobertura A EUR	1,83%	1,83%
Clase de acumulación I EUR	0,98%	0,98%
Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,97%	0,97%
Clase de acumulación sin cobertura I2 EUR	0,81%	0,81%
Clase de acumulación sin cobertura I4 EUR	0,64%	0,64%
Clase de acumulación M EUR	2,83%	2,83%
Clase de acumulación Z EUR	0,13%	0,13%
Clase de reparto sin cobertura I JPY	0,98%	0,98%
Clase de acumulación A USD	1,83%	1,83%
Clase de reparto A USD	1,83%	1,83%
Clase de acumulación B USD	2,93%	2,93%
Clase de acumulación E USD	2,93%	2,93%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2024 (cont.)

US Small Cap (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación I USD	0,98%	0,98%
Clase de reparto I USD	0,98%	0,98%
Clase de acumulación I3 USD	0,73%	0,73%
Clase de acumulación M USD	2,83%	2,83%
Clase de acumulación T USD	1,93%	1,93%
Clase de acumulación Z USD	0,13%	0,13%
Clase de acumulación E ZAR	2,93%	2,93%
Clase de acumulación T ZAR	1,93%	1,93%

US Small Cap Intrinsic Value

Clase de acumulación I3 EUR	0,69%	0,69%
Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,98%	0,98%
Clase de acumulación sin cobertura I2 GBP	0,81%	0,81%
Clase de acumulación sin cobertura I3 JPY	0,72%	0,72%
Clase de acumulación A USD	1,83%	1,83%
Clase de acumulación I USD	0,98%	0,98%
Clase de acumulación I2 USD	0,81%	0,81%
Clase de acumulación M USD	2,82%	2,82%

¹ Cartera lanzada durante el ejercicio contable anterior.

Anexo II

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES

El Reglamento sobre las operaciones de financiación de valores introduce requisitos de información para las operaciones de financiación de valores y los *swaps* de rentabilidad total.

La definición de operación de financiación de valores se recoge en el apartado 11 del artículo 3 del Reglamento sobre las operaciones de financiación de valores, y reza así:

- un acuerdo de recompra o recompra inversa;
- préstamo de valores o de materias primas y toma de valores o materias primas en préstamo;
- una operación de compra-retroventa o venta-recompra; o
- una operación de préstamo con reposición de la garantía

Con fecha de 30 de junio de 2024, las siguientes Carteras mantenían *swaps* de rentabilidad total o acuerdos de recompra/recompra inversa como tipos de instrumento en el ámbito de aplicación del Reglamento sobre operaciones de financiación de valores:

CLO Income
Commodities
Corporate Hybrid Bond
Event Driven
Emerging Market Debt - Hard Currency
Global High Yield SDG Engagement
High Yield Bond
Short Duration Emerging Market Debt
Short Duration High Yield SDG Engagement
Strategic Income
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency
Tactical Macro
Uncorrelated Strategies
US Long Short Equity

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

CLO Income

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en *swaps* de rentabilidad total y en acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 es el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del Valor liquidativo (%)
<i>Swaps</i> de rentabilidad total – Activos	60.784	0,01
Acuerdos de recompra – Activos	34.500.000	7,81

Datos sobre la reutilización de las garantías:

La garantía de efectivo se recibe en la cuenta de depósito habilitada para la Cartera y, por consiguiente, no se realiza un seguimiento específico de la misma para determinar si se reutiliza. Por tanto, no puede verificarse debidamente la reutilización de cualquier garantía de efectivo.

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2024, la Cartera no había recibido ningún valor como garantía para los *swaps* de rentabilidad total y los acuerdos de recompra.

Las contrapartes de todos los *swaps* de rentabilidad total y acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
Goldman Sachs International	14.258
JPMorgan Chase Bank	46.526
State Street Bank	34.500.000

Custodia de la garantía recibida:

A 30 de junio de 2024, todas las garantías percibidas están bajo custodia del Depositario, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

CLO Income (cont.)

Datos agregados de las transacciones:

Los datos agregados de las transacciones con posiciones de garantías (incluido el efectivo) pignoradas/(recibidas) para el conjunto de los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 eran los siguientes:

	Tipo de garantía	Importe en USD*	Calidad**	Vencimiento (garantía)***	Moneda de la garantía	País de establecimiento de la contraparte****	Liquidación y compensación
Acuerdos de recompra							
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 0.75%, 15/02/2042	(4.926.675)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 1.38%, 15/11/2040	(703.414)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/02/2041	(4.926.667)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 2.25%, 15/05/2041	(4.926.676)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/02/2043	(4.926.625)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 15/11/2042	(4.926.686)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.38%, 15/05/2041	(4.926.685)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.75%, 15/02/2041	(4.926.640)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC

* Las garantías en efectivo pueden abarcar una combinación de instrumentos de *swaps*; por tanto, una parte de las garantías corresponde a acuerdos de *swap* que no entran en el ámbito de aplicación del Reglamento sobre operaciones de financiación de valores.

** Los activos o los pasivos en efectivo no disponen de calificación crediticia. El efectivo denominado en USD se considera de la máxima calidad debido a su naturaleza líquida.

*** La división se establece conforme a 7 periodos de vencimiento (<1 día, de 1 día a 1 semana, de 1 semana a 1 mes, de 1 mes a 3 meses, de 3 meses a 1 año, >1 año, vencimiento abierto). Las garantías de efectivo no tienen vencimiento.

**** El país coincide con la dirección de nuestra contraparte real.

El vencimiento de todas las posiciones de *swaps* de rentabilidad total a 30 de junio de 2024 se situaba entre 1 y 3 meses.

El vencimiento de todos los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 se situaba entre un día y una semana.

Custodia de la garantía otorgada:

No existían garantías mantenidas en cuentas separadas, conjuntas o de otro tipo a 30 de junio de 2024.

Rentabilidad/Costes:

Los costes de las operaciones de *swaps* de rentabilidad total y de acuerdos de recompra, si fuesen aplicables, no pueden determinarse por separado. Para estas inversiones, los costes de transacción se incluyen en el precio de compraventa y forman parte de la rentabilidad bruta de la inversión de cada Cartera. Las rentabilidades se determinan como las plusvalías/minusvalías materializadas y la variación en las plusvalías/minusvalías latentes de los contratos de *swap* durante el período analizado.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Commodities

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en *swaps* de rentabilidad total a 30 de junio de 2024 es el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del Valor liquidativo (%)
<i>Swaps</i> de rentabilidad total – Activos	68	0,00

Datos sobre la reutilización de las garantías:

La garantía de efectivo se recibe en la cuenta de depósito habilitada para la Cartera y, por consiguiente, no se realiza un seguimiento específico de la misma para determinar si se reutiliza. Por tanto, no puede verificarse debidamente la reutilización de cualquier garantía de efectivo.

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2024, la Cartera no había recibido ningún valor como garantía para los *swaps* de rentabilidad total.

Las contrapartes de todos los *swaps* de rentabilidad total a 30 de junio de 2024 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
Goldman Sachs International	68

Custodia de la garantía recibida:

A fecha de 30 de junio de 2024, el Depositario no había recibido ni mantenía garantía alguna.

Datos agregados de las transacciones:

A 30 de junio de 2024 no había posiciones de garantías (incluido el efectivo) pignoradas o (recibidas) para todos los *swaps* de rentabilidad total.

El vencimiento de todas las posiciones de *swaps* de rentabilidad total a 30 de junio de 2024 se situaba entre 1 y 3 meses.

Custodia de la garantía otorgada:

No existían garantías mantenidas en cuentas separadas, conjuntas o de otro tipo a 30 de junio de 2024.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Commodities (cont.)

Rentabilidad/Costes:

Los costes de las operaciones de *swaps* de rentabilidad total, si fuesen aplicables, no pueden determinarse por separado. Para estas inversiones, los costes de transacción se incluyen en el precio de compraventa y forman parte de la rentabilidad bruta de la inversión de cada Cartera. Las rentabilidades se determinan como las plusvalías/minusvalías materializadas y la variación en las plusvalías/minusvalías latentes de los contratos de *swap* durante el período analizado.

Corporate Hybrid Bond

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 era el siguiente:

Tipo de activo	Importe en EUR	Proporción del Valor liquidativo (%)
Acuerdos de recompra – Activos	29.391.183	1,43

Datos sobre la reutilización de las garantías:

La garantía de efectivo se recibe en la cuenta de depósito habilitada para la Cartera y, por consiguiente, no se realiza un seguimiento específico de la misma para determinar si se reutiliza. Por tanto, no puede verificarse debidamente la reutilización de cualquier garantía de efectivo.

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2024, la Cartera no había recibido ningún valor como garantía para los acuerdos de recompra de rentabilidad total.

Las contrapartes de todos los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en EUR
State Street Bank	29.391.183

Custodia de la garantía recibida:

A 30 de junio de 2024, todas las garantías percibidas están bajo custodia del Depositario, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Corporate Hybrid Bond (cont.)

Datos agregados de las transacciones:

Los datos agregados de las transacciones con posiciones de garantías (incluido el efectivo) pignoradas/(recibidas) para el conjunto de los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 eran los siguientes:

	Tipo de garantía	Importe en USD*	Calidad**	Vencimiento (garantía)***	Moneda de la garantía	País de establecimiento de la contraparte****	Liquidación y compensación
Acuerdos de recompra							
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 0.75%, 15/02/2042	(4.498.304)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 1.38%, 15/11/2040	(917.134)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/02/2041	(4.498.238)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 2.25%, 15/05/2041	(4.498.238)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/02/2043	(4.498.265)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 15/11/2042	(4.498.206)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.38%, 15/05/2041	(4.223.416)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.75%, 15/02/2041	(4.498.279)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC

* Las garantías en efectivo pueden abarcar una combinación de instrumentos de *swaps*; por tanto, una parte de las garantías corresponde a acuerdos de *swap* que no entran en el ámbito de aplicación del Reglamento sobre operaciones de financiación de valores.

** Los activos o los pasivos en efectivo no disponen de calificación crediticia. El efectivo denominado en USD se considera de la máxima calidad debido a su naturaleza líquida.

*** La división se establece conforme a 7 periodos de vencimiento (<1 día, de 1 día a 1 semana, de 1 semana a 1 mes, de 1 mes a 3 meses, de 3 meses a 1 año, >1 año, vencimiento abierto). Las garantías de efectivo no tienen vencimiento.

**** El país coincide con la dirección de nuestra contraparte real.

El vencimiento de todos los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 se situaba entre un día y una semana.

Custodia de la garantía otorgada:

No existían garantías mantenidas en cuentas separadas, conjuntas o de otro tipo a 30 de junio de 2024.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Corporate Hybrid Bond (cont.)

Rentabilidad/Costes:

Los costes de las operaciones de acuerdos de recompra, si fuesen aplicables, no pueden determinarse por separado. Para estas inversiones, los costes de transacción se incluyen en el precio de compraventa y forman parte de la rentabilidad bruta de la inversión de cada Cartera. Las rentabilidades se determinan como las plusvalías/minusvalías materializadas y la variación en las plusvalías/minusvalías latentes de los acuerdos de recompra durante el período analizado.

Event Driven

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en *swaps* de rentabilidad total a 30 de junio de 2024 es el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del Valor liquidativo (%)
<i>Swaps</i> de rentabilidad total – Activos	454.074	0,33

Datos sobre la reutilización de las garantías:

La garantía de efectivo se recibe en la cuenta de depósito habilitada para la Cartera y, por consiguiente, no se realiza un seguimiento específico de la misma para determinar si se reutiliza. Por tanto, no puede verificarse debidamente la reutilización de cualquier garantía de efectivo.

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2024, la Cartera no había recibido ningún valor como garantía para los *swaps* de rentabilidad total.

Las contrapartes de todos los *swaps* de rentabilidad total a 30 de junio de 2024 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
Morgan Stanley	454.074

Custodia de la garantía recibida:

A fecha de 30 de junio de 2024, el Depositario no había recibido ni mantenía garantía alguna.

Datos agregados de las transacciones:

A 30 de junio de 2024 no había posiciones de garantías (incluido el efectivo) pignoras o (recibidas) para todos los *swaps* de rentabilidad total.

El vencimiento de todas las posiciones de *swaps* de rentabilidad total a 30 de junio de 2024 se situaba entre 3 meses y 1 año.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Event Driven (cont.)

Custodia de la garantía otorgada:

No existían garantías mantenidas en cuentas separadas, conjuntas o de otro tipo a 30 de junio de 2024.

Rentabilidad/Costes:

Los costes de las operaciones de *swaps* de rentabilidad total, si fuesen aplicables, no pueden determinarse por separado. Para estas inversiones, los costes de transacción se incluyen en el precio de compraventa y forman parte de la rentabilidad bruta de la inversión de cada Cartera. Las rentabilidades se determinan como las plusvalías/minusvalías materializadas y la variación en las plusvalías/minusvalías latentes de los acuerdos de recompra durante el período analizado.

Emerging Market Debt - Hard Currency

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 era el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del Valor liquidativo (%)
Acuerdos de recompra – Activos	117.000.000	4,43

Datos sobre la reutilización de las garantías:

La garantía de efectivo se recibe en la cuenta de depósito habilitada para la Cartera y, por consiguiente, no se realiza un seguimiento específico de la misma para determinar si se reutiliza. Por tanto, no puede verificarse debidamente la reutilización de cualquier garantía de efectivo.

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2024, la Cartera no había recibido ningún valor como garantía para los acuerdos de recompra de rentabilidad total.

Las contrapartes de todos los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
State Street Bank	117.000.000

Custodia de la garantía recibida:

A 30 de junio de 2024, todas las garantías percibidas están bajo custodia del Depositario, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Emerging Market Debt - Hard Currency (cont.)

Datos agregados de las transacciones:

Los datos agregados de las transacciones con posiciones de garantías (incluido el efectivo) pignoradas/(recibidas) para el conjunto de los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 eran los siguientes:

	Tipo de garantía	Importe en USD*	Calidad**	Vencimiento (garantía)***	Moneda de la garantía	País de establecimiento de la contraparte****	Liquidación y compensación
Acuerdos de recompra							
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 0.75%, 15/02/2042	(16.707.634)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 1.38%, 15/11/2040	(2.386.470)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/02/2041	(16.707.642)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 2.25%, 15/05/2041	(16.707.618)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/02/2043	(16.707.676)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 15/11/2042	(16.707.643)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.38%, 15/05/2041	(16.707.643)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.75%, 15/02/2041	(16.707.694)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC

* Las garantías en efectivo pueden abarcar una combinación de instrumentos de *swaps*; por tanto, una parte de las garantías corresponde a acuerdos de *swap* que no entran en el ámbito de aplicación del Reglamento sobre operaciones de financiación de valores.

** Los activos o los pasivos en efectivo no disponen de calificación crediticia. El efectivo denominado en USD se considera de la máxima calidad debido a su naturaleza líquida.

*** La división se establece conforme a 7 períodos de vencimiento (<1 día, de 1 día a 1 semana, de 1 semana a 1 mes, de 1 mes a 3 meses, de 3 meses a 1 año, >1 año, vencimiento abierto). Las garantías de efectivo no tienen vencimiento.

**** El país coincide con la dirección de nuestra contraparte real.

El vencimiento de todos los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 se situaba entre un día y una semana.

Custodia de la garantía otorgada:

No existían garantías mantenidas en cuentas separadas, conjuntas o de otro tipo a 30 de junio de 2024.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Emerging Market Debt - Hard Currency (cont.)

Rentabilidad/Costes:

Los costes de las operaciones de acuerdos de recompra, si fuesen aplicables, no pueden determinarse por separado. Para estas inversiones, los costes de transacción se incluyen en el precio de compraventa y forman parte de la rentabilidad bruta de la inversión de cada Cartera. Las rentabilidades se determinan como las plusvalías/minusvalías materializadas y la variación en las plusvalías/minusvalías latentes de los acuerdos de recompra durante el período analizado.

Global High Yield SDG Engagement

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 era el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del Valor liquidativo (%)
Acuerdos de recompra – Activos	7.500.000	1,18

Datos sobre la reutilización de las garantías:

La garantía de efectivo se recibe en la cuenta de depósito habilitada para la Cartera y, por consiguiente, no se realiza un seguimiento específico de la misma para determinar si se reutiliza. Por tanto, no puede verificarse debidamente la reutilización de cualquier garantía de efectivo.

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2024, la Cartera no había recibido ningún valor como garantía para los acuerdos de recompra de rentabilidad total.

Las contrapartes de todos los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
State Street Bank	7.500.000

Custodia de la garantía recibida:

A 30 de junio de 2024, todas las garantías percibidas están bajo custodia del Depositario, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Global High Yield SDG Engagement (cont.)

Datos agregados de las transacciones:

Los datos agregados de las transacciones con posiciones de garantías (incluido el efectivo) pignoradas/(recibidas) para el conjunto de los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 eran los siguientes:

Tipo de garantía		Importe en USD*	Calidad**	Vencimiento (garantía)***	Moneda de la garantía	País de establecimiento de la contraparte****	Liquidación y compensación
Acuerdos de recompra							
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 0.75%, 15/02/2042	(1.071.104)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 1.38%, 15/11/2040	(152.685)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/02/2041	(1.071.012)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 2.25%, 15/05/2041	(1.071.029)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/02/2043	(1.071.097)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 15/11/2042	(1.071.021)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.38%, 15/05/2041	(1.071.085)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.75%, 15/02/2041	(1.071.070)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC

* Las garantías en efectivo pueden abarcar una combinación de instrumentos de *swaps*; por tanto, una parte de las garantías corresponde a acuerdos de *swap* que no entran en el ámbito de aplicación del Reglamento sobre operaciones de financiación de valores.

** Los activos o los pasivos en efectivo no disponen de calificación crediticia. El efectivo denominado en USD se considera de la máxima calidad debido a su naturaleza líquida.

*** La división se establece conforme a 7 periodos de vencimiento (<1 día, de 1 día a 1 semana, de 1 semana a 1 mes, de 1 mes a 3 meses, de 3 meses a 1 año, >1 año, vencimiento abierto). Las garantías de efectivo no tienen vencimiento.

**** El país coincide con la dirección de nuestra contraparte real.

El vencimiento de todos los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 se situaba entre un día y una semana.

Custodia de la garantía otorgada:

No existían garantías mantenidas en cuentas separadas, conjuntas o de otro tipo a 30 de junio de 2024.

Rentabilidad/Costes:

Los costes de las operaciones de acuerdos de recompra, si fuesen aplicables, no pueden determinarse por separado. Para estas inversiones, los costes de transacción se incluyen en el precio de compraventa y forman parte de la rentabilidad bruta de la inversión de cada Cartera. Las rentabilidades se determinan como las plusvalías/minusvalías materializadas y la variación en las plusvalías/minusvalías latentes de los acuerdos de recompra durante el período analizado.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

High Yield Bond

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en *swaps* de rentabilidad total y en acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 es el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del Valor liquidativo (%)
Acuerdos de recompra – Activos	147.000.000	6,77
<i>Swaps</i> de rentabilidad total – Pasivos	215.188	0,01

Datos sobre la reutilización de las garantías:

La garantía de efectivo se recibe en la cuenta de depósito habilitada para la Cartera y, por consiguiente, no se realiza un seguimiento específico de la misma para determinar si se reutiliza. Por tanto, no puede verificarse debidamente la reutilización de cualquier garantía de efectivo.

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2024, la Cartera no había recibido ningún valor como garantía para los *swaps* de rentabilidad total y los acuerdos de recompra.

Las contrapartes de todos los *swaps* de rentabilidad total y acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
Goldman Sachs International	215.188
State Street Bank	147.000.000

Custodia de la garantía recibida:

A 30 de junio de 2024, todas las garantías percibidas están bajo custodia del Depositario, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

High Yield Bond (cont.)

Datos agregados de las transacciones:

Los datos agregados de las transacciones con posiciones de garantías (incluido el efectivo) pignoradas o recibidas para el conjunto de los swaps de rentabilidad total y acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 son los siguientes:

Tipo de garantía		Importe en USD*	Calidad**	Vencimiento (garantía)***	Moneda de la garantía	País de establecimiento de la contraparte****	Liquidación y compensación
Swap de rentabilidad total							
Goldman Sachs International	Garantía en efectivo	270.000	n. a.	n. a.	USD	Reino Unido	OTC
Acuerdos de recompra							
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 0.75%, 15/02/2042	(20.991.691)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 1.38%, 15/11/2040	(2.998.491)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/02/2041	(20.991.659)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 2.25%, 15/05/2041	(20.991.632)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/02/2043	(20.991.661)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 15/11/2042	(20.991.604)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.38%, 15/05/2041	(20.991.657)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.75%, 15/02/2041	(20.991.628)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC

* Las garantías en efectivo pueden abarcar una combinación de instrumentos de swaps; por tanto, una parte de las garantías corresponde a acuerdos de swap que no entran en el ámbito de aplicación del Reglamento sobre operaciones de financiación de valores.

** Los activos o los pasivos en efectivo no disponen de calificación crediticia. El efectivo denominado en USD se considera de la máxima calidad debido a su naturaleza líquida.

*** La división se establece conforme a 7 periodos de vencimiento (<1 día, de 1 día a 1 semana, de 1 semana a 1 mes, de 1 mes a 3 meses, de 3 meses a 1 año, >1 año, vencimiento abierto). Las garantías de efectivo no tienen vencimiento.

**** El país coincide con la dirección de nuestra contraparte real.

El vencimiento de todas las posiciones de swaps de rentabilidad total a 30 de junio de 2024 se situaba entre 1 y 3 meses.

El vencimiento de todos los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 se situaba entre un día y una semana.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

High Yield Bond (cont.)

Custodia de la garantía otorgada:

No existían garantías mantenidas en cuentas separadas, conjuntas o de otro tipo a 30 de junio de 2024.

RENTABILIDAD/COSTES:

Los costes de las operaciones de *swaps* de rentabilidad total y de acuerdos de recompra, si fuesen aplicables, no pueden determinarse por separado. Para estas inversiones, los costes de transacción se incluyen en el precio de compraventa y forman parte de la rentabilidad bruta de la inversión de cada Cartera. Las rentabilidades se determinan como las plusvalías/minusvalías materializadas y la variación en las plusvalías/minusvalías latentes de los contratos de *swap* y de los acuerdos de recompra durante el período analizado.

Short Duration Emerging Market Debt

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 era el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del Valor liquidativo (%)
Acuerdos de recompra – Activos	12.000.000	0,32

Datos sobre la reutilización de las garantías:

La garantía de efectivo se recibe en la cuenta de depósito habilitada para la Cartera y, por consiguiente, no se realiza un seguimiento específico de la misma para determinar si se reutiliza. Por tanto, no puede verificarse debidamente la reutilización de cualquier garantía de efectivo.

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2024, la Cartera no había recibido ningún valor como garantía para los acuerdos de recompra de rentabilidad total.

Las contrapartes de todos los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
State Street Bank	12.000.000

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Short Duration Emerging Market Debt (cont.)

Custodia de la garantía recibida:

A 30 de junio de 2024, todas las garantías percibidas están bajo custodia del Depositario, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited.

Datos agregados de las transacciones:

Los datos agregados de las transacciones con posiciones de garantías (incluido el efectivo) pignoradas/(recibidas) para el conjunto de los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 eran los siguientes:

Tipo de garantía		Importe en USD*	Calidad**	Vencimiento (garantía)***	Moneda de la garantía	País de establecimiento de la contraparte****	Liquidación y compensación
Acuerdos de recompra							
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 0.75%, 15/02/2042	(1.713.608)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 1.13%, 15/08/2040	(244.661)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 1.38%, 15/11/2040	(1.713.614)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/02/2041	(1.713.656)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 2.25%, 15/05/2041	(1.713.613)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/02/2043	(1.713.639)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 15/11/2042	(1.713.648)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.75%, 15/02/2041	(1.713.664)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC

* Las garantías en efectivo pueden abarcar una combinación de instrumentos de swaps; por tanto, una parte de las garantías corresponde a acuerdos de swap que no entran en el ámbito de aplicación del Reglamento sobre operaciones de financiación de valores.

** Los activos o los pasivos en efectivo no disponen de calificación crediticia. El efectivo denominado en USD se considera de la máxima calidad debido a su naturaleza líquida.

*** La división se establece conforme a 7 periodos de vencimiento (<1 día, de 1 día a 1 semana, de 1 semana a 1 mes, de 1 mes a 3 meses, de 3 meses a 1 año, >1 año, vencimiento abierto). Las garantías de efectivo no tienen vencimiento.

**** El país coincide con la dirección de nuestra contraparte real.

El vencimiento de todos los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 se situaba entre un día y una semana.

Custodia de la garantía otorgada:

No existían garantías mantenidas en cuentas separadas, conjuntas o de otro tipo a 30 de junio de 2024.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Short Duration Emerging Market Debt (cont.)

RENTABILIDAD/COSTES:

Los costes de las operaciones de acuerdos de recompra, si fuesen aplicables, no pueden determinarse por separado. Para estas inversiones, los costes de transacción se incluyen en el precio de compraventa y forman parte de la rentabilidad bruta de la inversión de cada Cartera. Las rentabilidades se determinan como las plusvalías/minusvalías materializadas y la variación en las plusvalías/minusvalías latentes de los acuerdos de recompra durante el período analizado.

Short Duration High Yield SDG Engagement

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 era el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del Valor liquidativo (%)
Acuerdos de recompra – Activos	13.000.000	1,87

Datos sobre la reutilización de las garantías:

La garantía de efectivo se recibe en la cuenta de depósito habilitada para la Cartera y, por consiguiente, no se realiza un seguimiento específico de la misma para determinar si se reutiliza. Por tanto, no puede verificarse debidamente la reutilización de cualquier garantía de efectivo.

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2024, la Cartera no había recibido ningún valor como garantía para los acuerdos de recompra de rentabilidad total.

Las contrapartes de todos los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
State Street Bank	13.000.000

Custodia de la garantía recibida:

A 30 de junio de 2024, todas las garantías percibidas están bajo custodia del Depositario, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Short Duration High Yield SDG Engagement (cont.)

Datos agregados de las transacciones:

Los datos agregados de las transacciones con posiciones de garantías (incluido el efectivo) pignoradas/(recibidas) para el conjunto de los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 eran los siguientes:

	Tipo de garantía	Importe en USD*	Calidad**	Vencimiento (garantía)***	Moneda de la garantía	País de establecimiento de la contraparte****	Liquidación y compensación
Acuerdos de recompra							
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 0.75%, 15/02/2042	(1.856.430)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 1.38%, 15/11/2040	(264.871)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/02/2041	(1.856.437)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 2.25%, 15/05/2041	(1.856.469)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/02/2043	(1.856.482)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 15/11/2042	(1.856.469)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.38%, 15/05/2041	(1.856.417)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.75%, 15/02/2041	(1.856.447)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC

* Las garantías en efectivo pueden abarcar una combinación de instrumentos de *swaps*; por tanto, una parte de las garantías corresponde a acuerdos de *swap* que no entran en el ámbito de aplicación del Reglamento sobre operaciones de financiación de valores.

** Los activos o los pasivos en efectivo no disponen de calificación crediticia. El efectivo denominado en USD se considera de la máxima calidad debido a su naturaleza líquida.

*** La división se establece conforme a 7 períodos de vencimiento (<1 día, de 1 día a 1 semana, de 1 semana a 1 mes, de 1 mes a 3 meses, de 3 meses a 1 año, >1 año, vencimiento abierto). Las garantías de efectivo no tienen vencimiento.

**** El país coincide con la dirección de nuestra contraparte real.

El vencimiento de todos los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 se situaba entre un día y una semana.

Custodia de la garantía otorgada:

No existían garantías mantenidas en cuentas separadas, conjuntas o de otro tipo a 30 de junio de 2024.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Short Duration High Yield SDG Engagement (cont.)

Rentabilidad/Costes:

Los costes de las operaciones de acuerdos de recompra, si fuesen aplicables, no pueden determinarse por separado. Para estas inversiones, los costes de transacción se incluyen en el precio de compraventa y forman parte de la rentabilidad bruta de la inversión de cada Cartera. Las rentabilidades se determinan como las plusvalías/minusvalías materializadas y la variación en las plusvalías/minusvalías latentes de los acuerdos de recompra durante el período analizado.

Strategic Income

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en *swaps* de rentabilidad total y en acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 es el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del Valor liquidativo (%)
Acuerdos de recompra – Activos	16.500.000	0,55
<i>Swaps</i> de rentabilidad total – Activos	328.310	0,01

Datos sobre la reutilización de las garantías:

La garantía de efectivo se recibe en la cuenta de depósito habilitada para la Cartera y, por consiguiente, no se realiza un seguimiento específico de la misma para determinar si se reutiliza. Por tanto, no puede verificarse debidamente la reutilización de cualquier garantía de efectivo.

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2024, la Cartera no había recibido ningún valor como garantía para los *swaps* de rentabilidad total y los acuerdos de recompra.

Las contrapartes de todos los *swaps* de rentabilidad total y acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
Goldman Sachs International	328.310
State Street Bank	16.500.000

Custodia de la garantía recibida:

A 30 de junio de 2024, todas las garantías percibidas están bajo custodia del Depositario, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Strategic Income (cont.)

Datos agregados de las transacciones:

Los datos agregados de las transacciones con posiciones de garantías (incluido el efectivo) pignoradas o recibidas para el conjunto de los *swaps* de rentabilidad total y acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 son los siguientes:

	Tipo de garantía	Importe en USD*	Calidad**	Vencimiento (garantía)***	Moneda de la garantía	País de establecimiento de la contraparte****	Liquidación y compensación
Swap de rentabilidad total							
Goldman Sachs International	Garantía en efectivo	(270.000)	n. a.	n. a.	USD	Reino Unido	OTC
Wells Fargo Securities LLC	Garantía en efectivo	(200.000)	n. a.	n. a.	USD	Estados Unidos	OTC
Acuerdos de recompra							
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 0.75%, 15/02/2042	(2.356.221)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 1.13%, 15/08/2040	(336.315)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 1.38%, 15/11/2040	(2.356.247)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/02/2041	(2.356.230)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 2.25%, 15/05/2041	(2.356.269)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/02/2043	(2.356.273)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 15/11/2042	(2.356.273)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.75%, 15/02/2041	(2.356.259)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC

* Las garantías en efectivo pueden abarcar una combinación de instrumentos de *swaps*; por tanto, una parte de las garantías corresponde a acuerdos de *swap* que no entran en el ámbito de aplicación del Reglamento sobre operaciones de financiación de valores.

** Los activos o los pasivos en efectivo no disponen de calificación crediticia. El efectivo denominado en USD se considera de la máxima calidad debido a su naturaleza líquida.

*** La división se establece conforme a 7 periodos de vencimiento (<1 día, de 1 día a 1 semana, de 1 semana a 1 mes, de 1 mes a 3 meses, de 3 meses a 1 año, >1 año, vencimiento abierto). Las garantías de efectivo no tienen vencimiento.

**** El país coincide con la dirección de nuestra contraparte real.

El vencimiento de todas las posiciones de *swaps* de rentabilidad total a 30 de junio de 2024 se situaba entre 1 y 3 meses.

El vencimiento de todos los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 se situaba entre un día y una semana.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Strategic Income (cont.)

Custodia de la garantía otorgada:

No existían garantías mantenidas en cuentas separadas, conjuntas o de otro tipo a 30 de junio de 2024.

Rentabilidad/Costes:

Los costes de las operaciones de swaps de rentabilidad total y de acuerdos de recompra, si fuesen aplicables, no pueden determinarse por separado. Para estas inversiones, los costes de transacción se incluyen en el precio de compraventa y forman parte de la rentabilidad bruta de la inversión de cada Cartera. Las rentabilidades se determinan como las plusvalías/minusvalías materializadas y la variación en las plusvalías/minusvalías latentes de los contratos de swap y de los acuerdos de recompra durante el período analizado.

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 era el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del Valor liquidativo (%)
Acuerdos de recompra – Activos	1.000.000	0,17

Datos sobre la reutilización de las garantías:

La garantía de efectivo se recibe en la cuenta de depósito habilitada para la Cartera y, por consiguiente, no se realiza un seguimiento específico de la misma para determinar si se reutiliza. Por tanto, no puede verificarse debidamente la reutilización de cualquier garantía de efectivo.

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2024, la Cartera no había recibido ningún valor como garantía para los acuerdos de recompra inversa de rentabilidad total.

Las contrapartes de todos los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
State Street Bank	1.000.000

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency (cont.)

Custodia de la garantía recibida:

A 30 de junio de 2024, todas las garantías percibidas están bajo custodia del Depositario, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited.

Datos agregados de las transacciones:

Los datos agregados de las transacciones con posiciones de garantías (incluido el efectivo) pignoradas/(recibidas) para el conjunto de los acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 eran los siguientes:

Tipo de garantía		Importe en USD*	Calidad**	Vencimiento (garantía)***	Moneda de la garantía	País de establecimiento de la contraparte****	Liquidación y compensación
Acuerdos de recompra							
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 0.75%, 15/02/2042	(142.829)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 1.38%, 15/11/2040	(20.024)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/02/2041	(142.858)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 2.25%, 15/05/2041	(142.863)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/02/2043	(142.850)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 15/11/2042	(142.828)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.38%, 15/05/2041	(142.872)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC
State Street Bank	United States Treasury Note/Bond, 4.75%, 15/02/2041	(142.895)	AA+	>1 año	USD	Estados Unidos	OTC

* Las garantías en efectivo pueden abarcar una combinación de instrumentos de swaps; por tanto, una parte de las garantías corresponde a acuerdos de swap que no entran en el ámbito de aplicación del Reglamento sobre operaciones de financiación de valores.

** Los activos o los pasivos en efectivo no disponen de calificación crediticia. El efectivo denominado en USD se considera de la máxima calidad debido a su naturaleza líquida.

*** La división se establece conforme a 7 periodos de vencimiento (<1 día, de 1 día a 1 semana, de 1 semana a 1 mes, de 1 mes a 3 meses, de 3 meses a 1 año, >1 año, vencimiento abierto). Las garantías de efectivo no tienen vencimiento.

**** El país coincide con la dirección de nuestra contraparte real.

El vencimiento de todas las posiciones en acuerdos de recompra a 30 de junio de 2024 se situaba entre un día y una semana.

Custodia de la garantía otorgada:

No existían garantías mantenidas en cuentas separadas, conjuntas o de otro tipo a 30 de junio de 2024.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency (cont.)

Rentabilidad/Costes:

Los costes de las operaciones de acuerdos de recompra, si fuesen aplicables, no pueden determinarse por separado. Para estas inversiones, los costes de transacción se incluyen en el precio de compraventa y forman parte de la rentabilidad bruta de la inversión de cada Cartera. Las rentabilidades se determinan como las plusvalías/minusvalías materializadas y la variación en las plusvalías/minusvalías latentes de los acuerdos de recompra durante el período analizado.

Tactical Macro

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en *swaps* de rentabilidad total a 30 de junio de 2024 es el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del Valor liquidativo (%)
<i>Swaps</i> de rentabilidad total – Activos	12.304	0,04

Datos sobre la reutilización de las garantías:

La garantía de efectivo se recibe en la cuenta de depósito habilitada para la Cartera y, por consiguiente, no se realiza un seguimiento específico de la misma para determinar si se reutiliza. Por tanto, no puede verificarse debidamente la reutilización de cualquier garantía de efectivo.

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2024, la Cartera no había recibido ningún valor como garantía para los *swaps* de rentabilidad total.

Las contrapartes de todos los *swaps* de rentabilidad total a 30 de junio de 2024 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
Goldman Sachs International	12.304

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Tactical Macro (cont.)

Custodia de la garantía recibida:

A fecha de 30 de junio de 2024, el Depositario no había recibido ni mantenía garantía alguna.

Datos agregados de las transacciones:

A 30 de junio de 2024 no había posiciones de garantías (incluido el efectivo) pignoradas o (recibidas) para todos los *swaps* de rentabilidad total.

El vencimiento de todas las posiciones de *swaps* de rentabilidad total a 30 de junio de 2024 se situaba entre 1 y 3 meses.

Custodia de la garantía otorgada:

No existían garantías mantenidas en cuentas separadas, conjuntas o de otro tipo a 30 de junio de 2024.

Rentabilidad/Costes:

Los costes de las operaciones de *swaps* de rentabilidad total, si fuesen aplicables, no pueden determinarse por separado. Para estas inversiones, los costes de transacción se incluyen en el precio de compraventa y forman parte de la rentabilidad bruta de la inversión de cada Cartera. Las rentabilidades se determinan como las plusvalías/minusvalías materializadas y la variación en las plusvalías/minusvalías latentes de los contratos de *swap* durante el período analizado.

Uncorrelated Strategies

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en *swaps* de rentabilidad total a 30 de junio de 2024 es el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del Valor liquidativo (%)
<i>Swaps</i> de rentabilidad total – Activos	1.286.521	0,15
<i>Swaps</i> de rentabilidad total – Pasivos	1.625.161	0,18

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Uncorrelated Strategies (cont.)

Datos sobre la reutilización de las garantías:

La garantía de efectivo se recibe en la cuenta de depósito habilitada para la Cartera y, por consiguiente, no se realiza un seguimiento específico de la misma para determinar si se reutiliza. Por tanto, no puede verificarse debidamente la reutilización de cualquier garantía de efectivo.

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2024, la Cartera no había recibido ningún valor como garantía para los *swaps* de rentabilidad total.

Las contrapartes de todos los *swaps* de rentabilidad total a 30 de junio de 2024 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
Goldman Sachs International	381.568
Morgan Stanley	1.944.565
Société Générale	585.549

Custodia de la garantía recibida:

A 30 de junio de 2024, todas las garantías percibidas están bajo custodia del Depositario, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Uncorrelated Strategies (cont.)

Datos agregados de las transacciones:

Los datos agregados de las transacciones con posiciones de garantías (incluido el efectivo) pignoradas o recibidas para el conjunto de los *swaps* de rentabilidad total a 30 de junio de 2024 son los siguientes:

	Tipo de garantía	Importe en USD*	Calidad**	Vencimiento (garantía)***	Moneda de la garantía	País de establecimiento de la contraparte****	Liquidación y compensación
<i>Swap de rentabilidad total</i>							
Citibank	Garantía en efectivo	7.020.000	n. a.	n. a.	USD	Reino Unido	OTC
BNP Paribas	Garantía en efectivo	59.530.000	n. a.	n. a.	USD	Estados Unidos	OTC
Bank of America Merrill Lynch International	Garantía en efectivo	5.100.000	n. a.	n. a.	USD	Estados Unidos	OTC
Morgan Stanley & Co International	Garantía en efectivo	6.030.000	n. a.	n. a.	USD	Estados Unidos	OTC
Nomura International Plc	Garantía en efectivo	19.880.000	n. a.	n. a.	USD	Estados Unidos	OTC
Société Générale	Garantía en efectivo	17.490.000	n. a.	n. a.	USD	Francia	OTC
UBS AG London	Garantía en efectivo	6.000.000	n. a.	n. a.	USD	Reino Unido	OTC

* Las garantías en efectivo pueden abarcar una combinación de instrumentos de *swaps*; por tanto, una parte de las garantías corresponde a acuerdos de *swap* que no entran en el ámbito de aplicación del Reglamento sobre operaciones de financiación de valores.

** Los activos o los pasivos en efectivo no disponen de calificación crediticia. El efectivo denominado en USD se considera de la máxima calidad debido a su naturaleza líquida.

*** La división se establece conforme a 7 períodos de vencimiento (<1 día, de 1 día a 1 semana, de 1 semana a 1 mes, de 1 mes a 3 meses, de 3 meses a 1 año, >1 año, vencimiento abierto). Las garantías de efectivo no tienen vencimiento.

**** El país coincide con la dirección de nuestra contraparte real.

El vencimiento de las posiciones en *swaps* de rentabilidad total a 30 de junio de 2024 es el siguiente:

Vencimiento	Importe en USD						vencimiento abierto
	<1 día	1 día a 1 semana	1 semana a 1 mes	1 semana a 3 meses	3 meses a 1 año	> 1 año	
<i>Swaps</i> de rentabilidad total - Activos	-	-	-	83.789	1.085.863	116.869	-
<i>Swaps</i> de rentabilidad total - Pasivos	-	-	-	181.078	1.356.471	87.612	-

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Uncorrelated Strategies (cont.)

Custodia de la garantía otorgada:

La proporción de la garantía mantenida en cuentas separadas, conjuntas o de otro tipo a 30 de junio de 2024 es la siguiente:

	%
Cuentas separadas	0,00%
Cuentas conjuntas	0,00%
Otras	100,00%
	100,00%

Rentabilidad/Costes:

Los costes de las operaciones de *swaps* de rentabilidad total, si fuesen aplicables, no pueden determinarse por separado. Para estas inversiones, los costes de transacción se incluyen en el precio de compraventa y forman parte de la rentabilidad bruta de la inversión de cada Cartera. Las rentabilidades se determinan como las plusvalías/minusvalías materializadas y la variación en las plusvalías/minusvalías latentes de los contratos de *swap* durante el período analizado.

US Long Short Equity

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en *swaps* de rentabilidad total a 30 de junio de 2024 es el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del Valor liquidativo (%)
<i>Swaps</i> de rentabilidad total – Activos	3.638	0,00
<i>Swaps</i> de rentabilidad total – Pasivos	1.759.315	0,90

Datos sobre la reutilización de las garantías:

La garantía de efectivo se recibe en la cuenta de depósito habilitada para la Cartera y, por consiguiente, no se realiza un seguimiento específico de la misma para determinar si se reutiliza. Por tanto, no puede verificarse debidamente la reutilización de cualquier garantía de efectivo.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

US Long Short Equity (cont.)

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2024, la Cartera no había recibido ningún valor como garantía para los *swaps* de rentabilidad total.

Las contrapartes de todos los *swaps* de rentabilidad total a 30 de junio de 2024 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
JPMorgan Chase Bank	1.762.953

Custodia de la garantía recibida:

A fecha de 30 de junio de 2024, el Depositario no había recibido ni mantenía garantía alguna.

Datos agregados de las transacciones:

Los datos agregados de las transacciones con posiciones de garantías (incluido el efectivo) pignoradas o recibidas para el conjunto de los *swaps* de rentabilidad total a 30 de junio de 2024 son los siguientes:

	Tipo de garantía	Importe en USD*	Calidad**	Vencimiento (garantía)***	Moneda de la garantía	País de establecimiento de la contraparte****	Liquidación y compensación
<i>Swap de rentabilidad total</i>							
Bank of America Merrill Lynch International	Garantía en efectivo	280.000	n. a.	n. a.	USD	Estados Unidos	OTC
JPMorgan Chase Bank	Garantía en efectivo	5.620.000	n. a.	n. a.	USD	Estados Unidos	OTC
Goldman Sachs International	Garantía en efectivo	2.480.000	n. a.	n. a.	USD	Reino Unido	OTC

* Las garantías en efectivo pueden abarcar una combinación de instrumentos de *swaps*; por tanto, una parte de las garantías corresponde a acuerdos de *swap* que no entran en el ámbito de aplicación del Reglamento sobre operaciones de financiación de valores.

** Los activos o los pasivos en efectivo no disponen de calificación crediticia. El efectivo denominado en USD se considera de la máxima calidad debido a su naturaleza líquida.

*** La división se establece conforme a 7 periodos de vencimiento (<1 día, de 1 día a 1 semana, de 1 semana a 1 mes, de 1 mes a 3 meses, de 3 meses a 1 año, >1 año, vencimiento abierto). Las garantías de efectivo no tienen vencimiento.

**** El país coincide con la dirección de nuestra contraparte real.

Anexo II (cont.)

Reglamento sobre Operaciones de Financiación de Valores (cont.)

US Long Short Equity (cont.)

El vencimiento de las posiciones en swaps de rentabilidad total a 30 de junio de 2024 es el siguiente:

Vencimiento	Importe en USD						vencimiento abierto
	<1 día	1 día a 1 semana	1 semana a 1 mes	1 semana a 3 meses	3 meses a 1 año	> 1 año	
Swaps de rentabilidad total – Activos	-	-	-	-	-	3.638	-
Swaps de rentabilidad total – Pasivos	-	-	1.284.785	-	474.530	-	-

Custodia de la garantía otorgada:

La proporción de la garantía mantenida en cuentas separadas, conjuntas o de otro tipo a 30 de junio de 2024 es la siguiente:

	%
Cuentas separadas	0,00%
Cuentas conjuntas	0,00%
Otras	100,00%
	100,00%

Rentabilidad/Costes:

Los costes de las operaciones de swaps de rentabilidad total, si fuesen aplicables, no pueden determinarse por separado. Para estas inversiones, los costes de transacción se incluyen en el precio de compraventa y forman parte de la rentabilidad bruta de la inversión de cada Cartera. Las rentabilidades se determinan como las plusvalías/minusvalías materializadas y la variación en las plusvalías/minusvalías latentes de los contratos de swap durante el período analizado.

A 30 de junio de 2024, ninguna de las Carteras había participado en operaciones de préstamo de valores.

Anexo III

GLOSARIO DE ÍNDICES

Bloomberg Commodity Index	Se trata de un índice renovable compuesto por contratos de futuros negociados en bolsa sobre materias primas físicas. El índice se basa principalmente en datos de liquidez de contratos de futuros, junto con datos de producción ajustados a dólares estadounidenses, para determinar las cantidades relativas de materias primas incluidas. El índice está diseñado como un índice de referencia sumamente líquido y diversificado para inversiones en materias primas. La versión del índice que se calcula en términos de rentabilidad total refleja las rentabilidades generadas por una inversión 100% garantizada en los contratos de futuros sobre materias primas subyacentes, combinado con las rentabilidades generadas por la garantía en efectivo invertida en Letras del Tesoro estadounidense.
Bloomberg Euro Aggregate Bond Index (Total Return, Hedged, EUR)	El índice incluye bonos de tipo fijo con grado de inversión denominados en euros. La inclusión en el índice se basa en la moneda de la emisión y no en el domicilio del emisor. Los principales sectores del índice son bonos de deuda pública, corporativos, relacionados con el gobierno y emisiones titulizadas.
Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (Total Return, Hedged, USD)	El índice es un reconocido parámetro de la deuda corporativa global de tipo fijo y con categoría de inversión. Este índice de referencia multdivisa incluye bonos de emisores de los sectores industrial, de suministros públicos y financiero de mercados desarrollados y emergentes. El índice es un componente de los índices Global Aggregate y Multiverse.
Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, Hedged, USD)	El índice mide la deuda global con categoría de inversión de 24 mercados en divisa local e incluye bonos de deuda pública, relacionados con deuda pública, corporativos y titulizados de tipo fijo de países desarrollados y emergentes. El índice se compone en gran medida de tres importantes componentes regionales agregados: el Bloomberg US Aggregate Bond Index, el Bloomberg Pan-European Aggregate Bond Index y el Bloomberg Asian-Pacific Aggregate Index. Además de los valores de estos tres índices, el índice también incluye valores aptos para el índice en eurodólares, euroyenes, canadienses y 144A con categoría de inversión que todavía no forman parte de estos tres índices. El índice está totalmente cubierto en USD.
Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, Unhedged, USD)	El índice mide la deuda global con categoría de inversión de 24 mercados en divisa local e incluye bonos de deuda pública, relacionados con deuda pública, corporativos y titulizados de tipo fijo de países desarrollados y emergentes. El índice se compone en gran medida de tres importantes componentes regionales agregados: el Bloomberg US Aggregate Bond Index, el Bloomberg Pan-European Aggregate Bond Index y el Bloomberg Asian-Pacific Aggregate Index. Además de los valores de estos tres índices, el índice también incluye valores aptos para el índice en eurodólares, euroyenes, canadienses y 144A con categoría de inversión que todavía no forman parte de estos tres índices.
Bloomberg US Aggregate Bond Index (Total Return, USD)	El índice mide el mercado de bonos sujetos a tributación, de tipo fijo, denominados en dólares estadounidenses y con grado de inversión. Incluye bonos de deuda pública, relacionados con el gobierno, valores respaldados por hipotecas (bonos de titulización hipotecaria pass-through de tipo ajustable, tanto de tipo fijo como híbridas, emitidos por agencia), valores respaldados por activos y valores respaldados por hipotecas comerciales (emitidos y no emitidos por agencia). El índice es una referencia de base amplia que mide la rentabilidad del mercado de bonos sujetos a tributación, de tipo fijo, denominados en dólares estadounidenses y con grado de inversión. Esto incluye bonos de deuda pública, relacionados con el gobierno y corporativos, valores con respaldo hipotecario, valores respaldados por activos y valores con respaldo hipotecario garantizados.

Anexo III (cont.)

GLOSARIO DE ÍNDICES (CONT.)

Cboe S&P 500 PutWrite Index

El índice reproduce el valor de una estrategia de inversión pasiva que consiste en el *overlay* de opciones de venta a corto plazo sobre el S&P 500 (SPX) en una cuenta del mercado monetario que invierte en bonos del Tesoro a corto plazo (de uno a tres meses). Las opciones de venta SPX se ejercitan *at-the-money* y se venden con una periodicidad mensual.

Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index

El índice sigue la rentabilidad de una estrategia hipotética que vende una opción de venta sobre el S&P 500 Index (SPX) *at-the-money* semanalmente. La opción de venta sobre el SPX suscrita tiene vencimiento a una semana. La opción de venta sobre el SPX suscrita está garantizada por una cuenta del mercado monetario que invierte en letras del Tesoro a un mes. El índice se renueva semanalmente, por lo general los viernes.

FTSE Chinese Government and Policy Bank Bond 0-1 Year Select Index (Total Return, CNY)

El índice mide la rentabilidad de los bonos del Estado con anotación en cuenta a interés fijo denominados en CNY, así como bonos bancarios oficiales emitidos en China continental. Quedan excluidos los siguientes instrumentos: bonos de ahorro del Tesoro, bonos especiales del gobierno, letras del banco central, colocaciones privadas y bonos con opción de rescate y de venta.

FTSE EPRA Nareit Developed Real Estate Index (Total Return, Net of Tax, USD)

Se trata de un índice ponderado por capitalización bursátil ajustada por flotación libre que está diseñado para medir la rentabilidad de sociedades inmobiliarias cotizadas y fondos de inversión inmobiliarios (REIT) de mercados desarrollados. Los índices de rentabilidad total neta reinvierten los dividendos una vez descontadas las retenciones fiscales, utilizando (en el caso de los índices internacionales) un tipo fiscal aplicable a inversores institucionales no residentes que no se benefician de convenios para evitar la doble imposición.

FTSE Nareit All Equity REITs Index (Total Return, Net of Tax, USD)

Se trata de un índice ponderado por capitalización bursátil ajustada por flotación libre, que reproduce la rentabilidad de todos los fondos de inversión inmobiliarios (REIT) fiscalmente admisibles que cotizan en la Bolsa de Nueva York o en el NASDAQ. Los REIT de capital incluyen todos los REIT fiscalmente admisibles con más del 50% de los activos totales asignados a activos inmobiliarios aptos distintos de hipotecas con garantía inmobiliaria.

HFRX Equity Hedge Index (Total Return, USD)

El índice está diseñado para reflejar las estrategias de hedge funds de renta variable que mantienen posiciones tanto largas como cortas, principalmente en valores de renta variable y derivados relacionados. Los gestores de coberturas de renta variable mantendrían normalmente al menos el 50% de sus activos invertidos en acciones, tanto en posiciones largas como en posiciones cortas; en algunos casos, esta exposición puede llegar al 100%.

ICE BofA European Currency Non-Financial High Yield 3% Constrained Index (Total Return, EUR)

El índice mide la rentabilidad de bonos corporativos no financieros con calificación inferior a grado de inversión, denominados en EUR y GBP, emitidos por suscripción pública en el mercado de eurobonos o en los mercados domésticos de la libra esterlina o el euro, y limita la exposición a cualquier emisor al 3%. El índice contiene todos los valores no financieros del ICE BofA European Currency High Yield Index, pero con un límite de exposición al emisor del 3%.

ICE BofA Global High Yield Constrained Index (Total Return, Hedged, USD)

El índice replica la rentabilidad de la deuda corporativa con calificación inferior al grado de inversión denominada en USD, CAD, GBP y EUR emitida al público en los principales mercados nacionales o de eurobonos, y limita la exposición a cualquier emisor incluido en el índice a un máximo del 2% del mismo. El índice contiene todos los valores del ICE BofA Global High Yield Index, pero con un límite de exposición al emisor del 2%.

ICE BofA Global Hybrid Non-Financial 5% Constrained Custom Index (Total Return, Hedged, Euro)

El índice sigue la rentabilidad de bonos corporativos híbridos no financieros con grado de inversión emitidos por suscripción pública en los principales mercados domésticos y de eurobonos, y cada emisor está sujeto a una ponderación máxima del 5%.

Anexo III (cont.)

GLOSARIO DE ÍNDICES (CONT.)

ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD)

El índice reproduce la rentabilidad de un activo sintético que paga un interés equivalente al SOFR hasta un vencimiento prefijado. Este se basa en la supuesta compra al valor nominal de un instrumento sintético con una fecha de vencimiento exacta predeterminada y con un cupón equivalente al tipo oficial en esa fecha. Se asume que esa emisión se venderá al siguiente día hábil (con un rendimiento equivalente al tipo oficial en esa fecha) y se pasará a un nuevo instrumento.

ICE BofA US High Yield Constrained Index (Total Return, USD)

El índice reproduce la rentabilidad de deuda corporativa con una calificación inferior a la de grado de inversión, denominada en dólares estadounidenses y emitida por suscripción pública en el mercado doméstico de Estados Unidos. Además de cumplir otros criterios, los valores admisibles deben tener una calificación inferior al grado de inversión (basada en la calificación media de Moody's, S&P y Fitch) y mantener exposición al riesgo de los países miembros de las divisas del G10, Europa Occidental o territorios de Estados Unidos y Europa Oriental. Los valores en situación de impago quedan excluidos del índice. Los componentes del índice están ponderados por capitalización y la asignación total a un emisor individual no deberá superar el 2%.

ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR)

El índice es un subconjunto del ICE BofA All Maturity Euro Government Index que incluye todos los valores con un plazo hasta el vencimiento inferior a un año y con una calificación AAA. Este reproduce la rentabilidad de la deuda soberana denominada en euros emitida por suscripción pública por países de la zona euro en el mercado de eurobonos o en el mercado nacional del propio emisor. Los países admisibles deben formar parte de la zona euro, tener una calificación de la deuda soberana a largo plazo en divisa extranjera con grado de inversión (basada en la calificación media de Moody's, S&P y Fitch) y disponer de una fuente transparente y de fácil acceso que determine el precio de sus valores. A fin de ser considerado para su inclusión, el país deberá formar parte de la zona euro al comienzo del mes.

ICE BofA 3-Month US Treasury Bill Index (Total Return, USD)

El índice se compone de una única emisión de Letras del Tesoro estadounidense adquiridas al comienzo de cada mes y mantenidas durante un mes entero. Al final del mes esa emisión se vende y se reinvierte en una nueva seleccionada que tenga una fecha de vencimiento cercana, pero no superior, a tres meses a partir de la fecha del reajuste.

JP Morgan Asia Credit Index (JACI) (Total Return, USD)

El índice reproduce la rentabilidad total de instrumentos de deuda denominados en USD y negociados de forma activa en la región de Asia (excepto Japón). El JACI es un índice ponderado por capitalización bursátil que se compone de bonos de deuda soberana, cuasisoberana y corporativos, y está dividido por países, sectores y calificaciones crediticias.

JP Morgan ESG Asia Credit High Yield Index (JESG JACI) (Total Return, USD)

El índice replica la rentabilidad total de instrumentos de deuda denominados en USD con calificación inferior al grado de inversión negociados activamente en la región de Asia (excluyendo Japón) que cumplen ciertos criterios ASG.

JP Morgan Corporate Emerging Markets Bond Index (CEMBI)-Diversified Index (Total Return, USD)

El índice reproduce la rentabilidad de los bonos corporativos denominados en dólares estadounidenses de mercados emergentes, incluyendo países de Asia, Europa, América Latina y Oriente Próximo/África. La versión diversificada del índice está ponderada por capitalización bursátil y limita las ponderaciones de los países del índice que tienen unos grandes niveles de deuda corporativa, incluyendo solo una parte especificada del valor nominal de la deuda circulante admisible de esos países. Con efecto a partir del 31 de marzo de 2022, Rusia y Bielorrusia se excluyeron de los índices de renta fija de JP Morgan. El valor de mercado del índice para toda la deuda rusa y bielorrusa se redujo a cero, en reflejo de la pérdida de rentabilidad total asociada a la alteración del mercado.

Anexo III (cont.)

GLOSARIO DE ÍNDICES (CONT.)

JP Morgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) - Global Diversified (Total Return, USD)

El índice reproduce la rentabilidad de instrumentos de deuda denominados en dólares estadounidenses emitidos por entidades soberanas y cuasisoberanas de mercados emergentes (bonos Brady, préstamos y eurobonos), incluyendo países de mercados emergentes de Asia, Europa, América Latina y Oriente Próximo/África. La versión global del índice captura un universo amplio y completo de emisiones de mercados emergentes. La versión diversificada del índice está ponderada por capitalización bursátil y limita las ponderaciones de los países del índice que tienen unos grandes niveles de deuda, incluyendo solo una parte especificada del valor nominal de la deuda circulante admisible de esos países. Con efecto a partir del 31 de marzo de 2022, Rusia y Bielorrusia se excluyeron de los índices de renta fija de JP Morgan. El valor de mercado del índice para toda la deuda rusa y bielorrusa se redujo a cero, en reflejo de la pérdida de rentabilidad total asociada a la alteración del mercado.

JP Morgan ESG CEMBI Broad Diversified (Total Return, USD)

El índice replica la rentabilidad de instrumentos de deuda líquidos de interés fijo y variable de mercados emergentes denominados en USD emitidos por empresas. El índice aplica una puntuación y una metodología de selección ESG para inclinarse por emisores con una calificación superior conforme a los criterios ESG y por emisiones de bonos verdes, así como para mantener una infraponderación en los emisores con calificaciones más bajas y descartarlos.

JP Morgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified Index (Total Return, USD)

El índice sigue la rentabilidad de instrumentos de deuda líquidos, de tipo fijo y variable denominados en dólares estadounidenses, emitidos por entidades soberanas o cuasisoberanas de mercados emergentes (bonos Brady, préstamos y eurobonos) con un vencimiento residual mínimo de 2,5 años. El índice aplica una puntuación y una metodología de selección ESG para inclinarse por emisores con una calificación superior conforme a los criterios ESG y por emisiones de bonos verdes, así como para mantener una infraponderación en los emisores con calificaciones más bajas y descartarlos.

JP Morgan Government Bond Index (GBI) Emerging Markets - Global Diversified (Total Return, Unhedged, USD)

El índice reproduce la rentabilidad de bonos denominados en moneda local emitidos por gobiernos de mercados emergentes, incluyendo países de Asia, Europa, América Latina y Oriente Próximo/África. La versión global del índice incluye solamente países que son accesibles para la mayor parte de la base de inversores internacionales, mientras que los países con unos controles explícitos del capital están excluidos. La versión diversificada del índice está ponderada por capitalización bursátil y la ponderación máxima de un país se limita al 10%. Con efecto a partir del 31 de marzo de 2022, Rusia y Bielorrusia se excluyeron de los índices de renta fija de JP Morgan. El valor de mercado del índice para toda la deuda rusa y bielorrusa se redujo a cero, en reflejo de la pérdida de rentabilidad total asociada a la alteración del mercado.

JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified Investment Grade 15% Cap Index (Total Return, Unhedged, USD)

El índice mide la rentabilidad de los mercados de deuda de mercados emergentes denominados en moneda local.

MSCI AC Asia Index (Total Return, Net of Tax, USD)

Se trata de un índice ponderado por capitalización bursátil ajustada por flotación libre que está diseñado para medir la rentabilidad de una representación de gran y mediana capitalización en países de mercados desarrollados y países de mercados emergentes de Asia.

Anexo III (cont.)

GLOSARIO DE ÍNDICES (CONT.)

MSCI All Country World Index (ACWI) (Total Return, Net of Tax, USD)

Se trata de un índice ponderado por capitalización bursátil ajustada por flotación libre que está diseñado para medir la rentabilidad del mercado de renta variable de países desarrollados y emergentes. El índice se compone de 47 índices de países (23 desarrollados y 24 emergentes). Los índices de países de mercados desarrollados incluidos son: Australia, Austria, Bélgica, Canadá, Dinamarca, Finlandia, Francia, Alemania, Hong Kong, Irlanda, Israel, Italia, Japón, Países Bajos, Nueva Zelanda, Noruega, Portugal, Singapur, España, Suecia, Suiza, Reino Unido y Estados Unidos. Los índices de países de mercados emergentes incluidos son: Brasil, Chile, China, Colombia, República Checa, Egipto, Grecia, Hungría, India, Indonesia, Corea, Kuwait, Malasia, México, Perú, Filipinas, Polonia, Qatar, Arabia Saudí, Sudáfrica, Taiwán, Tailandia, Turquía y EAU. Las acciones A chinas se incluyen a partir del 1 de junio de 2018 y están parcialmente representadas al 20% de su capitalización bursátil ajustada por flotación libre desde noviembre de 2019. Los índices de rentabilidad total neta reinvierten los dividendos una vez descontadas las retenciones fiscales, utilizando (en el caso de los índices internacionales) un tipo fiscal aplicable a inversores institucionales no residentes que no se benefician de convenios para evitar la doble imposición. Con efecto a partir del cierre del 9 de marzo de 2022, MSCI reclasificó sus índices de Rusia de la categoría de Mercados Emergentes a la de Mercados Independientes. En ese momento, todos los valores rusos se eliminaron de este índice a un precio final de 0,00001, incluyendo tanto los componentes de renta variable rusa negociados localmente como los componentes de ADR/GDR rusos.

MSCI All Country World (ACWI) Value Index (Total Return, Net of Tax, USD)

Se trata de un índice ponderado por capitalización bursátil ajustada por flotación libre, que está diseñado para representar la rentabilidad de acciones de mediana y gran capitalización que presentan características generales del estilo de valor, emitidas en 23 mercados desarrollados y 24 emergentes. Las características del estilo de inversión de valor para este índice se definen empleando tres variables: valor contable/precio, previsiones de beneficios/precio para los próximos 12 meses y rendimiento por dividendos.

MSCI China A Onshore Index (Total Return, Net, CNY)

Se trata de un índice ponderado por capitalización, que puede albergar un número diverso de valores integrantes y está diseñado para medir el desempeño del conjunto de la economía de la RPC mediante cambios en el valor de mercado agregado de los mayores valores que representan a todas las industrias importantes.

MSCI China All Shares Index (Total Return, Net, USD)

Se trata de un índice ponderado por capitalización bursátil ajustada por flotación libre que está diseñado para medir la rentabilidad del mercado de renta variable clases de acciones chinas cotizadas en Hong Kong, Shanghai, Shenzhen y fuera de China. Abarca el universo de renta variable integrado de los índices MSCI China, que comprende acciones A, acciones B, acciones H, Red chips, P-chips y emisiones extranjeras cotizadas fuera de China o Hong Kong (como ADR). Las acciones A corresponden a empresas constituidas en China y se negocian en los mercados de Shanghai y Shenzhen; cotizan en renminbi local y están sujetas a la regulación para inversiones extranjeras (QFII). Las acciones B corresponden a empresas constituidas en China y se negocian en los mercados de Shanghai y Shenzhen; cotizan en monedas extranjeras (USD en Shanghai y HKD en Shenzhen), y están disponibles para inversores extranjeros. Las acciones H corresponden a empresas constituidas en China y se negocian en el mercado de Hong Kong y en otros mercados extranjeros. Los Red chips y P-chips corresponden a empresas constituidas fuera de China y se negocian en el mercado de Hong Kong. Por lo general, los Red chips están controlados por el Estado, o una provincia o municipio. Los P-Chips corresponden a empresas chinas de titularidad no estatal constituidas fuera de China continental y negociadas en Hong Kong. Los índices de rentabilidad total neta reinvierten los dividendos una vez descontadas las retenciones fiscales, utilizando (en el caso de los índices internacionales) un tipo fiscal aplicable a inversores institucionales no residentes que no se benefician de convenios para evitar la doble imposición.

Anexo III (cont.)

GLOSARIO DE ÍNDICES (CONT.)

MSCI Emerging Markets Index (Total Return, Net of Tax, USD)	Se trata de un índice ponderado por capitalización bursátil ajustada por flotación libre que está diseñado para medir la rentabilidad del mercado de renta variable de mercados emergentes. El índice se compone de los siguientes 24 índices de países de mercados emergentes: Brasil, Chile, China, Colombia, República Checa, Egipto, Grecia, Hungría, India, Indonesia, Corea, Kuwait, Malasia, México, Perú, Filipinas, Polonia, Qatar, Arabia Saudí, Sudáfrica, Taiwán, Tailandia, Turquía y EAU. Las acciones A chinas se incluyen a partir del 1 de junio de 2018 y están parcialmente representadas al 20% de su capitalización bursátil ajustada por flotación libre desde noviembre de 2019. Con efecto a partir del cierre del 9 de marzo de 2022, MSCI reclasificó sus índices de Rusia de la categoría de Mercados Emergentes a la de Mercados Independientes. En ese momento, todos los valores rusos se eliminaron de este índice a un precio final de 0,00001, incluyendo tanto los componentes de renta variable rusa negociados localmente como los componentes de ADR/GDR rusos. Los índices de rentabilidad total neta reinvierten los dividendos una vez descontadas las retenciones fiscales, utilizando (en el caso de los índices internacionales) un tipo fiscal aplicable a inversores institucionales no residentes que no se benefician de convenios para evitar la doble imposición.
MSCI Europe Index (Total Return, Net of Tax, EUR)	Se trata de un índice ponderado por capitalización bursátil ajustada por flotación libre diseñado para medir la rentabilidad del mercado de renta variable de mercados desarrollados de Europa.
MSCI Japan Small Cap Net Index (Total Return, JPY)	El índice está diseñado para medir la rentabilidad del segmento de pequeña capitalización del mercado japonés.
MSCI World Index (Total Return, Net of Tax, USD)	Se trata de un índice ponderado por capitalización bursátil ajustada por flotación libre diseñado para medir la rentabilidad del mercado de renta variable de mercados desarrollados.
Russell 1000 Value Index (Total Return, Net of Tax, USD)	Se trata de un índice ponderado por capitalización bursátil ajustada por flotación que mide la rentabilidad del segmento de valor de gran capitalización del mercado de renta variable estadounidense. Incluye aquellas empresas del Russell 1000 Index que tienen unas ratios de precio/valor contable más bajas y unas menores previsiones de crecimiento. El índice se reequilibra en junio con periodicidad anual.
Russell 2000 Index (Total Return, Net of Tax, USD)	Se trata de un índice ponderado por capitalización bursátil ajustada por flotación que mide la rentabilidad del segmento de pequeña capitalización del mercado de renta variable estadounidense. Incluye aproximadamente 2.000 de las empresas más pequeñas que integran el Russell 3000 Index (que mide la rentabilidad de las 3.000 mayores sociedades por acciones estadounidenses basándose en la capitalización bursátil total). El índice se reequilibra en junio con periodicidad anual.
Russell 2000 Value Index (Total Return, Net of Tax, USD)	Se trata de un índice ponderado por capitalización bursátil ajustada por flotación que mide la rentabilidad del segmento de valor de pequeña capitalización del mercado de renta variable estadounidense. Incluye aquellas empresas del Russell 2000 Index que tienen unas ratios de precio/valor contable más bajas y unas menores previsiones de crecimiento. El índice se reequilibra en junio con periodicidad anual.
S&P 500 Index (Total Return, Net of Tax, USD)	Se trata de un índice ponderado por capitalización de mercado ajustada por flotación que se centra en el segmento de gran capitalización del mercado de renta variable estadounidense e incluye una parte importante del valor total del mercado.
Media ponderada de 2/3 del JP Morgan EMBI Global Diversified Investment Grade Index, Global Diversified Investment Grade Index (Total Return, USD) y 1/3 del JP Morgan GBI EM Global Diversified Investment Grade 15% Cap Index (Total Return, Unhedged, USD)	El índice combinado se compone de la media ponderada de 2/3 del JP Morgan EMBI Global Diversified Investment Grade Index (Total return, USD) (anteriormente descrito) y 1/3 del JP Morgan GBI-EM Global Diversified Index Investment Grade 15% Cap Index (Total Return, Unhedged, USD) (anteriormente descrito), y se reajusta con frecuencia mensual.

Anexo III (cont.)

GLOSARIO DE ÍNDICES (CONT.)

Compuesto por el 50% del JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified Index (Total Return, Unhedged, USD), el 25% del JP Morgan EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) y el 25% del JP Morgan CEMBI Diversified Index (Total Return, USD)

Este índice híbrido está formado por el 50% del JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified, el 25% del JP Morgan EMBI Global Diversified y el 25% del JP Morgan CEMBI Diversified (todos descritos anteriormente) y se reajusta con frecuencia mensual. Con efecto a partir del 31 de marzo de 2022, Rusia y Bielorrusia se excluyeron de los índices de renta fija de JP Morgan. El valor de mercado del índice para toda la deuda rusa y bielorrusa se redujo a cero, en reflejo de la pérdida de rentabilidad total asociada a la alteración del mercado.

50% Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index / 50% Cboe S&P 500 PutWrite Index

El índice combinado se compone del 50% del Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index (anteriormente descrito) y 50% del Cboe S&P 500 PutWrite Index (anteriormente descrito).

Anexo IV

GESTORAS, GESTORES DELEGADOS DE INVERSIONES Y SUBASESORES

En la siguiente tabla se facilita información sobre los Gestores, los Gestores delegados de inversiones y los Subasesores de cada Cartera:

Denominación del Fondo	Gestora	Gestores delegados de inversiones	Subasesores (vinculados)	Subasesores (no vinculados)
5G Connectivity	Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited («NBAMIL»)	Neuberger Berman Investment Advisers LLC («NBIA») Neuberger Berman Asia Limited («NBAL»)		
China A-Share Equity	NBAMIL	NBIA NBAL		
China Bond	NBAMIL	NBIA Neuberger Berman Singapore Pte. Limited («NBS») NBAL	Neuberger Berman Fund Management (China) Limited («NB China»)	
China Equity	NBAMIL			Green Court Capital Management Limited («Green Court»)
Climate Innovation	NBAMIL	NBIA NBEL		
CLO Income	NBAMIL	NBIA		
Commodities	NBAMIL	NBIA NBEL		
Corporate Hybrid Bond	NBAMIL	NBIA NBS		
Developed Market FMP – 2027	NBAMIL	NBIA NBEL		
Emerging Market Debt – Hard Currency	NBAMIL	NBIA NBS		
Emerging Market Debt – Local Currency	NBAMIL	NBIA NBS	NB China	
Emerging Market Debt Blend	NBAMIL	NBIA NBS	NB China	
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	NBAMIL	NBIA NBS		
Emerging Markets Equity	NBAMIL	NBIA NBAL		
Euro Bond	NBAMIL			
Euro Bond Absolute Return	NBAMIL			
European High Yield Bond	NBAMIL	NBIA		

Anexo IV (cont.)

GESTORAS, GESTORES DELEGADOS DE INVERSIONES Y SUBASESORES (CONT.)

Denominación del Fondo	Gestora	Gestores delegados de inversiones	Subasesores (vinculados)	Subasesores (no vinculados)
European Sustainable Equity	NBAMIL	NBIA		
Event Driven	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
Global Bond	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Global Equity Megatrends	NBAMIL	NBIA		
Global Flexible Credit Income	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Global High Yield SDG Engagement	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Global Investment Grade Credit	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
Global Opportunistic Bond	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Global Real Estate Securities	NBAMIL	NBIA		
		NBAL		
Global Sustainable Equity	NBAMIL	NBIA		
Global Sustainable Value	NBAMIL	NBIA		
		Neuberger Berman Canada ULC («NB Canada»)		
High Yield Bond	NBAMIL	NBIA		
InnovAsia 5G	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
		NBAL		
Japan Equity Engagement	NBAMIL	Neuberger Berman East Asia Limited («NBEAL»)		
Next Generation Mobility	NBAMIL	NBIA		
		NBAL		
Next Generation Space Economy	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		

Anexo IV (cont.)

GESTORAS, GESTORES DELEGADOS DE INVERSIONES Y SUBASESORES (CONT.)

Denominación del Fondo	Gestora	Gestores delegados de inversiones	Subasesores (vinculados)	Subasesores (no vinculados)
Responsible Asian Debt – Hard Currency	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Short Duration Emerging Market Debt	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Short Duration High Yield SDG Engagement	NBAMIL	NBIA		
Strategic Income	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Sustainable Asia High Yield	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
		NBS		
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
		NBS		
Tactical Macro	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
Ultra Short Term Euro Bond	NBAMIL	NBEL		
Uncorrelated Strategies	NBAMIL	NBIA	NB Alternatives Advisers LLC («NBAA»)	Altiq LLP
				BH-DG Systematic Trading LLP
				P/E Global LLC
				True Partner Capital USA Holding Inc
				Cipher Capital LP (hasta el 3 de mayo de 2024)
				G10 Capital Limited
				Crabel Capital Management, LLC
				AllianceBernstein L.P
				Portman Square Capital LLP
				Soloda Investment Advisors LLP (hasta el 25 de abril de 2024)

Anexo IV (cont.)

GESTORAS, GESTORES DELEGADOS DE INVERSIONES Y SUBASESORES (CONT.)

Denominación del Fondo	Gestora	Gestores delegados de inversiones	Subasesores (vinculados)	Subasesores (no vinculados)
US Equity	NBAMIL	NBIA		
US Equity Index PutWrite	NBAMIL	NBIA		
US Large Cap Value	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
US Long Short Equity	NBAMIL	NBIA		
US Multi Cap Opportunities	NBAMIL	NBIA		
US Real Estate Securities	NBAMIL	NBIA		
US Small Cap	NBAMIL	NBIA		
US Small Cap Intrinsic Value	NBAMIL	NBIA		

El presente documento lo emite Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited («NBAMIL»), entidad autorizada y regulada por el Banco Central de Irlanda («BCI») y registrada en Irlanda, con domicilio en 2 Central Plaza Dame Street, Dublin 2. En Suiza el representante y agente de pagos es BNP Paribas Securities Services, sucursal de Zúrich, Selnaustrasse 16, 8002 Zúrich, Suiza. Tanto el lugar de cumplimiento como el lugar de jurisdicción de las acciones de los subfondos de la Sociedad ofrecidos o distribuidos en o desde Suiza, será la sede del representante en Suiza. Se podrán solicitar del representante en Suiza sin gasto el folleto, los documentos de datos fundamentales para el inversor, los estatutos sociales de la sociedad, las cuentas anuales más recientes, así como cualesquiera cuentas semestrales de la Sociedad que se hayan publicado con posterioridad.

Neuberger Berman Investments Funds plc (la «Sociedad») está autorizado por el Banco Central de Irlanda (el «Banco Central») como Organismo de Inversión Colectiva en Valores Mobiliarios de conformidad con los European Communities («UCITS») Regulations de 2011 (S.I. 352 de 2011) de Irlanda, en su versión modificada.

El presente documento se ofrece exclusivamente con fines informativos solo a personas que sean clientes profesionales o contrapartes aptas. Toda la información estará sujeta a modificación sin previo aviso. Queda prohibida la reproducción de cualquiera de las partes de este documento sin el consentimiento por escrito de NBAMIL. Los datos de empresas, si procede, incluido lo relativo a empleados y activos sobre cifras de gestión reflejan datos colectivos de los distintos asesores de inversión vinculados que son filiales de Neuberger Berman Group LLC (la «empresa»). El historial o la información cronológica de la empresa se retrotrae a la fundación en 1939 de Neuberger & Berman (antecesora de Neuberger Berman Group LLC), y destaca las ampliaciones de negocio clave, incluidas las derivadas de adquisiciones de los distintos asesores de inversión vinculados que actualmente integran la empresa. Los profesionales de la inversión referidos incluyen gestores de carteras, analistas y asociados de investigación, corredores, especialistas en productos y equipos dedicados de economistas y estrategas.

A pesar de que Neuberger Berman estima que la información es correcta en la fecha de publicación, no se hacen declaraciones ni se prestan garantías a este respecto, y Neuberger Berman no puede aceptar responsabilidad alguna frente al receptor del presente documento o usuarios finales por cualesquiera acciones adoptadas con base en la información dispuesta en el presente documento. No se deberá emplear como respaldo a ningún efecto la información y opiniones dispuestas en el presente documento, ni su precisión o exhaustividad. Las opiniones aquí expresadas reflejan la opinión de Neuberger Berman y podrían variar sin previo aviso. La Sociedad podría no reunir los requisitos necesarios para su comercialización en determinados países y no ser adecuada para todos los tipos de inversores, consulte el Folleto vigente para obtener más información. Visite la página www.nb.com/europe/literature.html para obtener más información.

Los títulos de renta fija están sujetos al riesgo de la capacidad del emisor para cumplir con los pagos de principal e intereses sobre la obligación (riesgo de crédito), y también podrán estar sujetos a la volatilidad de los precios debido a factores como la sensibilidad de los tipos de interés, la percepción del mercado de la solvencia del emisor y la liquidez general del mercado (riesgo de mercado). Los títulos de renta fija también están expuestos al riesgo de rebaja de las calificaciones crediticias de los respectivos emisores, lo que puede ocasionar caídas importantes del valor de dichos títulos.

Es más probable que los títulos de menor calificación o sin calificación (esto es, de categoría inferior a la inversión o de alta rentabilidad) reaccionen ante acontecimientos que afecten al mercado y al riesgo de crédito que los títulos de mayor calificación, que reaccionan principalmente ante los movimientos del nivel general de los tipos de interés. Los inversores deberán evaluar con atención los riesgos inherentes a la inversión en títulos de alta rentabilidad, y comprender que, por lo general, dichos títulos no están concebidos para la inversión a corto plazo. Los inversores que suscriben en una divisa distinta de la divisa de la cuenta de la Sociedad se exponen al riesgo de divisas. Las fluctuaciones de estos tipos de cambio podrán afectar a la rentabilidad de la inversión.

Las rentabilidades pasadas no son necesariamente indicativas de los resultados futuros. Para obtener información sobre los riesgos de inversión, que pueden incluir, entre otros, riesgos de liquidez, de tipo de interés, y de crédito y divisas, consulte el folleto vigente. Tenga en cuenta que cualesquiera dividendos/intereses que pueda percibir la Sociedad estarán sujetos a la retención de impuestos. El índice de referencia no tiene en cuenta los efectos de los impuestos y, por consiguiente, dicha deducción no se refleja en la rentabilidad del índice de referencia que se muestra en el presente documento. El objetivo de inversión y la rentabilidad de referencia son meramente un objetivo y no una garantía de la rentabilidad de la Sociedad. El índice no está gestionado y no se puede invertir directamente en él. La rentabilidad del índice presupone la reinversión de los dividendos y las plusvalías y, a diferencia de la rentabilidad del Fondo, no refleja comisiones ni gastos. Los movimientos adversos de los tipos de cambio de divisas pueden dar lugar a un descenso de la rentabilidad y a una pérdida del capital. Las inversiones de cada Cartera pueden cubrirse de forma íntegra en su moneda de cuenta. Aunque esto puede contribuir a reducir los riesgos cambiarios, también puede exponer a la Cartera a otros riesgos como, por ejemplo, el impago de una contraparte. Como ya se ha indicado, para obtener información adicional relativa a los riesgos específicos de la presente estrategia, consulte el folleto vigente.

Neuberger Berman es una marca registrada.

© 2024 Neuberger Berman